富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金

2014 年度报告摘要

基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2015年3月30日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国富成长动力股票
基金主代码	450007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月25日
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	99,648,024.43
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于具有内生性增长和外延式扩张的积极成长型企业,在合理控制风险的基础上,力求实现基金资产的长期增值。
投资策略	大类资产配置: 本基金管理人将以大类资产的预期收益率、风险水平和它们之间的相关性为出发点,对于可能影响资产预期风险、收益率和相关性的因素进行综合分析和动态跟踪,据此制定本基金在股票、债券和货币市场工具等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,并进行定期或不定期的调整,以达到控制风险、增加收益的目的。 股票选择策略: 本基金在适度的大类资产配置的基础上运用"精选成长股"的股票投资策略。 本基金股票的选择分为三个层次:首先,成长型筛选是针对企业历史财务指标,应用数量模型筛选股票,连同研究员实地调研推荐的部分股票,建立备选股票库;其次,对备选股票库的股票应用估值模型进行价值评估;最后,对投资目标的商业模式进行分析,找出未来成长的动力,进行整体优化,选择股票投资组合。 债券投资策略: 本基金的债券投资为股票投资由于市场条件所限,不易实施预定投资策略时,使部分资产保值增值的防守性措施。债券投资组合的回报主要来自于组合的久期管理,识别收益率曲线中价值低估的部分以及各类债券中价值低估的种类。
业绩比较基准	85%×沪深300指数+ 10%×中债国债总指数(全价)+ 5%×同业存款息率
风险收益特征	本基金是股票型基金,属于较高收益,较高风险的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国海富兰克林基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	王永民
	联系电话	021-3855 5555	010-66594896
	电子邮箱	service@ftsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680和021-38789555	95566
传真		021-6888 3050	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	16,931,510.79	23,533,369.10	-56,409,903.93
本期利润	49,064,909.32	16,722,469.61	92,326,849.46
加权平均基金份额本期利润	0.3832	0.0787	0.1010
本期加权平均净值利润率	41.14%	8.51%	11. 87%
本期基金份额净值增长率	51.89%	0.55%	12.48%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配利润	36,968,028.91	-13,932,291.10	-65,547,407.59
期末可供分配基金份额利润	0.3710	-0.0974	-0.1023
期末基金资产净值	136,616,053.34	129,125,135.82	575,357,286.31
期末基金份额净值	1.3710	0.9026	0.8977
3.1.3 累计期末指标	2014年末	2013年末	2012年末
基金份额累计净值增长率	61.07%	6.04%	5.46%

注:

1.上述财务指标采用的计算公式,详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则–第1号《主要财务指标的计算及披露》。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

4. 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如,开放式基金的申购赎回费等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	35.07%	1.67%	36.99%	1.40%	-1.92%	0.27%
过去六个月	52.28%	1.34%	52.33%	1.13%	-0.05%	0.21%
过去一年	51.89%	1.30%	43.83%	1.03%	8.06%	0.27%
过去三年	71.78%	1.29%	42.88%	1.10%	28.90%	0.19%
过去五年	30.87%	1.31%	0.75%	1.16%	30.12%	0.15%
自基金合同生效日起至今	61.07%	1.35%	39.14%	1.24%	21.93%	0.11%

注:根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定,本基金的业绩比较基准=沪深300指数×85%+中债国债总指数(全价)×10% + 同业存款利率×5%。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深300指数,债券投资部分的业绩比较基准采用中债国债总指数(全价),两个指数均具有较强的代表性。

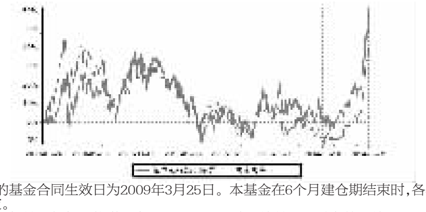
本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理,1日收益率(Benchmarkt)按下列公式计算:

Benchmarkt = 85% ×(沪深300指数t/沪深300指数t–1–1) +10%×(中债国债总指数(全价)t / 中债国债总指数(全价)t–1–1) + 5% ×同业存款利率/360

其中,t=1,2,3,…, T,T表示时间截止日。

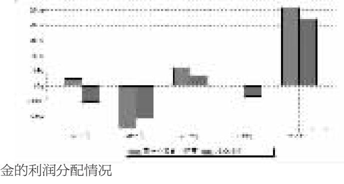
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年3月25日–2014年12月31日)



注:本基金的基金合同生效日为2009年3月25日。本基金在6个月建仓期结束时,各项投资比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014年	–	–	–	–	
2013年	–	–	–	–	
2012年	–	–	–	–	
合计	–	–	–	–	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国海富兰克林基金管理有限公司成立于2004年11月,由国海证券股份有限公司和富兰克林邓普顿投资集团全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建,目前公司注册资本2.2亿元人民币,国海证券股份有限公司持有51%的股份, 邓普顿国际股份有限公司持有49%的股份。

国海证券股份有限公司是国内A股市场第16家上市券商,是拥有全业务牌照,营业网点遍布中国主要城市的全国性综合类证券公司。富兰克林邓普顿投资集团是世界知名基金管理公司,在全球市场上有超过65年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿投资集团享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系,借助国海证券股份有限公司的综合业务优势,力争成为国内一流的基金管理公司。

本公司具有丰富的管理基金经验。自2005年6月第一只基金成立开始,截至本报告期末,本公司已经成功管理了17只基金产品(包含A、B、C类债券基金,A、B类货币市场基金)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘伟亭	公司行业研究主管,国富成长动力股票基金的基金经理	2011年7月27日	–	9年	刘伟亭先生,CFA,复旦大学经济学硕士。历任长江巴黎百富勤证券有限责任公司企业融资部助理经理,资本市场部业务主任和首席债券交易员,国海富兰克林基金管理有限公司研究员,高级研究员,国富弹性市值股票基金和国富深化价值股票基金的基金经理助理。截至本报告期担任国海富兰克林基金管理有限公司行业研究主管,国富成长动力股票基金的基金经理。

注:

1. 表中"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期,其中,首任基金经理的"任职日期"为基金合同生效日。

2. 表中"证券从业年限"的计算标准为该名员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司建立了《公平交易管理制度》,确保公司旗下投资组合能够得到公平对待,避免各种投资组合之间的利益输送行为。我们主要从如下几个方面对公平交易进行控制:

1.在研究信息共享方面,投资研究等部门通过定期的例会沟通机制,就相关议题进行讨论;公司建立了统一的研究平台,研究报告信息通过研究平台进行发布。

2.建立投资对象备选库,股票及债券的入库需要由研究报告支持作为依据,并经过相关领导审批;建立研究报告的定期更新机制。

3.在投资决策方面,公司在各类资产管理业务之间建立防火墙,确保业务隔离及人员隔离,同时各投资组合经理投资决策保持独立。

4.公司对所有投资组合的交易指令实行集中交易,公司在交易系统中设置公平交易功能,按照时间优先、价格优先的原则执行各账户所有指令;公司建立和完善了对债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易分配制度,以确保相关投资组合能够得到公平对待。

5.公司建立了《同日反向交易管理办法》,通过事前审批来对反向交易进行事前控制。公司每季度对不同时间窗下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。

6.公司定期对公平交易执行情况进行监察稽核,并在监察稽核定期报告中做专项说明。公司也会在各投资组合的定期报告中,披露公平交易制度执行情况及异常交易行为专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内公司严格执行《公平交易管理制度》,明确了公平交易的原则和目标,制订了实现公平交易的具体措施,并在技术上按照公平交易原则实现了严格的交易公平分配。

报告期末,公司共管理了十七只公募基金及四只专户产品。统计所有投资组合分投资类别(股票、债券)过去连续4个季度内在不同时间窗口(T=1、T=3和T=5)存在同向交易价差的样本,并对差价率均值、交易价格占优比率、t值、贡献率等指标进行分析。

报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司按照《异常交易监控与报告制度》,系统划分了异常交易的类型、异常交易的界定标准、异常交易的识别程序,制订了异常交易的监控办法,并规范了异常交易的分析、报告制度。

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。

报告期内,公司不同投资组合之间发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况发生一次,为相关投资组合经理因投资组合投资策略不同而发生的同日反向交易,经公司检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

过去一年我国经济处于降速、结构转型升级和驱动力换挡期,整体波澜不惊,但改革大气候逐步深入人心。前三季度,市场依然延续存量资金博弈形态,代表转型升级和新经济的小盘股表现要远好于代表老经济的大盘蓝筹股,这段时期本基金主要通过个股选择去获取阿尔法,从国企改革释放活力和增长空间较大的新兴产业入手去挑选符合本基金投资标准的标的;三季度后由于货币政策进入宽松周期,市场风险偏好逐步上升,市场逐步转化为增量资金驱动,过去受到压制的传统行业估值开始进入修复期,整体表现为大盘指数强,小盘指数弱的格局;估值跃升机会挖掘是本基金核心专注方向之一,基于前述分析,本季度本基金主要配置方向是券商和利率敏感型行业,同时降低防守型行业和中小盘配置,从结果来看,获得了较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

基金的本年度收益率为51.89%,跑赢基准8.06个百分点,业绩贡献主要来自于良好的个股选择和相对正确的行业配置上。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间我国经济整体依然处于新常态期,随着改革不断释放活力、资本市场对外进一步开放和衍生工具不断丰富,市场整体可能会表现为宽幅震荡的上升,结构性机会依然是主要特征,因此在操作上,本基金将依据市场阶段特征,提高投资的灵活性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程,按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会(简称"估值委员会"),并已制订了《公允估值管理办法》。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务,确保基金估值的公允、合理,保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由总经理或其任命者负责,成员包括投研、风险控制、监察稽核、交易、基金核算方面的部门主管,相关人员均具有丰富的证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末,根据本基金基金合同和相关法律法规的规定,本基金无应分配但尚未实施分配的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

会计师出具了无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

姓名	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	7,397,644.43	10,602,890.91
结算备付金	657,234.75	281,011.79
存出保证金	51,069.88	58,506.78
交易性金融资产	130,507,718.75	115,603,549.10
其中:股票投资	130,507,718.75	115,603,549.10
基金投资		
债券投资	–	–
资产支持证券投资	–	–
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	16,672.76	4,491,202.87
应收利息	1,723.82	1,775.16
应收股利	–	–
应收申购款	683,242.70	2,470.64
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	139,315,307.09	131,041,407.25
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债:		
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	–	1,277,530.58
应付赎回款	1,788,424.16	40,213.55
应付管理人报酬	156,634.39	165,305.60
应付托管费	26,105.69	27,550.92
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	362,706.61	145,602.33
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	365,382.90	260,068.45
负债合计	2,699,253.75	1,916,271.43
所有者权益:		
实收基金	99,648,024.43	143,057,426.92
未分配利润	36,968,028.91	-13,932,291.10
所有者权益合计	136,616,053.34	129,125,135.82
负债和所有者权益总计	139,315,307.09	131,041,407.25

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.3710元,基金份额总额99,648,024.43份。

7.2 利润表

会计主体:富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

姓名	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	52,830,081.58	23,038,662.87
1.利息收入	66,143.22	214,626.37
其中:存款利息收入	63,354.33	185,646.53
债券利息收入	–	239.24
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	2,788.89	28,740.60
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)	20,612,576.21	29,233,319.32
其中:股票投资收益	19,676,344.14	27,086,709.50
基金投资收益		
债券投资收益	–	44,785.96
7.4.7.14	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	936,232.07	2,101,823.86
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	32,133,398.53	-6,810,899.49
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	17,963.62	401,616.67
减:二、费用	3,765,172.26	6,316,193.26
1.管理人报酬	1,791,343.98	2,977,575.74
2.托管费	298,557.29	496,262.57
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	1,288,413.19	2,450,318.48
5.利息支出	–	–
其中:卖出回购金融资产支出	–	–
6.其他费用	386,857.80	392,036.47
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	49,064,909.32	16,722,469.61
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	49,064,909.32	16,722,469.61

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	143,057,426.92	-13,932,291.10	129,125,135.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	49,064,909.32	49,064,909.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-43,409,402.49	1,835,410.69	-41,573,991.80
其中:1.基金申购款	30,122,715.43	2,286,407.41	32,409,122.84
2.基金赎回款	-73,532,117.92	-450,996.72	-73,983,114.64
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	99,648,024.43	36,968,028.91	136,616,053.34
项 目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	640,904,693.90	-65,547,407.59	575,357,286.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	16,722,469.61	16,722,469.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-497,847,266.98	34,892,646.88	-462,954,620.10
其中:1.基金申购款	17,062,085.16	-748,673.79	16,313,411.37
2.基金赎回款	-514,909,352.14	35,641,320.67	-479,268,031.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	143,057,426.92	-13,932,291.10	129,125,135.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

项 目	胡昕彦 主管会计工作负责人	黄宇虹 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2009]第40号《关于核准富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金募集的批复》核准,由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,109,462,046.52元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第39号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金基金合同》于2009年3月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,109,598,820.51份基金份额,其中认购资金利息折合136,773.99份基金份额。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%–95%,债券投资占基金资产的比例范围为0%–40%,权证投资占基金资产净值的比例范围为0%–3%,现金以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:85% × 沪深300指数 + 10% × 中债国债总指数(全价) + 5% × 同业存款利率。

本财务报表由本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于2015年3月25日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则–基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号––公允价值计量》、《企业会计准则第40号––合营安排》、《企业会计准则第41号––在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号––长期股权投资》、《企业会计准则第9号––职工薪酬》、《企业会计准则第30号––财务报表列报》、《企业会计准则第33号––合并财务报表》以及《企业会计准则第37号––金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号––金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金销售机构
国海证券股份有限公司("国海证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
邓普顿国际股份有限公司(Templeton International, Inc.)	基金管理人的股东
国海富兰克林资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国海证券	65,899,301.60	7.85%	176,274,451.31	11.88%

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国海证券	58,314.26	7.73%	13,005.75	3.59%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国海证券	155,985.56	11.70%	9,449.72	6.49%

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,791,343.98	2,977,575.74
其中:支付销售机构的客户维护费	187,916.83	256,882.95

注:支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	298,557.29	496,262.57

注:支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值 ×0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
期初持有的基金份额	14,866,686.49	14,866,686.49
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减:期间赎回/卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	14,866,686.49	14,866,686.49
期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.92%	10.39%

注:基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

1.本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

2.本报告期末和上年度末(2013年12月31日)除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	7,397,644.43	57,670.64	10,602,890.91	172,794.92

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
002675	东诚药业	2014/10/10	重大事项	24.18	–	–	115900	2,213,088.83	2,802,462.00
600487	亨通光电	2014/10/30	重大事项	18.95	2015/01/19	20.60	139000	2,514,720.00	2,634,050.00
300296	利亚德	2014/09/29	重大资产重组	22.74	2015/01/05	22.60	111400	2,491,670.98	2,533,236.00
002098	浔兴股份	2014/12/16	非公开发行	15.85	2015/01/19	14.27	40200	596,957.00	637,170.00

注:本基金截至2014年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为121,900,800.75元,属于第二层次的余额为8,606,918.00元,无属于第三层次的余额(2013年12月31日:第一层次114,157,765.10元,第二层次1,445,784.00元,无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	130,507,718.75	93.68
	其中:股票	130,507,718.75	93.68
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	8,054,879.18	5.78
7	其他各项资产	752,709.16	0.54
8	合计	139,315,307.09	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,956,726.06	2.90
B	采矿业	5,041,106.00	3.69
C	制造业	32,343,607.49	23.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	6,925,174.10	5.07
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,173,487.10	2.32
J	金融业	36,678,451.40	26.85
K	房地产业	37,191,225.24	27.22
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	5,197,941.36	3.80
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	130,507,718.75	95.53

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000024	招商地产	454,000	11,981,060.00	8.77
2	600048	保利地产	1,064,600	11,518,972.00	8.43
3	601628	中国人寿	193,856	6,620,182.40	4.85
4	600000	浦发银行	421,400	6,611,766.00	4.84
5	600287	江苏舜天	512,905	6,267,699.10	4.59
6	601328	交通银行	907,700	6,172,360.00	4.52
7	601318	中国平安	79,300	5,924,503.00	4.34
8	601818	光大银行	1,195,600	5,834,528.00	4.27
9	600970	中材国际	432,644	5,801,756.04	4.25
10	600016	民生银行	499,900	5,438,912.00	3.98

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600048	保利地产	12,508,775.00	9.69
2	600598	*ST大荒	11,221,294.47	8.69
3	000069	华侨城A	9,090,574.23	7.04
4	600637	百视通	8,168,842.59	6.33
5	600016	民生银行	7,559,567.12	5.85
6	000963	华东医药	7,030,546.26	5.44
7	000848	承德露露	7,015,928.09	5.43
8	600259	广晟有色	6,986,598.57	5.41
9	601628	中国人寿	6,975,614.80	5.40
10	600287	江苏舜天	6,887,053.50	5.33
11	000024	招商地产	6,629,708.75	5.13
12	002104	恒宝股份	6,518,222.40	5.05
13	000831	五矿稀土	6,444,672.98	4.99
14	601788	光大证券	6,438,878.00	4.99
15	600150	中国船舶	5,978,138.00	4.63
16	000002	万 科A	5,891,921.74	4.56
17	002368	太极股份	5,857,155.68	4.54
18	600801	华新水泥	5,626,065.00	4.36
19	600000	浦发银行	5,556,342.00	4.30
20	002635	安洁科技	5,512,921.68	4.27
21	300003	乐普医疗	5,450,216.85	4.22
22	002571	德力股份	5,389,765.06	4.17
23	601318	中国平安	5,285,210.00	4.09
24	600649	城投控股	5,171,438.24	4.00
25	601328	交通银行	4,967,840.00	3.85
26	600970	中材国际	4,895,020.68	3.79
27	300205	天喻信息	4,734,063.31	3.67
28	600585	海螺水泥	4,678,588.00	3.62
29	600999	招商证券	4,625,157.00	3.58
30	600703	三安光电	4,600,614.05	3.56
31	000568	泸州老窖	4,571,841.00	3.54
32	300142	沃森生物	4,554,843.69	3.53
33	600079	人福医药	4,446,118.02	3.44
34	002563	森马服饰	4,421,840.86	3.42
35	002398	建研集团	4,393,657.57	3.40
36	600655	豫园商城	4,329,025.66	3.35
37	601818	光大银行	4,296,695.00	3.33
38	600887	伊利股份	4,239,070.00	3.28
39	600657	信达地产	4,158,279.39	3.22
40	000712	锦龙股份	3,830,621.00	2.97
41	600199	金种子酒	3,709,314.00	2.87
42	300162	雷曼光电	3,500,371.19	2.71
43	600276	恒瑞医药	3,479,216.22	2.69
44	600064	南京高科	3,384,716.00	2.62
45	000732	泰禾集团	3,171,591.41	2.46
46	002273	水晶光电	3,162,727.95	2.45
47	300251	光线传媒	3,116,404.40	2.41
48	002496	辉丰股份	2,956,865.10	2.29
49	600372	中航电子	2,897,942.50	2.24
50	000651	格力电器	2,761,622.14	2.14
51	002353	杰瑞股份	2,703,398.96	2.09
52	002146	荣盛发展	2,602,730.00	2.02

注:买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601788	光大证券	13,109,977.89	10.15
2	600801	华新水泥	11,304,513.77	8.75
3	002422	科伦药业	9,067,305.94	7.02
4	002250	联化科技	8,987,147.63	6.96
5	600661	新南洋	8,861,356.97	6.86
6	000963	华东医药	8,602,115.28	6.66
7	600637	百视通	8,262,150.02	6.40
8	600598	*ST大荒	7,964,913.87	6.17
9	300003	乐普医疗	7,156,306.50	5.54
10	000848	承德露露	7,114,285.24	5.51
11	002051	中工国际	7,112,010.58	5.51
12	300142	沃森生物	6,987,444.43	5.41
13	600166	福田汽车	6,684,537.48	5.18
14	002571	德力股份	6,666,106.75	5.16
15	600999	招商证券	6,534,006.02	5.06
16	600559	老白干酒	6,422,764.41	4.97
17	002104	恒宝股份	6,337,025.10	4.91
18	000002	万 科A	6,220,671.54	4.82
19	600276	恒瑞医药	6,197,364.98	4.80
20	601628	中国人寿	6,152,672.87	4.76
21	600887	伊利股份	6,125,440.45	4.74
22	002353	杰瑞股份	5,962,079.39	4.62
23	600048	保利地产	5,662,620.00	4.39
24	002635	安洁科技	5,617,833.90	4.35
25	600150	中国船舶	5,509,956.00	4.27
26	000024	招商地产	5,420,837.34	4.20
27	600655	豫园商城	5,375,932.51	4.16
28	600649	城投控股	4,846,112.50	3.75
29	002311	海大集团	4,831,641.61	3.74
30	600422	昆药集团	4,736,236.72	3.67
31	300205	天喻信息	4,709,685.48	3.65
32	000852	江钻股份	4,690,938.48	3.63
33	600585	海螺水泥	4,684,838.38	3.63
34	600079	人福医药	4,630,660.00	3.59
35	000712	锦龙股份	4,573,958.00	3.54
36	002563	森马服饰	4,523,186.48	3.50
37	000069	华侨城A	4,426,677.00	3.43
38	002398	建研集团	4,244,956.52	3.29
39	002368	太极股份	4,133,729.56	3.20
40	601318	中国平安	4,128,707.31	3.20
41	002375	亚厦股份	4,060,662.40	3.14
42	600703	三安光电	4,007,646.99	3.10
43	000568	泸州老窖	3,940,646.18	3.05
44	000530	大冷股份	3,899,980.47	3.02
45	600383	金地集团	3,892,426.44	3.01
46	600372	中航电子	3,876,367.38	3.00
47	600016	民生银行	3,790,998.58	2.94
48	600064	南京高科	3,194,877.00	2.47
49	002273	水晶光电	3,188,150.10	2.47
50	300150	世纪瑞尔	3,139,781.27	2.43
51	002081	金 螳 螂	3,131,264.00	2.42
52	600108	亚盛集团	3,008,129.77	2.33
53	002568	百润股份	3,004,619.41	2.33
54	002023	海特高新	2,840,082.63	2.20
55	600060	海信电器	2,828,546.61	2.19
56	300228	富瑞特装	2,814,264.00	2.18
57	300329	海伦钢琴	2,803,705.33	2.17
58	002496	辉丰股份	2,793,632.19	2.16
59	601336	新华保险	2,791,018.00	2.16
60	300251	光线传媒	2,741,445.32	2.12
61	600518	康美药业	2,705,224.02	2.10
62	000970	中科三环	2,672,288.40	2.07
63	002230	科大讯飞	2,656,395.08	2.06
64	600594	益佰制药	2,650,950.00	2.05

注:卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	401,224,468.61
卖出股票的收入(成交)总额	438,130,041.63

注:买入股票成本总额及卖出股票收入总额均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同,本基金不投资贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同,本基金不投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同,本基金不投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1本基金本期投资的前十名证券中,无报告期内发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

8.12.2本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	51,069.88
2	应收证券清算款	16,672.76
3	应收股利	–
4	应收利息	1,723.82
5	应收申购款	683,242.70
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	752,709.16

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期间的可转债。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,226	19,067.74	24,892,190.78	24.98%	74,755,833.65	75.02%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

持有人户数(户)	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	107,277.65	0.107657%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年3月25日)基金份额总额	1,109,598,820.51
本报告期期初基金份额总额	143,057,426.92
本报告期基金总申购份额	30,122,715.43
减:本报告期基金总赎回份额	73,532,117.92
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	99,648,024.43

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(一)基金管理人重大人事变动

1、经国海富兰克林基金管理有限公司第三届董事会第二十七次会议审议通过,任命毕国强先生担任公司总经理,公司董事长吴显玲女士不再代为履行总经理职责。相关公告已于2014年11月6日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露;

2、经国海富兰克林基金管理有限公司第三届董事会第二十七次会议审议通过,任命胡昕彦女士担任公司副总经理,相关公告已于2014年6月5日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露;

3、经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第七次会议审议通过,张晓东先生不再担任公司副总经理,相关公告已于2014年12月23日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露。

(二)基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告,自2014年2月13日起,陈四清先生担任本行行长。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人应支付给会计师事务所的审计费用是人民币60000.00元,本基金自成立以来对其进行审计的均为普华永道中天会计师事务所,未曾改聘其他会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

(一)基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚。

(二)基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	1	171,054,998.04	20.38%	155,728.80	20.66%	
申万宏源	2	156,675,123.03	18.67%	139,606.55	18.52%	
民生证券	1	122,046,635.85	14.54%	111,111.24	14.74%	
光大证券	1	92,964,667.40	11.08%	84,634.85	11.23%	
招商证券	1	66,879,310.59	7.97%	59,181.57	7.85%	
国海证券	2	65,899,301.60	7.85%	58,314.26	7.73%	
中银国际	1	55,310,672.20	6.59%	48,944.52	6.49%	
华创证券	1	40,808,126.18	4.86%	36,111.25	4.79%	
东方证券	2	39,558,269.31	4.71%	35,005.06	4.64%	
国信证券	1	16,071,821.26	1.91%	14,631.88	1.94%	
兴业证券	1	12,023,319.78	1.43%	10,639.60	1.41%	
中信建投	2	–	–	–	–	
中金公司	2	–	–	–	–	
银河证券	1	–	–	–	–	
中信证券	1	–	–	–	–	
海通证券	2	–	–	–	–	
华泰证券	1	–	–	–	–	
齐鲁证券	1	–	–	–	–	
瑞银证券	1	–	–	–	–	
长江证券	1	–	–	–	–	
东海证券	1	–	–	–	–	

注:1. 专用交易单元的选择标准和程序

1)选择代理基金证券买卖的证券经营机构的标准

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构,并租用其交易单元作为基金的专用交易单元。选择的标准是:

?资历雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币;

?财务状况良好,经营行为规范,最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚;

?内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

?具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务;

?研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的特定要求,提供专题研究报告。

2)租用基金专用交易单元的程序

?基金管理人根据上述标准考察证券经营机构,考察结果经公司领导审批后,我司与被选中的证券经营机构签订《券商交易单元租用协议》和《研究服务协议》,并办理基金专用交易单元租用手续。

?之后,基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况,根据如下选择标准细化的评价体系,每季度对签约证券经营机构的服务进行一次综合评价:

A 提供的研究报告质量和数量;

B 由基金管理人提出课题,证券经营机构提供的研究论文质量;

C 证券经营机构协助我公司研究员调研情况;

D 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况;

E 其他可评价的量化标准。

经过评价,对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留,并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。若本公司认为签约机构的服务不能满足要求,或签约机构违规受到国家有关部门的处罚,本公司有权终止签署的协议,并撤销租用的交易单元;基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构,租用其交易单元。

?交易单元租用协议期限为一年,到期后若双方没有异议可自动延期一年。

2、报告期内证券公司基金专用交易单元的租用与变更情况 报告期内,根据上述基金专用交易单元选择标准和程序,本基金逐步租用证券公司的交易单元合计27个:其中国海证券、中金公司、申万宏源证券、中信建投证券、东方证券和海通证券各2个,光大证券、长江证券、中信证券、银河证券、中银国际证券、齐鲁证券、招商证券、华泰证券、国信证券、瑞银证券、广发证券、东海证券、兴业证券、华创证券和民生证券各1个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
广发证券	–	–	–	–	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
国海证券	–	–	–	–	–	–
中银国际	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	4,000,000.00	100.00%	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
齐鲁证券	–	–	–	–	–	–
瑞银证券	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
东海证券	–	–	–	–	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

国海富兰克林基金管理有限公司
二〇一五年三月三十日