

基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一三年三月二十七日

## 6.1 重要提示

基金管理人、董事会、监事会在报告书中承诺披露误导性陈述或重大遗漏，并对内 容的真实、准确性、完整性承担责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字 确认，并由董事长签发。

基金管理人和中国农业银行股份有限公司根据基金合同约定，于2013年3月25日复核了本报告中的 财务报表、净值表现、费用分配情况、财务会计报告、投资组合报告等，确认本报告不存在虚假记 载、误导性陈述或重大遗漏。

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未来表现。投资人选择基金前应仔细阅读本基金的 招募说明书及其摘要。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

## 国富策略回报混合型证券投资基金

基金简称 4500010

交易代码 450001

基金运作方式 约定开放型

基金合同生效日 2011年8月21日

基金管理人 国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 544,924,067.90份

基金合同存续期 不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标 本基金管理人通过研究和证券市场分析，采取灵活的资产配置策略，

合理配置股票、债券和现金资产比例，以及各大类资产中不同类资产的配比，有效控制风险前提下，追求基金资产的长期稳健增值。

投资策略 本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断来选择基金资产的配置比例，

并结合经济周期、宏观经济分析、行业分析、市场价格分析、

资金供求分析、政策分析、财政政策研究及收益率曲线分析等，

在保证流动性的前提下，实施灵活的债券投资组合管理。

业绩比较基准 60%×沪深300指数收益率+40%×中债国债指数收益率(含债券型基金)

风险收益特征 本基金是混合型基金，混合型基金的风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高风险、中等收益的基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

## 基金管理人

国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

项目 基金名称 基金托管人

名称 国海富兰克林基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司

姓名 陈丽丽

联系电话 021-3855 5555

电子邮箱 services@ffsfund.com

客户服务电话 400-700-4518, 9510-5680 和 021-38709555

传真 021-6888 3050

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 www.ffsfund.com

基金年度报告备置地点 基金管理人和基金托管人的住所

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

## 金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2012年 2011年8月21日(基金合同生效日) 至2011年12月31日

本期已实现收益 -58,957,532.94

本期利润 -19,390,110.63

期初平均基金份额净值 0.9309

本期基金份额净值增长率 -2.79%

3.1.2 期末数据和指标 2012年末 2011年末

期末可供分配基金份额利润 -0.1626

期末基金资产净值 456,307,879.62

期末基金份额净值 0.837

3.1.3 本期末数据和指标 2012年末 2011年末

本期末可供分配基金份额利润 -0.1386

本期末基金资产净值 664,320,904.76

本期末基金份额净值 0.861

注:1. 本基金合同生效日为2011年8月21日。

2. 上述财务指标采用的计算公式,详见本基金发布的证券投资基金管理人信息披露编报规则第1号《重要 财务指标的计算方法及披露》。

本基金已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费 用后的金额,即基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的金 额。

3. 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数 (即期末余额,是当期盈余)。

4. 上述基金业绩指标包括持有人交易基金的各项费用,例如,开放式基金的申购赎回费等,计算费 用后实际收益应予扣除。

3.2 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

## 3.2.1 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

份额净值增 长率(%)

份额净值增 长率标准差(%)

业绩比较基 础

业绩比较基 础标准差(%)

①-③

②-④

过去三个月 2.20% 1.01% 5.81% -0.76% -3.61% 0.24%

过去六个月 -1.53% 1.01% 1.08% 0.74% -2.61% 0.27%

过去一年 -2.79% 1.04% 4.67% 0.76% -7.46% 0.28%

自基金合同生 16.30% 1.01% -7.51% 0.79% -8.79% 0.22%

注:本基金的业绩比较基准为 $60\% \times$ 沪深300指数收益率+ $40\% \times$ 中债国债指数收益率(含债券型基金)。

注:沪深300指数是股票投资部分的业绩,中债国债指数是债券和现金资产部分的业绩。

本基金每个月对业绩比较基准进行再平衡处理,1日的收益率(Benchmark)按下列公式计算:

Benchmark =  $60\% \times$ 沪深300指数 $\times$ 沪深300指基 $\times$ (1- $\alpha$ )- $40\% \times$ 中债国债指基 $\times$ (1- $\beta$ )

其中: $\alpha$ =1,  $\beta$ =1,  $\alpha$ 、 $\beta$ 为交易日的沪深300指基和中债国债指基的收益率。

注:1. 本基金的业绩指标未考虑申购、赎回费用。

2. 上述财务指标采用的计算公式,详见本基金发布的证券投资基金管理人信息披露编报规则第1号《重要 财务指标的计算方法及披露》。

本基金已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费 用后的金额,即基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的金 额。

3. 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数 (即期末余额,是当期盈余)。

4. 上述基金业绩指标包括持有人交易基金的各项费用,例如,开放式基金的申购赎回费等,计算费 用后实际收益应予扣除。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

## 3.2.2.1 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

份额净值增 长率(%)

份额净值增 长率标准差(%)

业绩比较基 础

业绩比较基 础标准差(%)

①-③

②-④

过去三个月 2.20% 1.01% 5.81% -0.76% -3.61% 0.24%

过去六个月 -1.53% 1.01% 1.08% 0.74% -2.61% 0.27%

过去一年 -2.79% 1.04% 4.67% 0.76% -7.46% 0.28%

自基金合同生 16.30% 1.01% -7.51% 0.79% -8.79% 0.22%

注:本基金的业绩比较基准为 $60\% \times$ 沪深300指数收益率+ $40\% \times$ 中债国债指数收益率(含债券型基金)。

注:沪深300指数是股票投资部分的业绩,中债国债指数是债券和现金资产部分的业绩。

本基金每个月对业绩比较基准进行再平衡处理,1日的收益率(Benchmark)按下列公式计算:

Benchmark =  $60\% \times$ 沪深300指数 $\times$ 沪深300指基 $\times$ (1- $\alpha$ )- $40\% \times$ 中债国债指基 $\times$ (1- $\beta$ )

其中: $\alpha$ =1,  $\beta$ =1,  $\alpha$ 、 $\beta$ 为交易日的沪深300指基和中债国债指基的收益率。

注:1. 本基金成立于2011年8月21日,故2011年的业绩为成立日至当年的业绩而非全年的业绩。

2. 本基金成立以来的业绩计算方法为:股票30%、债券和现金资产20%、现金。

3. 本基金的业绩比较基准 =  $60\% \times$ 沪深300指数+ $40\% \times$ 中债国债指数(含债券型基金)。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度 每10份基金份额 现金形式发放总额 再投资形式发放总额 年度利润分配合计 备注

2012年 0.0000 0.00 0.00 0.00 -

2011年 0.0000 0.00 0.00 0.00 -

合计 0.0000 0.00 0.00 0.00 -

注:本基金于2011年8月21日基金合同生效。

## §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人和基金经理的情况

基金管理人及基金经理的经

验、从业经历、

研究能力、

投资经验、

管理能力、

过往管理基金情况。

基金管理人和基金经理的经

验、从业经历、

研究能力、