

富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金

2012 第一季度报告

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

报告送出日期:二〇一二年四月二十一日

S1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告所载事项不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2012年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。投资人应当在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告所含财务数据未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

S2 基金产品概况

基金简称 国富潜力组合基金

基金主代码 450003

交易代码 450003

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2007年3月22日

报告期末基金份额总额 4,451,640,763.68份

注:本基金资产总值长期增长,投资未来收益具有成长性和资产价值偏低的上市公司股票,为投资者赚取长期稳定的资本增值。

投资目标 资产配置策略:

本基金采用“自下而上”的组合构建方法,从上市公司的具体发展情况和未来的盈利能力,到行业的发展趋势,再到宏观经济形势,确定大类资产的配置。

在运用“自下而上”策略之后,根据市场环境的变化,市场出现的各种投资机会和未来的发展趋势判断,确定本基金资产配置最终的选择标准。

股票选择策略:

本基金将运用定性和定量方法,通过对上市公司的财务分析和增长潜力分析,挑选出其中股价下跌风险最低且上涨空间最大的股票构建本基金的股票组合。

债券投资策略:

本基金的债券投资为股票投资由市场条件所限,不易实施定投策略,使部分资金保值增值的防守性操作。

业绩比较基准 85%×MSCI中国A股指数+10%×中债国债指数(全价)+5%×同业存款利率

风险收益特征 本基金是一只主动型投资的股票型基金,属于基金类型中具有中等风险级别的基金品种,本基金的风险与预期收益都高于混合型基金。

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

S3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -223,905,565.47

2.本期利润 -115,133,167.25

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0257

4.期末基金资产净值 3,914,765,679.85

5.期末基金份额净值 0.8794

注:1.本期的利润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。

3.2.1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比较

阶段 净值增长 率(%) 基业比较基准收益率(%)

净值增长率标准差(②) 基准收益率标准差(④)

①-③ ②-④

过去三个月 -2.81% 1.41% 3.87% 1.33% -6.68% 0.08%

3.2.2本基金合同生效以来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

国富蓝筹潜力组合型股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2007年3月22日至2012年3月31日

注:图表显示了本基金成立以来的净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比情况。

3.3.1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比较

阶段 净值增长 率(%) 基业比较基准收益率(%)

净值增长率标准差(②) 基准收益率标准差(④)

①-③ ②-④

过去三个月 -2.81% 1.41% 3.87% 1.33% -6.68% 0.08%

3.4.1报告期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

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600276 恒瑞医药 11,720,548 307,429,974.04 7.85

2 982408 浙江永强 9,824,208 158,955,685.44 4.06

3 000895 双汇发展 1,940,024 133,667,653.60 3.41

4 600016 民生银行 20,622,161 129,300,949.47 3.30

5 600858 银泰百货 6,429,724 129,237,452.40 3.30

6 300070 碧水源 3,164,409 119,931,101.10 3.06

7 002202 科华生物 11,313,365 110,606,413.45 2.93

8 600837 海通证券 12,641,508 113,899,987.08 2.91

9 000983 西山煤电 7,598,205 111,541,649.40 2.85

10 600875 东方电气 4,864,833 105,323,634.45 2.69

3.4.2报告期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

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1101022 11国债22 1,500,000 145,215,000.00 3.71

2 1101094 11央票94 193,585,000.00 4.94

3 122126 11庞大02 341,600 34,160,000.00 0.87

4 110017 中海转债 64,730 6,063,259.10 0.15

5 113002 行转债 41,160 4,456,393.20 0.11

6 其他 - - -

7 拨款 - - -

8 其他 - - -

9 合计 - - 238,264,652.30 6.09

3.5.3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债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1101022 11国债22 1,500,000 145,215,000.00 3.71

2 1101094 11央票94 193,585,000.00 4.94

3 122126 11庞大02 341,600 34,160,000.00 0.87

4 110017 中海转债 64,730 6,063,259.10 0.15

5 113002 行转债 41,160 4,456,393.20 0.11

6 其他 - - -

7 拨款 - - -

8 其他 - - -

9 合计 - - 238,264,652.30 6.09

3.6.3报告期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组合

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600276 恒瑞医药 11,720,548 307,429,974.04 7.85

2 982408 浙江永强 9,824,208 158,955,685.44 4.06

3 000895 双汇发展 1,940,024 133,667,653.60 3.41

4 600016 民生银行 20,622,161 129,300,949.47 3.30

5 600858 银泰百货 6,429,724 129,237,452.40 3.30

6 300070 碧水源 3,164,409 119,931,101.10 3.06

7 002202 科华生物 11,313,365 110,606,413.45 2.93

8 600837 海通证券 12,641,508 113,899,987.08 2.91

9 000983 西山煤电 7,598,205 111,541,649.40 2.85

10 600875 东方电气 4,864,833 105,323,634.45 2.69

3.7.3报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1101022 11国债22 1,500,000 145,215,000.00 3.71

2 1101094 11央票94 193,585,000.00 4.94

3 122126 11庞大02 341,600 34,160,000.00 0.87

4 110017 中海转债 64,730 6,063,259.10 0.15

5 113002 行转债 41,160 4,456,393.20 0.11

6 其他 - - -

7 拨款 - - -

8 其他 - - -

9 合计 - - 238,264,652.30 6.09

3.8.3报告期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组合

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600276 恒瑞医药 11,720,548 307,429,974.04 7.85

2 982408 浙江永强 9,824,208 158,955,685.44 4.06

3 000895 双汇发展 1,940,024 133,667,653.60 3.41

4 600016 民生银行 20,622,161 129,300,949.47 3.30

5 600858 银泰百货 6,429,724 129,237,452.40 3.30

6 300070 碧水源 3,164,409 119,931,101.10 3.06

7 002202 科华生物 11,313,365 110,606,413.45 2.93

8 600837 海通证券 12,641,508 113,899,987.08 2.91

9 000983 西山煤电 7,598,205 111,541,649.40 2.85

10 600875 东方电气 4,864,833 105,323,634.45 2.69

3.9.3报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1101088 友好集团 10,704,142 105,649,881.54 7.35