

富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金

[2012]第四季度报告

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:二〇一三年一月十九日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人的董事会及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责任。
基金合同于2010年11月23日生效，于2011年1月17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，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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金合同中约定的基金名称、基金简称、基金代码等。

本报告期自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国富中小盘股票

基金主代码 450009

交易代码 450009

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2010年11月23日

报告期末基金份额总额 1,772,666,412.62份

投资目标 本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票，力求在有效控制风险的前提下，获得基金资产的长期稳健增值。

大类资产配置：本基金通过分析宏观经济、政策、估值水平和市场特征等因素，在上述资产配置范围内适度配置股票、债券、货币市场工具和其他法律法规允许的金融工具的投资比例。

投资策略 本基金在资产配置的基础上，主要采用精选个股和行业优化的投资策略，挖掘并投资于具有良好治理结构、成长性好、估值合理且具有较大发展潜力的中小市值上市公司。本基金的股票投资策略主要包括市值筛选策略、精选个股策略和行业优化策略。

债券投资策略：本基金的债券投资为股票投资不易实施预定投资策略时的防守性措施。债券投资策略主要包括利率预期策略、久期管理策略、类属资产配置策略、券种选择策略等。

业绩比较基准 中证700指数收益率×90%+银行同业存款利率×10%

风险收益特征 本基金是股票型基金，属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种，其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -23,907,719.66

2.本期利润 231,448,094.72

3.加权平均基金份额本期利润 0.1322

4.期末基金份额净值 1,862,516,079.07

5.期末可供分配基金份额净值 1,051

注:1.本基金业绩基准不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入人民币基金业绩基准时则扣除所列费用;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为每季末基金资产净值与每季初基金资产净值的比值。

3.2.2 本基金合同生效以来基金业绩基准(扣除费用后的余额)与同期比较基准收益率变动的比较

最近一年国富中小盘股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与同期比较基准收益率的历史走势对比图

2010年11月23日至2012年12月31日

注:1.本基金的基金合同生效日为2010年11月23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。
2.截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同的约定。基金合同中关于基金投资比例的约定如下:
股票投资的比例范围为基金资产的80%-95%;债券、权证、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(本基金持有的比例范围为5%-20%,现金或者到期日在一年以内政府债券占基金资产净值的比例不超过5%)。
因证券市场波动、基金规模变动、股权转让支付对价等原因导致基金投资比例之和超过法律规定比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,以达到标准。法律另有规定的除外。
3.本基金在报告期遵守法律、法规和基金合同的比例限制进行证券投资。
4.1 管理人报告

4.1 基金管理或基金经理小组简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

赵晓东 基金经理及基金经理助理 2010-11-23 - 9年

本基金基金经理及基金经理助理的任职期间,高晓东先生,香港大学毕业MBA,辽宁大学经济学学士,现任淄博矿业集团项目经理,同时担任证券分析师。

徐荔荔 基金经理及基金经理助理 2010-5-22 - 15年

本基金基金经理及基金经理助理的任职期间,徐荔荔女士,上海交通大学高新技术产业公司高级投资经理,国家外汇管理局国际收支司高级经济师,同时担任基金经理。

注: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,在基金业工作的年限即为基金从业年限。

4.2 对报告期内基金运作合规性的说明

4.3 对基金业绩表现的评价

4.4 对基金定期报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.5 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.6 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.7 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.8 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.9 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.10 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.11 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.12 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.13 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.14 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.15 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.16 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.17 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.18 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.19 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.20 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.21 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.22 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.23 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.24 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.25 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.26 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.27 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.28 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.29 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.30 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.31 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.32 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.33 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.34 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.35 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.36 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.37 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.38 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.39 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.40 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.41 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.42 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.43 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.44 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.45 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.46 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.47 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.48 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.49 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.50 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.51 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.52 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.53 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.54 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.55 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.56 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.57 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.58 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.59 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.60 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.61 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.62 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.63 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.64 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.65 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.66 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.67 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.68 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.69 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.70 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.71 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.72 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.73 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.74 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.75 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.76 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.77 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.78 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.79 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.80 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.81 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.82 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.83 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.84 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.85 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.86 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.87 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.88 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.89 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.90 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.91 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.92 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.93 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.94 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.95 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明

4.96 对基金年度报告中“涉及基金的会计政策、会计估计和差错更正”的说明