

【2012】 第四季度报告

季度落后于业绩基准。四季度加仓的金融板块对单季度的业绩贡献比较突出。

4.2 报告期内基金的投资表现

2012年四季度，基金净值上涨6.20%，业绩基准上涨8.44%，基金净值落后业绩基准2.15个百分点。业绩主要贡献是金融和地产，负贡献主要来自电子信息设备和医药。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,953,779,249.62 | 66.63 |
| | 其中：股票 | 1,953,779,249.62 | 66.63 |
| 2 | 固定收益投资 | 15,780,179.94 | 0.54 |
| | 其中：债券 | 15,780,179.94 | 0.54 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 610,601,690.91 | 20.82 |
| | 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 | 329,615,623.12 | 11.24 |
| 6 | 其他各项资产 | 22,313,729.51 | 0.76 |
| 7 | 合计 | 2,932,090,473.10 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------|---------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |

| | | | |
|---|---------|------------------|-------|
| I | 金融、保险业 | 275,456,593.49 | 9.63 |
| J | 房地产业 | 65,176,357.09 | 2.28 |
| K | 社会服务业 | 38,432,642.00 | 1.34 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 1,953,779,249.62 | 68.34 |

| 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 | 000063 | 中兴通讯 | 22,931,741 | 223,584,474.75 | 7.82 |
| 2 | 002422 | 科兴药业 | 3,546,506 | 198,675,266.12 | 6.95 |
| 3 | 600004 | 白云山 | 9,852,624 | 197,858,888.00 | 6.85 |
| 4 | 000963 | 华东医药 | 4,057,131 | 137,942,540.00 | 4.82 |
| 5 | 600019 | 宝钢股份 | 24,482,045 | 119,717,200.05 | 4.18 |
| 6 | 600016 | 民生银行 | 10,747,389 | 84,474,477.54 | 2.95 |
| 7 | 002250 | 联化科技 | 4,313,817 | 84,119,431.50 | 2.94 |
| 8 | 002081 | 金耀华 | 1,611,338 | 70,931,098.76 | 2.48 |
| 9 | 600004 | 白云山 | 6,232,339 | 62,232,339.00 | 2.30 |
| 10 | 600000 | 浦发银行 | 5,853,840 | 62,090,879.80 | 2.38 |

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 15,105,000.00 | 0.53 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 675,179.94 | 0.02 |
| 8 | 其他 | - | - |

| | | | | | |
|--------------------|---|-------|---------|---------------|--------------|
| 9 | 合计 | | | 15,780,179.94 | 0.55 |
| 5 | 5. 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 | | | | |
| 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 | 112120 | 12联发债 | 150,000 | 15,105,000.00 | 0.53 |
| 2 | 125887 | 中邮转债 | 6,602 | 675,179.94 | 0.02 |
| 3 | | | | | |
| 4 | | | | | |
| 5 | | | | | |
| 6 | 6. 报告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。 | | | | | |
| 7 | 7. 报告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。 | | | | | |

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 393,832.65 |
| 2 | 应收证券清算款 | 490,551.45 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 773,873.87 |
| 5 | 应收申购款 | 20,655,471.54 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | | | | |
|---------------|--|------|------------|------------------|--------------|
| 8 | 其他 | | | | |
| 9 | 合计 | | | 22,313,729.51 | |
| 5.8.4 | 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 | | | | |
| | 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 1 | 125887 | 中期转债 | 675,179.94 | 0.02 | |
| 5.8.5 | 报告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情况 | | | | |
| | § 6 开放式基金份额变动 | | | | |
| | 单位:份 | | | | |
| 本报告期初基金份额总额 | | | | 1,281,413,299.91 | |
| 本报告期基金总申购份额 | | | | 6,235,238,908.56 | |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | | | | 1,357,659,599.77 | |
| 本报告期基金份额净变动 | | | | | |

| | |
|--|------------------|
| 报告期末基金份额总额 | 2,528,992,608.70 |
| <p>§ 7 备查文件目录</p> <p>1. 中国证监会批准富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金设立的文件；</p> <p>2. 富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金基金合同；</p> <p>3. 富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金托管协议；</p> <p>4. 富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金托管协议；</p> <p>5. 中国证监会要求的所有其他文件。</p> <p>7. 存放在基金管理人和本基金托管人所共登载于基金管理人网站：www.fundsun.com。</p> <p>8. 备查文件</p> <p>1. 投资者在基金开放日可至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件；</p> <p>2. 登陆基金管理人网站www.fundsun.com查询。</p> <p style="text-align: right;">富国富兰克林基金管理有限公司 二〇一三年一月十九日</p> | |

| | | | | | | | | |
|----|-------------------------------|--------|--------------------|-------------|-----|---------|----------------|------|
| 4 | China Construction Bank Corp. | 中國建設銀行 | BIGCON 825218 | 香港聯合交易所有限公司 | 香港 | 493,000 | 2,486,439,090 | 3.93 |
| 5 | Dairy Farm International Ltd. | — | BIGG00H1 006068 | 香港聯合交易所有限公司 | 新加坡 | 34,200 | 243,338,105.54 | 3.70 |
| 6 | China Shenhua Energy Co. Ltd. | 中國神華 | BIGG00H1 006068 | 香港聯合交易所有限公司 | 香港 | 68,000 | 1,871,928,266 | 2.96 |
| 7 | Baidu Inc./China | 百度 | BIGG00N1 006068 | 納斯達克交易所 | 美國 | 2,960 | 1,863,905,503 | 2.95 |
| 8 | CNOOC Ltd. | 中國海洋石油 | BIGG00H1 006068 | 香港聯合交易所有限公司 | 香港 | 135,000 | 1,836,818,49 | 2.90 |
| 9 | SATS Ltd. | — | BIGG00H1 006068 | 香港聯合交易所有限公司 | 新加坡 | 114,000 | 1,695,309,372 | 2.68 |
| 10 | PT PCL | — | BIGG00H1 006068 | 泰國證券交易所有限公司 | 泰國 | 24,700 | 1,684,431.83 | 2.66 |

注：本基金以中国证监会以下证券代码为影响BRI-CD。

2. 上述表列基金因各地、地区以及国际股票存在托收证券上交易地点统计。

3. 上述表列投资估值由以下分类的基金提供。

本基金本报告期末未持有债券。

本基金本报告期末未持有股票。

本基金本报告期末未持有期货。

7. 报告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投资。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 (人民币) | 占基金资产净 值比例(%) |
|----|-------------------------------|------|-------|---------------------------|---------------|------------------|
| 1 | iShares S&P India Nifty 50 | ETF | 开放式基金 | BlackRock Fund Advisor | 3,272,350.84 | 5.17 |

| | | | | | | |
|----|-------------|-----|--------|---------|--------------|-----|
| 2 | Philippines | ETF | 开放基金类型 | Advisor | 1,889,327,02 | 299 |
| 3 | — | — | — | — | — | — |
| 4 | — | — | — | — | — | — |
| 5 | — | — | — | — | — | — |
| 6 | — | — | — | — | — | — |
| 7 | — | — | — | — | — | — |
| 8 | — | — | — | — | — | — |
| 9 | — | — | — | — | — | — |
| 10 | — | — | — | — | — | — |

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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公开谴责、证券交易所公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

| 名称 | 金额(人民币元) |
|----|----------|
|----|----------|

| | | |
|---|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | |
| 2 | 应收证券清算款 | |
| 3 | 应收股利 | 566,270.90 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 867.60 |
| 6 | 预缴应收款 | 98.81 |
| 7 | 其他应收款 | 152,490.88 |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 919,728.28 |

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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情况。

§ 6 开放式基金份额变动

| 本报告期期初基金份额总额 | 单位:份 |
|---------------|------|
| 96,366,558.17 | |

| | |
|--------------|---------------|
| 本期所有者权益变动额 | 61,215.97 |
| 本报告期基金总份额(份) | 36,774,397.84 |
| 本报告期末基金份额总额 | 60,004,374.30 |

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- (一) 经中国证监会核准的富兰克林国际海亚洲机会 债日本股票型证券投资基金设立的文件；
- (二) 富兰克林国际海亚洲机会 债日本股票型证券投资基金基金合同；
- (三) 富兰克林国际海亚洲机会 债日本股票型证券投资基金招募说明书；
- (四) 富兰克林国际海亚洲机会 债日本股票型证券投资基金托管协议；
- (五) 中国证监会要求的其他文件。

7.2 存放地点

基金管理人基金保管人的住所并登载于基金管理人网站：www.fundfund.com。

7.3 查阅方式

- (一) 投资者可在基金开放日至本基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件。
- (二) 登陆基金管理人网站www.fundfund.com 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司
二〇一三年一月十九日