

信息披露 Disclosure

富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金

2015半年度报告摘要

基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2015年08月28日

1.1 重要提示
基金管理人承诺,基金在本报告期内不存在虚假记载、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法律责任。本半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。基金托管人中国农业银行股份有限公司对本半年度报告进行了复核,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。会计师事务所对报告期内有关事项进行了审计,在所有重大方面符合公认审计标准,出具了标准无保留意见审计报告。基金管理人承诺,基金在本报告期内不存在虚假记载、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法律责任。如有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,致使投资者在证券交易中遭受损失的,基金管理人将依法承担赔偿责任。

2.1 基金基本情况
基金名称:富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金
基金代码:450002
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额:1,164,989,390.02份
报告期末基金份额持有人数量:不定期

2.2 基金产品说明
投资目标:本基金以沪深两市具有成长性的上市公司为投资对象,通过主动管理,力争实现基金资产的长期增值。投资策略:本基金采取自上而下的资产配置策略,在宏观、中观、微观三个层面进行分析和判断,确定资产配置方向。资产配置策略:本基金采取自上而下的资产配置策略,在宏观、中观、微观三个层面进行分析和判断,确定资产配置方向。风险控制:本基金通过分散投资、分散持仓、分散行业、分散地域等方式,降低基金资产集中度,分散非系统性风险。

2.3 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金管理人地址:上海浦东新区世纪大道1500号富兰克林大厦11楼
基金托管人地址:上海市浦东新区世纪大道1600号

2.4 信息披露方式
基金管理人网站:www.fundfund.com
基金托管人网站:www.abchina.com
基金年度报告备置地点:基金管理人及基金托管人住所

3.1 主要会计数据和财务指标
本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日
本报告期末:2015年6月30日
本报告期初:2015年1月1日

3.2 基金净值表现
本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比
本报告期基金份额净值增长率:1.28%
同期业绩比较基准收益率:0.27%

3.3 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.4 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.5 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.6 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.7 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.8 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.9 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.10 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.11 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.12 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.13 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.14 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.15 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.16 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.17 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.18 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.19 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.20 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.21 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.22 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.23 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.24 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.25 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.26 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.27 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.28 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.29 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.30 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.31 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.32 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.33 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.34 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.35 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.36 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.37 基金管理人及基金托管人
基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

6.1 资产负债表
报告期末:2015年6月30日
单位:人民币元

资产	期末	上年度末
	2015年6月30日	2014年12月31日
货币资金	106,387,789.44	306,192,166.46
结算备付金	5,089,177.63	894,000.00
应收利息	1,426,123.31	313,043.36
应收申购款	2,949,281,347.56	2,307,287,286.02
其他资产	2,949,281,347.56	2,307,287,286.02
资产总计	6,933,500.00	5,031,500.00
负债和所有者权益		
负债		
应付利息	3,230,099.24	16,789,246.27
应付赎回款	40,410.10	213,126.98
其他负债	1,532,628.66	115,642.00
所有者权益	2,259,030.47	2,630,774.92
负债和所有者权益总计	6,933,500.00	5,031,500.00

6.2 利润表
报告期末:2015年6月30日
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
一、营业收入	1,168,026,064.97	-139,022,126.23
1.利息收入	1,179,608.79	1,901,162.91
2.公允价值变动收益	622,241.70	1,159,342.07
3.其他业务收入	11,627.13	476,503.16
4.其他业务收入	11,627.13	476,503.16
二、营业支出	14,303,636.52	2,200,068.70
1.销售费用	236,774,680.49	392,963,002.06
2.管理费用	-979,709,626.32	-1,726,515,389.81
3.其他费用	-116,272,063.21	-116,272,063.21
4.其他费用	-116,272,063.21	-116,272,063.21
三、利润总额	1,153,720,428.45	-137,026,191.11
四、净利润	1,153,720,428.45	-137,026,191.11

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
报告期末:2015年6月30日
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
一、所有者权益(基金净值)	2,259,030.47	2,630,774.92
1.基金份额持有人	2,259,030.47	2,630,774.92
二、所有者权益(基金净值)	2,259,030.47	2,630,774.92
1.基金份额持有人	2,259,030.47	2,630,774.92

6.4 现金流量表
报告期末:2015年6月30日
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
一、经营活动产生的现金流量	1,906,944,585.06	2,597,842,281.94
1.收到其他与经营活动有关的现金	1,906,944,585.06	2,597,842,281.94
二、投资活动产生的现金流量	-742,076,156.83	-1,333,923,026.06
1.收回投资收到的现金	236,774,680.49	392,963,002.06
2.取得投资收益收到的现金	1,179,608.79	1,901,162.91
3.处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	622,241.70	1,159,342.07
4.处置子公司及其他营业单位收到的现金净额	11,627.13	476,503.16
5.支付其他与投资活动有关的现金	-1,179,608.79	-1,901,162.91
三、筹资活动产生的现金流量	236,774,680.49	392,963,002.06
1.吸收投资收到的现金	236,774,680.49	392,963,002.06
2.发行债券收到的现金	-	-
3.其他筹资活动收到的现金	-	-
4.支付其他与筹资活动有关的现金	-	-
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	-	-
五、现金及现金等价物净增加额	1,401,643,108.72	1,656,882,257.94
六、期初现金及现金等价物余额	1,061,937,476.34	1,061,937,476.34
七、期末现金及现金等价物余额	2,463,580,585.06	2,718,819,734.28

6.5 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.6 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.7 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.8 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.9 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.10 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.11 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.12 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.13 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.14 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.15 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.16 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.17 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.18 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.19 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.20 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.21 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.22 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.23 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.24 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.25 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.26 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.27 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.28 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.29 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.30 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.31 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.32 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.33 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.34 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.35 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.36 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.37 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.38 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.39 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.40 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.41 关联方关系及其交易的披露
关联方名称:富兰克林国海基金管理有限公司
关联方名称:中国农业银行股份有限公司

6.2 该类服务协议的服务范围还包括向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

6.4.8.2 关联方报酬
6.4.8.2.1 基金管理人
6.4.8.2.2 基金托管人

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的报酬	19,670,869.60	22,311,304.76
其中:支付给基金管理人的报酬	3,227,360.21	3,702,801.68
支付给基金托管人的报酬	16,443,509.39	18,608,503.08

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
6.4.8.3.1 报告期内基金管理人未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.4.1 报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.2 报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的报酬	3,311,811.63	3,719,550.88
其中:支付给基金管理人的报酬	3,311,811.63	3,719,550.88

6.4.8.5 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.5.1 报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.5.2 报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的报酬	3,311,811.63	3,719,550.88
其中:支付给基金管理人的报酬	3,311,811.63	3,719,550.88

6.4.8.6 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.6.1 报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.6.2 报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的报酬	3,311,811.63	3,719,550.88
其中:支付给基金管理人的报酬	3,311,811.63	3,719,550.88

6.4.8.7 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.7.1 报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.7.2 报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的报酬	3,311,811.63	3,719,550.88
其中:支付给基金管理人的报酬	3,311,811.63	3,719,550.88

6.4.8.8 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.8.1 报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.8.2 报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的报酬	3,311,811.63	3,719,550.88
其中:支付给基金管理人的报酬	3,311,811.63	3,719,550.88

6.4.8.9 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.9.1 报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.9.2 报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的报酬	3,311,811.63	3,719,550.88
其中:支付给基金管理人的报酬	3,311,811.63	3,719,550.88

6.4.8.10 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.10.1 报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.10.2 报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的报酬	3,311,811.63</	