（上接第D138版）

单位：人民币元

项目	本期 2008年 10 月 24 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日
卖出债券成交金额	839,111,921.33
卖出债券成本总额	-823,331,236.19
应收利息总额	-12,597,084.63
债券投资收益	3,183,600.51

7.4.7.14 衍生工具收益

报告期内本基金衍生工具收益为零。

7.4.7.15 股利收益

报告期内本基金股利收入为零。

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2008年 10 月 24 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	14,131,659.65
——股票投资	-
——债券投资	14,131,659.65
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	14,131,659.65

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2008年 10 月 24 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日
基金赎回费收入（a）	186,642.92
基金转换费收入（b）	241.74
募集期间认购资金产生的利息收入（c）	52,268.03
债券分销手续费返还	15,000.00
合计	254,152.69

注：（a）本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。

（b）本基金的转换费由申购费补差和转出基金的赎回费组成，其中转出赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

（c）由于本基金注册登记机构于募集期间利息折份额计算方式同募集专户结息方式存在差异，由此产生的募集期间认购资金利息收入划归基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2008年 10 月 24 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,961.27
银行间市场交易费用	10,910.00
合计	12,871.27

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2008年 10 月 24 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日
审计费用	72,000.00
信息披露费	85,000.00
银行汇划费用	5,257.07
其他	900.00
合计	163,157.07

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2009 年 3 月 25 日宣告 2009 年度第 1 次分红，向截至 2009 年 3 月 26 日止在本基金注册登记人国海富兰克林基金管理有限公司登记在册的 A、C 类基金份额持有人，分别按每 10 份基金份额派发红利 0.100 元。

7.4.9 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、基金代销机构
国海证券有限责任公司（"国海证券"）	基金管理人的股东、基金代销机构
邓普顿国际股份有限公司（Templeton International, Inc.）	基金管理人的股东

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

报告期内本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海证券	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银行	基金托管人、基金代销机构

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年 10 月 24 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国海证券	155,235,489.94	100.00%

注：债券交易不计佣金。

7.4.10.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年 10 月 24 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例
国海证券	3,115,800,000.000.00	100.00%

注：回购交易不计佣金。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内没有应支付给关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2008年 10 月 24 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	833,748.26
其中：当期已支付	508,526.46
期末未支付	325,221.80

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 0.6%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 X 0.6%／当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2008年 10 月 24 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	277,916.10
其中：当期已支付	169,508.85
期末未支付	108,407.25

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 0.20%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 X 0.20%／当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2008年 10 月 24 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
中国银行	0.00	12,678.03	12,678.03
合计	0.00	12,678.03	12,678.03

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.3%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国海富兰克林基金管理有限公司，再由国海富兰克林基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日 C 类基金份额对应的资产净值 X 0.3%／当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2008年 10 月 24 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	283,363,438.07	78,418,191.78	-	-	269,600,000.00	31,530.43

注：相关关联方为本基金托管人中国银行。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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：份

项目	本期 2008年 10 月 24 日（基金合同生效日）至 _2008 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	0
期间认购总份额	0
期间申购/买入总份额	0
期间因拆分增加的份额	0
期间赎回/卖出总份额	0
期末持有的基金份额	0
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0

注：报告期内本基金基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2008年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
无	-	-

注：报告期内除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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 2008年 10 月 24 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	9,988,819.30	204,339.54

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	利润分配合计	备注
无	-	-	0	0	0	0	
合计	-	-	0	0	0	0	-

注：报告期内本基金未进行利润分配。

7.4.12 期末（2008 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

报告期末本基金未持有暂时停牌股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

报告期末本基金没有正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	719,004,670.19	91.43%
	其中：债券	719,004,670.19	91.43%
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	20,225,164.17	2.57%
6	其他资产	47,176,046.58	6.00%
7	合计	786,405,880.94	100.00%

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

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

本基金报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

报告期内本基金未进行股票投资。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	35,950,045.50	4.61%
2	央行票据	147,654,000.00	18.96%
3	金融债券	422,006,000.00	54.18%
	其中：政策性金融债	422,006,000.00	54.18%
4	企业债券	82,872,624.69	10.64%
5	企业短期融资券	30,522,000.00	3.92%
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	719,004,670.19	92.31%

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0801114	08 央行票据 114	1,200,000	118,164,000.00	15.17%
2	080217	08国开 17	700,000	73,150,000.00	9.39%
3	080420	08农发 20	700,000	71,946,000.00	9.24%
4	080219	08国开 19	600,000	61,878,000.00	7.94%
5	080221	08国开 21	600,000	60,822,000.00	7.81%

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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 报告期内本基金无股票投资。

8.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,435,556.30
5	应收申购款	42,740,490.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,176,046.58

8.9.4 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的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末未持有股票。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

报告期内本基金未主动投资股权分置改革中发行的权证。

§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

份额级别	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
富兰克林国海强债（A 类）基金	2,799	198,229.10	269,407,937.08	48.56%	285,435,304.66	51.44%
富兰克林国海强债（C 类）基金	386	516,785.85	0	0	199,479,336.72	100%
合计	3,167	238,182.06	269,407,937.08	35.72%	484,914,641.38	64.28%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	富兰克林国海强债（A 类）基金	985.17	0.0002%
	富兰克林国海强债（C 类）基金	0	0
	合计	985.17	0.0001%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富兰克林国海强债（A 类）基金	富兰克林国海强债（C 类）基金
基金合同生效日（2008 年 10 月 24 日）基金份额总额	1,074,835,078.73	-
报告期期初基金份额总额	1,074,835,078.73	
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额（C 类份额自推出之日起算）	126,200,033.54	293,186,536.71
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额（C 类份额自推出之日起算）	646,191,870.53	93,707,199.99
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期期末基金份额总额（C 类份额自推出之日起算）	554,843,241.74	199,479,336.72

§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

经国海富兰克林基金管理有限公司第二届董事会第九次会议决议，同意胡德忠先生辞去公司副总经理职务。（2008 年 11 月 29 日公告）

本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 72,000.00 元，本基金自成立以来对其进行审计的均是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

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：元

券商名称	交易单元数量	债券交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国海证券	2	155,235,489.94	100.00%	0.00	0.00%	-

券商名称	交易单元数量	回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国海证券	2	3,115,800,000.00	100.00%	0.00	0.00%	-

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：

① 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

② 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；

③ 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；

④ 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；

⑤ 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

① 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。

② 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。

3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 2 个，国海证券、中金公司、广发证券、中银万国证券、国泰君安证券、海通证券、国金证券、中信金通证券和东海证券各 1 个。

国海富兰克林基金管理有限公司

二〇〇九年三月三十一日

（上接D140版）

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2008年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007年 01 月 01 日至 2007 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	20,829,846.32	24,386,837.14
其中：当期已支付	19,459,289.85	21,718,627.61
期末未支付	1,370,556.47	2,668,209.53

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 1.38%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×1.38%／当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2008年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007年 01 月 01 日至 2007 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	3,773,522.97	4,417,905.22
其中：当期已支付	3,525,233.73	3,934,533.94
期末未支付	248,289.24	483,371.28

注：支付基金托管人中国工商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 X 0.25%／当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本报告期间本基金未与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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：份

项目	本期 2008年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007年 01 月 01 日至 2007 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	0	0
期间认购总份额	0	0
期间申购/买入总份额	0	0
期间因拆分增加的份额	0	0
期间赎回/卖出总份额	0	0
期末持有的基金份额	0	0
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0	0

注：本报告期内和上年度可比期间本基金基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2008年 12 月 31 日		上年度末 2007年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
无	0	0	0	0

注：本报告期末和上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

7.4.10.5 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 2008年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2007年 01 月 01 日至 2007 年 12 月 3 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	45,051,525.17	587,609.34	30,912,743.21	1,029,500.81

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币万元

本期 2008年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
国海证券	088045	08联想债	新债分销	150,000	1,500
上年度可比期间 2007年 01 月 01 日至 2007 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
无	-	-	-	-	-

注：上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	利润分配合计	备注
1	2008-12-24	2008-12-25	1.00	79,003,469.04	74,443,637.74	153,447,106.78	
合计	-	-	1.00	79,003,469.04	74,443,637.74	153,447,106.78	

7.4.12 期末（2008 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末本基金未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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（股）	期末成本总额	期末估值总额
000792	盐湖钾肥	2008年6月26日	资产重组	56.78	2008年12月26日	78.23	200,000	18,086,263.44	11,356,000.00

注：青海盐湖钾肥股份有限公司股票自 2008 年 12 月 26 日复牌至 2008 年 12 月 31 日证券交易所闭市时连续跌停且成交量极低，故作为流通受限证券列示且于 2008 年 12 月 31 日采用指数收益法估值。该股票于 2009 年 1 月 8 日打开跌停板，当日的收盘价为每股 37.99 元。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

报告期末本基金没有正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§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	527,754,033.84	48.48
	其中：股票	527,754,033.84	48.48
2	固定收益投资	504,854,345.95	46.38
	其中：债券	504,854,345.95	46.38
	资产支持证券	0.00	0.00
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	47,447,794.99	4.36
6	其他资产	8,513,433.55	0.78
7	合计	1,088,569,608.33	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采掘业	41,482,613.54	3.83
C	制造业	310,384,270.13	28.66
C0	食品、饮料	52,245,137.94	4.82
C1	纺织、服装、皮毛	31,122,963.95	2.87
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	25,319,734.65	2.34
C4	石油、化学、塑胶、塑料	107,299,559.87	9.91
C5	电子	0.00	0.00
C6	金属、非金属	11,479,497.03	1.06
C7	机械、设备、仪表	65,269,734.77	6.03
C8	医药、生物制品	17,647,641.92	1.63
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	10,840,000.00	1.00
F	交通运输、仓储业	25,424,929.50	2.35
G	信息技术业	11,385,665.85	1.05
H	批发和零售贸易	0.00	0.00
I	金融、保险业	74,785,000.00	6.90
J	房地产业	38,920,000.00	3.59
K	社会服务业	14,531,554.82	1.34
L	传播与文化产业	0.00	0.00
M	综合类	0.00	0.00
	合计	527,754,033.84	48.72

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	600030	中信证券	1,500,000	26,955,000.00	2.49
2	000002	万 科 A	4,000,000	25,800,000.00	2.38
3	600320	振华港机	3,000,000	24,510,000.00	2.26
4	600423	柳化股份	2,899,683	22,733,514.72	2.10
5	000895	双汇发展	629,009	21,688,230.32	2.00
6	600177	雅戈尔	2,899,995	20,908,963.95	1.93
7	600176	中国玻纤	1,494,129	20,633,921.49	1.90
8	600016	民生银行	5,000,000	20,350,000.00	1.88
9	600963	岳阳纸业	4,044,035	20,179,734.65	1.86
10	000651	格力电器	1,000,000	19,440,000.00	1.79

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（www.ftsfund.com）的年度报告正文。

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	600299	蓝星新材	97,313,315.57	4.23
2	000651	格力电器	80,848,521.00	3.51
3	002008	大族激光	80,169,077.33	3.48
4	600016	民生银行	74,013,180.90	3.22
5	600096	云天化	64,423,215.90	2.80
6	600583	海油工程	62,768,845.71	2.73
7	000983	西山煤电	62,340,372.87	2.71
8	600320	振华港机	56,202,040.02	2.44
9	601390	中国中铁	55,611,052.61	2.42
10	600456	宝钛股份	54,775,374.48	2.38
11	600631	百联股份	53,137,868.00	2.31
12	000963	华东医药	51,530,718.83	2.24
13	600030	中信证券	50,482,809.03	2.19
14	000002	万 科 A	49,861,616.68	2.17
15	600026	中海发展	45,843,642.25	1.99
16	600963	岳阳纸业	44,396,156.54	1.93
17	601111	中国国航	43,912,574.46	1.91
18	600596	新安股份	43,491,749.75	1.89
19	000792	盐湖钾肥	43,423,971.94	1.89
20	600196	复星医药	42,719,309.27	1.86

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	002048	宁波华翔	104,351,580.42	4.54
2	601006	大秦铁路	90,209,017.75	3.92
3	600030	中信证券	88,491,971.13	3.85
4	600036	招商银行	83,675,352.62	3.64
5	000568	泸州老窖	79,247,169.26	3.44
6	600596	新安股份	69,120,473.58	3.00
7	002024	苏宁电器	69,509,878.03	3.02
8	600000	浦发银行	61,269,203.24	2.66
9	600348	国阳新能	61,008,717.22	2.65
10	000002	万 科 A	58,877,629.57	2.56
11	002008	大族激光	57,765,736.90	2.51
12	600271	航天信息	56,876,893.24	2.47
13	600196	复星医药	50,259,441.76	2.18
14	601088	中国神华	48,818,921.03	2.12
15	600583	海油工程	47,508,519.32	2.06
16	000898	鞍钢股份	47,427,658.53	2.06%
17	600660	福耀玻璃	45,588,971.53	1.98
18	000963	华东医药	45,316,707.89	1.97
19	600631	百联股份	45,164,154.92	1.96
20	600299	蓝星新材	44,098,994.28	1.92

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,275,283,815.95
卖出股票收入（成交）总额	2,380,903,780.07

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	13,448,500.00	1.24
2	央行票据	104,730,000.00	9.67
3	金融债券	113,379,000.00	10.47
	其中：政策性金融债	113,379,000.00	10.47
4	企业债券	166,079,181.95	15.33
5	企业短期融资券	60,870,000.00	5.62
6	可转债	46,347,664.00	4.28
7	其他	0.00	0.00
	合计	504,854,345.95	46.61

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	070310	07进出 10	600,000	62,310,000.00	5.75
2	080147	08央行票据 47	500,000	53,450,000.00	4.93
3	070129	07央行票据 29	500,000	51,280,000.00	4.73
4	110598	大荒转债	329,920	38,914,064.00	3.59
5	058006	05华润债	300,000	32,487,000.00	3.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	598,780.49
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	7,811,901.84
5	应收申购款	102,751.22
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8