

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:二〇一三年三月二十七日

S 1 重要提示

基金管理人的董事、监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、准确性和完整性负个别及连带责任。
基金托管人中行银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2008年10月25日核对了本报告中的财务指标、净值表现、利潤分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息，确认本报告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资本基金前请仔细阅读本基金的招募说明书及其更新报告。

本年度报告摘要节选自年度报告全文，投资者欲了解详细情况，应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

S 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 国富强化收益债券

基金代码 450005

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2008年10月24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 中国银行股份有限公司

基金类别 混合型

基金份额总额 119,343,246.09份

基金合同延续期 不定期

下属分级基金的基金简称 国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

下属分级基金的交易代码 450005 450006

报告期末下属分级基金的份额总额 115,252,087.67份 4,091,158.42份

2.2 基金产品说明

投资目标 通过主动的资产管理，在严格控制风险、保证资产充分流动性的基础上，力求为投资者创造持续稳定的回报。

固定收益类品种投资策略：本基金将采取积极主动的投资策略，以中长期利率趋势分析为主，结合经济周期、宏观经济运行中的价格特征、资金供求状况、财政政策和货币政策以及宏观基本面分析，实施积极的债券投资组合管理。

动态收益增强策略：

本基金根据证券市场的动态变化，采取多种灵活的策略，获取超额收益。

股票投资策略：

本基金主要采用“自下而上”的投资策略，将定量的股票筛选和定性的公司深度研究相结合，精选出具有稳定的风险分红能力和持续的盈利增长预期，且估值合理的优质上市公司股票。

可转债投资策略：

可转换债券(含可分离可转债)兼具权益类证券与固定收益类证券的特点，具有以下两个风险：分股股票化收益—上涨收益的特点。可转债的选择结合其特性和投资特征，在对公司基本面和债券条款深入研究的基础上进行价值分析，投资于具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券，获取稳健的回报。

业绩比较基准

中债总指数(按价数)

风险收益特征 本基金额度化收益债券基金，属于证券投资基金中的低风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于混合型基金，高于货币市场基金。

下属两级基金的风险 收益特征 - -

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 国海富兰克林基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

姓名 颜丽丽

联系电话 021-3855 5555

电子邮箱 service@fund.com

客户服务电话 400-700-4518, 9510-5680

传真 021-3879555

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 www.fitsfund.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

3.1 主要数据和财务指标

基金净值表现 单位:人民币元

3.1.1 期间数据 2012年 2011年 2010年

本期已实现收益 6,274,059.06 316,380.12 5,993.28

本期利润 10,464,470.91 852,395.02 -739,861.85

加权平均基金份额 0.0856 0.0722 -0.0060

利润 8.59% 8.33% -0.56%

本期末基金净值增长率 8.59% 8.33% -0.56%

3.1.2 期末数 2012年末 2011年末 2010年末

本期末基金净值 10,464,470.91 852,395.02 419,873.92

本期末可供分配利润 0.0929 0.0837 0.0064

本期末基金利润 0.0929 0.0837 0.0064

本期末基金资产净值 125,962,534.88 4,433,452.82 150,726,488.07

本期末基金资产 200,190,448.13 28,018,911.23

3.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比值

国富强化收益债券A

份额净值增长 率(%) 0.17% -0.29% 0.04%

业绩比较基准收益率(%) 0.13%

3.2.1 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的基金投资基金额度化收益披露规则-第1号 重要财务指标的计算及披露规则。

3.2.2 本报告期内实现收益金额以收入扣除非关联交易后的余额为前提的余额，扣除当年费用后余额，不足当年费用时，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.3 本报告期内可供分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数 本期未余额，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.4 上述基金指标指不包括持有交易性基金的各项费用，例如：开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于同期业绩比较基准收益率。

3.2.5 基金的申购赎回费用

3.2.6 基金的申购赎回费用率及其与同期业绩比较基准收益率的比值

国富强化收益债券C

份额净值增长 率(%) 0.17% -0.29% 0.04%

业绩比较基准收益率(%) 0.13%

3.2.7 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的基金投资基金额度化收益披露规则-第1号 重要财务指标的计算及披露规则。

3.2.8 本报告期内实现收益金额以收入扣除非关联交易后的余额为前提的余额，扣除当年费用后余额，不足当年费用时，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.9 本报告期内可供分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数 本期未余额，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.10 上述基金指标指不包括持有交易性基金的各项费用，例如：开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于同期业绩比较基准收益率。

3.2.11 基金的申购赎回费用

3.2.12 基金的申购赎回费用率及其与同期业绩比较基准收益率的比值

国富强化收益债券A

份额净值增长 率(%) 0.17% -0.29% 0.04%

业绩比较基准收益率(%) 0.13%

3.2.13 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的基金投资基金额度化收益披露规则-第1号 重要财务指标的计算及披露规则。

3.2.14 本报告期内实现收益金额以收入扣除非关联交易后的余额为前提的余额，扣除当年费用后余额，不足当年费用时，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.15 本报告期内可供分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数 本期未余额，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.16 上述基金指标指不包括持有交易性基金的各项费用，例如：开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于同期业绩比较基准收益率。

3.2.17 基金的申购赎回费用

3.2.18 基金的申购赎回费用率及其与同期业绩比较基准收益率的比值

国富强化收益债券C

份额净值增长 率(%) 0.17% -0.29% 0.04%

业绩比较基准收益率(%) 0.13%

3.2.19 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的基金投资基金额度化收益披露规则-第1号 重要财务指标的计算及披露规则。

3.2.20 本报告期内实现收益金额以收入扣除非关联交易后的余额为前提的余额，扣除当年费用后余额，不足当年费用时，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.21 本报告期内可供分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数 本期未余额，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.22 上述基金指标指不包括持有交易性基金的各项费用，例如：开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于同期业绩比较基准收益率。

3.2.23 基金的申购赎回费用

3.2.24 基金的申购赎回费用率及其与同期业绩比较基准收益率的比值

国富强化收益债券A

份额净值增长 率(%) 0.17% -0.29% 0.04%

业绩比较基准收益率(%) 0.13%

3.2.25 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的基金投资基金额度化收益披露规则-第1号 重要财务指标的计算及披露规则。

3.2.26 本报告期内实现收益金额以收入扣除非关联交易后的余额为前提的余额，扣除当年费用后余额，不足当年费用时，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.27 本报告期内可供分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数 本期未余额，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.28 上述基金指标指不包括持有交易性基金的各项费用，例如：开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于同期业绩比较基准收益率。

3.2.29 基金的申购赎回费用

3.2.30 基金的申购赎回费用率及其与同期业绩比较基准收益率的比值

国富强化收益债券C

份额净值增长 率(%) 0.17% -0.29% 0.04%

业绩比较基准收益率(%) 0.13%

3.2.31 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的基金投资基金额度化收益披露规则-第1号 重要财务指标的计算及披露规则。

3.2.32 本报告期内实现收益金额以收入扣除非关联交易后的余额为前提的余额，扣除当年费用后余额，不足当年费用时，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.33 本报告期内可供分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数 本期未余额，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.34 上述基金指标指不包括持有交易性基金的各项费用，例如：开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于同期业绩比较基准收益率。

3.2.35 基金的申购赎回费用

3.2.36 基金的申购赎回费用率及其与同期业绩比较基准收益率的比值

国富强化收益债券A

份额净值增长 率(%) 0.17% -0.29% 0.04%

业绩比较基准收益率(%) 0.13%

3.2.37 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的基金投资基金额度化收益披露规则-第1号 重要财务指标的计算及披露规则。

3.2.38 本报告期内实现收益金额以收入扣除非关联交易后的余额为前提的余额，扣除当年费用后余额，不足当年费用时，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.39 本报告期内可供分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数 本期未余额，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.40 上述基金指标指不包括持有交易性基金的各项费用，例如：开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于同期业绩比较基准收益率。

3.2.41 基金的申购赎回费用

3.2.42 基金的申购赎回费用率及其与同期业绩比较基准收益率的比值

国富强化收益债券C

份额净值增长 率(%) 0.17% -0.29% 0.04%

业绩比较基准收益率(%) 0.13%

3.2.43 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的基金投资基金额度化收益披露规则-第1号 重要财务指标的计算及披露规则。

3.2.44 本报告期内实现收益金额以收入扣除非关联交易后的余额为前提的余额，扣除当年费用后余额，不足当年费用时，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.45 本报告期内可供分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数 本期未余额，不足当年费用时，不作当年费用处理。

3.2.46 上述基金指标指不包括持有交易性基金的各项费用，例如：开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于同期业绩比较基准收益率。

3.2.47 基金的申购赎回费用