

富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金

2014 半年度报告摘要

投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。
5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵守投资、净值计算、利润分配等信息披露情况的说明
本托管人认为, 国海富兰克林基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回的价格计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要环节的执行严格按照基金合同的有关规定执行。
5.3托管人对本半年度报告中财务信息等相关信息的真实、准确和完整发表意见
本托管人认为, 国海富兰克林基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资报告等相关信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

6.1资产负债表
6.2半年度财务会计报告(未经审计)
会计主体:富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日
单位:人民币元

资产	本期 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货币资金	35,007,316.53	90,063,162.59
结算备付金	62,562.73	356,096.80
存出保证金	316,179.67	615,371.20
交易性金融资产	58,519,553.09	979,493,144.78
其中:股票投资	51,898,162.59	969,617,207.25
基金投资	-	-
债券投资	2,711,389.50	9,875,837.55
资产支持证券	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	22,073,274.72
应收利息	97,067.58	109,984.47
应收申购款	27,153,323.23	44,746.58
其他应收款	-	-
其他资产	-	-
资产总计	590,273,804.01	1,093,295,781.14
负债和所有者权益	本期 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付利息	-	-
应付赎回款	1,206,899.41	12,055,701.78
应付管理人报酬	70,367.85	1,585,699.43
应付托管费	11,731.29	264,283.28
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	11,681.34	837,973.03
应付税费	\$4,000.00	\$4,000.00
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	341,998.65	341,570.08
负债合计	2,538,890.61	15,139,027.60
所有者权益:	-	-
实收基金	510,913,889.96	905,448,086.36
未分配利润	86,861,028.44	172,769,697.18
所有者权益合计	597,724,918.40	1,078,257,783.54
负债和所有者权益总计	590,273,804.01	1,093,295,781.14

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.150元,基金份额总额510,913,889.96份。
6.2利润表
会计主体:富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日
单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	-26,012,570.59	35,681,157.60
1.利息收入	340,179.32	4,332,702.60
其中:存款利息收入	174,391.55	1,687,235.28
债券利息收入	165,787.77	384,522.00
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	2,060,942.35
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)	44,808,044.57	174,555,450.55
其中:股票投资收益	39,515,600.89	152,600,872.94
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-64,006.75	-
资产支持证券投资损益	-	-
其他投资收益	-	-
衍生工具损益	-	-
股利收益	5,356,440.43	21,954,582.86
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-71,602,677.57	-144,202,945.47
4.其他收入(损失以“-”号填列)	441,863.09	1,195,944.72
二、费用	7,768,971.15	30,048,197.98
1.管理人报酬	5,573,735.48	22,955,205.08
2.托管费	895,622.25	3,825,865.57
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,295,048.84	2,844,569.67
5.其他支出	-	-
6.其他费用	20,810.58	221,555.76
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-33,781,541.74	4,835,959.62
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-33,781,541.74	4,835,959.62

6.3所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日
单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	905,448,086.36	172,769,697.18
二、本期增减变动金额	-33,781,541.74	-33,781,541.74
其中:本期基金净损益产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)	-394,534,176.40	-62,106,102.00
1.基金申购款	50,093,131.02	3,361,662.82
2.基金赎回款	-444,627,327.42	-70,467,764.78
三、期末所有者权益(基金净值)	510,913,889.96	76,821,023.44

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	905,448,086.36	172,769,697.18
二、本期增减变动金额	-33,781,541.74	-33,781,541.74
其中:本期基金净损益产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)	-394,534,176.40	-62,106,102.00
1.基金申购款	50,093,131.02	3,361,662.82
2.基金赎回款	-444,627,327.42	-70,467,764.78
三、期末所有者权益(基金净值)	510,913,889.96	76,821,023.44

6.4所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日
单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	905,448,086.36	172,769,697.18
二、本期增减变动金额	-33,781,541.74	-33,781,541.74
其中:本期基金净损益产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)	-394,534,176.40	-62,106,102.00
1.基金申购款	50,093,131.02	3,361,662.82
2.基金赎回款	-444,627,327.42	-70,467,764.78
三、期末所有者权益(基金净值)	510,913,889.96	76,821,023.44

6.5所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日
单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	905,448,086.36	172,769,697.18
二、本期增减变动金额	-33,781,541.74	-33,781,541.74
其中:本期基金净损益产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)	-394,534,176.40	-62,106,102.00
1.基金申购款	50,093,131.02	3,361,662.82
2.基金赎回款	-444,627,327.42	-70,467,764.78
三、期末所有者权益(基金净值)	510,913,889.96	76,821,023.44

6.6所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日
单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	905,448,086.36	172,769,697.18
二、本期增减变动金额	-33,781,541.74	-33,781,541.74
其中:本期基金净损益产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)	-394,534,176.40	-62,106,102.00
1.基金申购款	50,093,131.02	3,361,662.82
2.基金赎回款	-444,627,327.42	-70,467,764.78
三、期末所有者权益(基金净值)	510,913,889.96	76,821,023.44

6.7所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日
单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	905,448,086.36	172,769,697.18
二、本期增减变动金额	-33,781,541.74	-33,781,541.74
其中:本期基金净损益产生的基金份额变动(净值减少以“-”号填列)	-394,534,176.40	-62,106,102.00
1.基金申购款	50,093,131.02	3,361,662.82
2.基金赎回款	-444,627,327.42	-70,467,764.78
三、期末所有者权益(基金净值)	510,913,889.96	76,821,023.44

6.8所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日
单位:人民币元

6.9所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日
单位:人民币元

买入股票的成本(成交金额)	172,414,527.75
卖出股票的收入(成交金额)	558,433,731.76

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
7.5期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	2,711,389.50	0.46
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,711,389.50	0.46

7.6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
金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112121	12国债发	26,979	2,711,389.50	0.46

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112121	12国债发	26,979	2,711,389.50	0.46

7.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
金额单位:人民币元

7.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
金额单位:人民币元

本基金本报告期末未持有权证。

7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有股指期货合约。
7.10.2本基金股指期货的投资政策
本基金在股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过基本面分析和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
基金管理人将充分考量股指期货的投机性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特有风险,降低投资组合的系统性风险,利用股指期货进行套期保值,以达到降低投资组合的整体风险的目的。
7.11股指期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
7.12股指期货投资情况说明
7.12.1股指期货投资情况说明
7.12.2股指期货投资情况说明
7.12.3股指期货投资情况说明
7.12.4股指期货投资情况说明
7.12.5股指期货投资情况说明
7.12.6股指期货投资情况说明
7.12.7股指期货投资情况说明
7.12.8股指期货投资情况说明
7.12.9股指期货投资情况说明
7.12.10股指期货投资情况说明
7.12.11股指期货投资情况说明
7.12.12股指期货投资情况说明
7.12.13股指期货投资情况说明
7.12.14股指期货投资情况说明
7.12.15股指期货投资情况说明
7.12.16股指期货投资情况说明
7.12.17股指期货投资情况说明
7.12.18股指期货投资情况说明
7.12.19股指期货投资情况说明
7.12.20股指期货投资情况说明
7.12.21股指期货投资情况说明
7.12.22股指期货投资情况说明
7.12.23股指期货投资情况说明
7.12.24股指期货投资情况说明
7.12.25股指期货投资情况说明
7.12.26股指期货投资情况说明
7.12.27股指期货投资情况说明
7.12.28股指期货投资情况说明
7.12.29股指期货投资情况说明
7.12.30股指期货投资情况说明
7.12.31股指期货投资情况说明
7.12.32股指期货投资情况说明
7.12.33股指期货投资情况说明
7.12.34股指期货投资情况说明
7.12.35股指期货投资情况说明
7.12.36股指期货投资情况说明
7.12.37股指期货投资情况说明
7.12.38股指期货投资情况说明
7.12.39股指期货投资情况说明
7.12.40股指期货投资情况说明
7.12.41股指期货投资情况说明
7.12.42股指期货投资情况说明
7.12.43股指期货投资情况说明
7.12.44股指期货投资情况说明
7.12.45股指期货投资情况说明
7.12.46股指期货投资情况说明
7.12.47股指期货投资情况说明
7.12.48股指期货投资情况说明
7.12.49股指期货投资情况说明
7.12.50股指期货投资情况说明
7.12.51股指期货投资情况说明
7.12.52股指期货投资情况说明
7.12.53股指期货投资情况说明
7.12.54股指期货投资情况说明
7.12.55股指期货投资情况说明
7.12.56股指期货投资情况说明
7.12.57股指期货投资情况说明
7.12.58股指期货投资情况说明
7.12.59股指期货投资情况说明
7.12.60股指期货投资情况说明
7.12.61股指期货投资情况说明
7.12.62股指期货投资情况说明
7.12.63股指期货投资情况说明
7.12.64股指期货投资情况说明
7.12.65股指期货投资情况说明
7.12.66股指期货投资情况说明
7.12.67股指期货投资情况说明
7.12.68股指期货投资情况说明
7.12.69股指期货投资情况说明
7.12.70股指期货投资情况说明
7.12.71股指期货投资情况说明
7.12.72股指期货投资情况说明
7.12.73股指期货投资情况说明
7.12.74股指期货投资情况说明
7.12.75股指期货投资情况说明
7.12.76股指期货投资情况说明
7.12.77股指期货投资情况说明
7.12.78股指期货投资情况说明
7.12.79股指期货投资情况说明
7.12.80股指期货投资情况说明
7.12.81股指期货投资情况说明
7.12.82股指期货投资情况说明
7.12.83股指期货投资情况说明
7.12.84股指期货投资情况说明
7.12.85股指期货投资情况说明
7.12.86股指期货投资情况说明
7.12.87股指期货投资情况说明
7.12.88股指期货投资情况说明
7.12.89股指期货投资情况说明
7.12.90股指期货投资情况说明
7.12.91股指期货投资情况说明
7.12.92股指期货投资情况说明
7.12.93股指期货投资情况说明
7.12.94股指期货投资情况说明
7.12.95股指期货投资情况说明
7.12.96股指期货投资情况说明
7.12.97股指期货投资情况说明
7.12.98股指期货投资情况说明
7.12.99股指期货投资情况说明
7.12.100股指期货投资情况说明
7.12.101股指期货投资情况说明
7.12.102股指期货投资情况说明
7.12.103股指期货投资情况说明
7.12.104股指期货投资情况说明
7.12.105股指期货投资情况说明
7.12.106股指期货投资情况说明
7.12.107股指期货投资情况说明
7.12.108股指期货投资情况说明
7.12.109股指期货投资情况说明
7.12.110股指期货投资情况说明
7.12.111股指期货投资情况说明
7.12.112股指期货投资情况说明
7.12.113股指期货投资情况说明
7.12.114股指期货投资情况说明
7.12.115股指期货投资情况说明
7.12.116股指期货投资情况说明
7.12.117股指期货投资情况说明
7.12.118股指期货投资情况说明
7.12.119股指期货投资情况说明
7.12.120股指期货投资情况说明
7.12.121股指期货投资情况说明
7.12.122股指期货投资情况说明
7.12.123股指期货投资情况说明
7.12.124股指期货投资情况说明
7.12.125股指期货投资情况说明
7.12.126股指期货投资情况说明
7.12.127股指期货投资情况说明
7.12.128股指期货投资情况说明
7.12.129股指期货投资情况说明
7.12.130股指期货投资情况说明
7.12.131股指期货投资情况说明
7.12.132股指期货投资情况说明
7.12.133股指期货投资情况说明
7.12.134股指期货投资情况说明
7.12.135股指期货投资情况说明
7.12.136股指期货投资情况说明
7.12.137股指期货投资情况说明
7.12.138股指期货投资情况说明
7.12.139股指期货投资情况说明
7.12.140股指期货投资情况说明
7.12.141股指期货投资情况说明
7.12.142股指期货投资情况说明
7.12.143股指期货投资情况说明
7.12.144股指期货投资情况说明
7.12.145股指期货投资情况说明
7.12.146股指期货投资情况说明
7.12.147股指期货投资情况说明
7.12.148股指期货投资情况说明
7.12.149股指期货投资情况说明
7.12.150股指期货投资情况说明
7.12.151股指期货投资情况说明
7.12.152股指期货投资情况说明
7.12.153股指期货投资情况说明
7.12.154股指期货投资情况说明
7.12.155股指期货投资情况说明
7.12.156股指期货投资情况说明
7.12.157股指期货投资情况说明
7.12.158股指期货投资情况说明
7.12.159股指期货投资情况说明
7.12.160股指期货投资情况说明
7.12.161股指期货投资情况说明
7.12.162股指期货投资情况说明
7.12.163股指期货投资情况说明
7.12.164股指期货投资情况说明
7.12.165股指期货投资情况说明
7.12.166股指期货投资情况说明
7.12.167股指期货投资情况说明
7.12.168股指期货投资情况说明
7.12.169股指期货投资情况说明
7.12.170股指期货投资情况说明
7.12.171股指期货投资情况说明
7.12.172股指期货投资情况说明
7.12.173股指期货投资情况说明
7.12.174股指期货投资情况说明
7.12.175股指期货投资情况说明
7.12.176股指期货投资情况说明
7.12.177股指期货投资情况说明
7.12.178股指期货投资情况说明
7.12.179股指期货投资情况说明
7.12.180股指期货投资情况说明
7.12.181股指期货投资情况说明
7.12.182股指期货投资情况说明
7.12.183股指期货投资情况说明
7.12.184股指期货投资情况说明
7.12.185股指期货投资情况说明
7.12.186股指期货投资情况说明
7.12.187股指期货投资情况说明
7.12.188股指期货投资情况说明
7.12.189股指期货投资情况说明
7.12.190股指期货投资情况说明
7.12.191股指期货投资情况说明
7.12.192股指期货投资情况说明
7.12.193股指期货投资情况说明
7.12.194股指期货投资情况说明
7.12.195股指期货投资情况说明
7.12.196股指期货投资情况说明
7.12.197股指期货投资情况说明
7.12.198股指期货投资情况说明
7.12.199股指期货投资情况说明
7.12.200股指期货投资情况说明
7.12.201股指期货投资情况说明
7.12.202股指期货投资情况说明
7.12.203股指期货投资情况说明
7.12.204股指期货投资情况说明
7.12.205股指期货投资情况说明
7.12.206股指期货投资情况说明
7.12.207股指期货投资情况说明
7.12.208股指期货投资情况说明
7.12.209股指期货投资情况说明
7.12.210股指期货投资情况说明
7.12.211股指期货投资情况说明
7.12.212股指期货投资情况说明
7.12.213股指期货投资情况说明
7.12.214股指期货投资情况说明
7.12.215股指期货投资情况说明
7.12.216股指期货投资情况说明
7.12.217股指期货投资情况说明
7.12.218股指期货投资情况说明
7.12.219股指期货投资情况说明
7.12.220股指期货投资情况说明
7.12.221股指期货投资情况说明
7.12.222股指期货投资情况说明
7.12.223股指期货投资情况说明
7.12.224股指期货投资情况说明
7.12.225股指期货投资情况说明
7.12.226股指期货投资情况说明
7.12.227股指期货投资情况说明
7.12.228股指期货投资情况说明
7.12.229股指期货投资情况说明
7.12.230股指期货投资情况说明
7.12.231股指期货投资情况说明
7.12.232股指期货投资情况说明
7.12.233股指期货投资情况说明
7.12.234股指期货投资情况说明
7.12.235股指期货投资情况说明
7.12.236股指期货投资情况说明
7.12.237股指期货投资情况说明
7.12.238股指期货投资情况说明
7.12.239股指期货投资情况说明
7.12.240股指期货投资情况说明
7.12.241股指期货投资情况说明
7.12.242股指期货投资情况说明
7.12.243股指期货投资情况说明
7.12.244股指期货投资情况说明
7.12.245股指期货投资情况说明
7.12.246股指期货投资情况说明
7.12.247股指期货投资情况说明
7.12.248股指期货投资情况说明
7.12.249股指期货投资情况说明
7.12.250股指期货投资情况说明
7.12.251股指期货投资情况说明
7.12.252股指期货投资情况说明
7.12.253股指期货投资情况说明
7.12.254股指期货投资情况说明
7.12.255股指期货投资情况说明
7.12.256股指期货投资情况说明
7.12.257股指期货投资情况说明
7.12.258股指期货投资情况说明
7.12.259股指期货投资情况说明
7.12.260股指期货投资情况说明
7.12.261股指期货投资情况说明
7.12.262股指期货投资情况说明
7.12.263股指期货投资情况说明
7.12.264股指期货投资情况说明
7.12.265股指期货投资情况说明
7.12.266股指期货投资情况说明
7.12.267股指期货投资情况说明
7.12.268股指期货投资情况说明
7.12.269股指期货投资情况说明
7.12.270股指期货投资情况说明
7.12.271股指期货投资情况说明
7.12.272股指期货投资情况说明
7.12.273股指期货投资情况说明
7.12.274股指期货投资情况说明
7.12.275股指期货投资情况说明
7.12.276股指期货投资情况说明
7.12.277股指期货投资情况说明
7.12.278股指期货投资情况说明
7.12.279股指期货投资情况说明
7.12.280股指期货投资情况说明
7.12.281股指期货投资情况说明
7.12.282股指期货投资情况说明
7.12.283股指期货投资情况说明
7.12.284股指期货投资情况说明
7.12.285股指期货投资情况说明
7.12.286股指期货投资情况说明
7.12.287股指期货投资情况说明
7.12.288股指期货投资情况说明
7.12.289股指期货投资情况说明
7.12.290股指期货投资情况说明
7.12.291股指期货投资情况说明
7.12.292股指期货投资情况说明
7.12.293股指期货投资情况说明
7.12.294股指期货投资情况说明
7.12.295股指期货投资情况说明
7.12.296股指期货投资情况说明
7.12.297股指期货投资情况说明
7.12.298股指期货投资情况说明
7.12.299股指期货投资情况说明
7.12.300股指期货投资情况说明
7.12.301股指期货投资情况说明
7.12.302股指期货投资情况说明
7.12.303股指期货投资情况说明
7.12.304股指期货投资情况说明
7.12.305股指期货投资情况说明
7.12.306股指期货投资情况说明
7.12.307股指期货投资情况说明
7.12.308股指期货投资情况说明
7.12.309股指期货投资情况说明
7.12.310股指期货投资情况说明
7.12.311股指期货投资情况说明
7.12.312股指期货投资情况说明
7.12.313股指期货投资情况说明
7.12.314股指期货投资情况说明
7.12.315股指期货投资情况说明
7.12.316股指期货投资情况说明
7.12.317股指期货投资情况说明
7.12.318股指期货投资情况说明
7.12.319股指期货投资情况说明
7.12.320股指期货投资情况说明
7.12.321股指期货投资情况说明
7.12.322股指期货投资情况说明
7.12.323股指期货投资情况说明
7.12.324股指期货投资情况说明
7.12.325股指期货投资情况说明
7.12.326股指期货投资情况说明
7.12.327股指期货投资情况说明
7.12.328股指期货投资情况说明
7.12.329股指期货投资情况说明
7.12.330股指期货投资情况说明
7.12.331股指期货投资情况说明
7.12.332股指期货投资情况说明
7.12.333股指期货