

信息披露 disclosure

富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金

2014 半年度报告摘要

注: 1. 上述佣金含市场价格基金的管理人与对方协商确定, 以扣除中国证券投资基金业协会收取的证券交易佣金和经手费后的净额列示。 2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.8.2 关联方报酬
6.4.8.2.1 基金管理费

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间
当期发生的基金应支付的管理费	7,862,062.84	16,442,317.23	7,862,062.84
其中:支付销售机构的客户维护费	2,003,039.61	3,402,517.21	2,003,039.61

注: 支付基金管理人 国海富兰克林基金管理有限公司的中国银行托管费按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为: 日管理费=前一日基金资产净值X 1.50% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间
当期发生的基金应支付的托管费	1,301,343.83	2,734,586.31	1,301,343.83

注: 支付基金管理人 中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为: 日托管费=前一日基金资产净值X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间
新增持有基金份额总额	51,987,071.57	51,987,071.57	51,987,071.57
新增买入基金份额总额	0.00	0.00	0.00
新增卖出基金份额总额	0.00	0.00	0.00
新增买入基金份额总额/卖出基金份额总额	51,987,071.57	51,987,071.57	51,987,071.57
新增持有基金份额占基金总份额比例	4.62%	2.33%	4.62%

注: 基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同约定的费率执行。
6.4.8.4.2 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.3 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.4 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.5 与关联方保有的银行存款余额及当期产生的利息收入

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间
存款余额	56,814,318.20	305,100.23	219,596,732.52
利息收入	305,100.23	219,596,732.52	726,245.67

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管, 按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况

6.4.8.7 其他关联交易事项说明

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

证券代码	证券名称	成功认购日期	可流通日期	流通受限类型	认购价格	期末持仓数量(单位:股)	期末持仓金额	期末持仓市值	备注
002727	一心堂	2014-06-06	2014-07-25	新股上市	12.20	12.20	500	6,100.00	6,100.00

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
(a) 公允价值
不以公允价值计量的金融工具
不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差不多。

(b) 以公允价值计量的金融工具
(i) 金融工具公允价值计量的方法
根据在公允价值计量中对计量结果具有重大意义的最低层次的输入值, 公允价值层次可分为:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次: 直接或间接(包括报价)的类似资产或负债的报价。
第三层次: 无法观察到的输入值。

(ii) 各层级金融工具公允价值
于2014年6月30日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的金额为964,526,489.32元, 属于第二层级和第三层级的金额2013年12月31日: 第一层级909,546,568.79元, 第二层级69,616,927.36元, 无第三层级。

(iii) 公允价值计量的重大变动
对于证券交易, 上市的价格, 若出现重大事项停牌, 交易不活跃包括收盘停牌的情况(不活跃), 或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间, 交易不活跃期间及限售期间将相关股票公允价值列入第一层级; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票公允价值应列入第二层级或第三层级。

(iv) 第三层级公允价值金额和本期变动金额。
(v) 公允价值列外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7. 基金组合报告
7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	947,725,828.32	87.40
其中: 股票	947,725,828.32	87.40	
2	固定收益投资	16,800,670.00	1.55
其中: 债券	16,800,670.00	1.55	
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	50,000,000.00	4.61
其中: 买入返售金融资产-买入返售金融资产	-	-	-
6	银行存款和其他货币资金合计	51,283,688.61	5.35
7	其他各项资产	11,778,922.50	1.09
8	合计	1,084,329,109.43	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	766,099,041.09	70.94
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,370,460.64	0.59
F	批发和零售业	11,301,100.69	1.05
G	交通运输、仓储和邮政业	11,383,713.25	1.05
H	信息传输、软件和信息技术服务业	28,626,532.99	2.65
J	金融业	82,957,076.26	7.68
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,820,596.88	1.84
M	科学研究和技术服务业	39,789,079.29	3.68
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公事业	21,135,517.30	1.96
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	其他	-	-
合计	947,725,828.32	87.76	

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值的比例(%)
1	002034	洋河股份	1,536,071	77,955,603.25	7.22
2	000858	五粮液	3,958,384	70,977,411.12	6.57
3	002039	云南白药	9,637,657	66,788,963.01	6.18
4	000568	泸州老窖	4,018,627	65,825,110.26	6.11
5	002488	金发科技	304,776	39,789,079.29	3.68
6	601318	中国平安	999,883	39,335,397.22	3.64
7	600418	江淮汽车	275,345	39,043,403.10	3.62
8	300024	机器人	1,324,589	38,884,116.60	3.60
9	002250	联华药业	2,686,177	38,115,373.40	3.53
10	600699	海螺水泥	33,058,416	33,058,416.00	3.05

注: 投资者欲了解本基金期末基金投资的所有股票明细, 应阅读披露于国海富兰克林基金管理有限公司网站上的季度报告全文。

7.4 期末按行业分类的股票投资组合

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值的比例(%)
1	002488	金发科技	40,716,595.87	3.38
2	002385	大友股份	42,763,604.41	3.55
3	002250	联华药业	36,541,980.38	3.05
4	600276	诺和诺德	26,728,419.19	2.22
5	002039	云南白药	25,520,096.64	2.13
6	600418	江淮汽车	24,368,947.31	2.01
7	600699	海螺水泥	23,199,738.72	1.92
8	601888	中国国旅	23,093,647.72	1.91
9	600315	上海家化	22,364,777.00	1.86
10	300045	华邦制药	21,463,470.99	1.78
11	002349	爱康集团	20,475,987.99	1.76
12	002034	洋河股份	20,379,017.99	1.72
13	600352	浙江龙盛	20,354,888.03	1.70
14	002486	华邦制药	20,339,864.11	1.69
15	000528	广弘济世	19,445,281.27	1.67
16	002273	康美药业	19,154,250.66	1.59
17	600588	华泰软件	18,479,024.00	1.52
18	300229	富春环保	17,380,610.04	1.45
19	600032	华微电子	16,398,345.34	1.36
20	000019	中航集团	16,106,138.10	1.34

注: 买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

7.4.2 买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值的比例(%)
1	002034	洋河股份	45,387,588.65	3.77
2	600809	山西汾酒	42,763,604.41	3.55
3	002037	久联发展	41,947,561.85	3.48
4	002039	云南白药	37,080,758.48	3.08
5	600418	江淮汽车	36,895,863.69	2.99
6	600314	江苏银行	26,336,614.67	2.19
7	600787	中国铁建	26,280,722.85	2.18
8	300257	开山股份	25,828,348.03	2.14
9	600893	紫光股份	24,691,080.03	2.05
10	600000	浦发银行	23,511,205.66	1.95
11	000568	泸州老窖	22,626,345.57	1.88
12	000858	五粮液	22,371,617.21	1.85
13	600422	昆明制药	22,254,100.21	1.85
14	600287	南京医药	22,254,054.04	1.85
15	000528	广弘济世	20,264,199.02	1.76
16	002443	金通股份	20,363,427.95	1.69
17	601336	新华保险	20,056,851.11	1.66
18	600312	华微电子	19,870,752.26	1.63
19	600000	浦发银行	19,614,298.38	1.63
20	002385	大友股份	19,505,461.40	1.62

注: 卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的成本总额

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值的比例(%)
1	002034	洋河股份	45,387,588.65	3.77
2	600809	山西汾酒	42,763,604.41	3.55
3	002037	久联发展	41,947,561.85	3.48
4	002039	云南白药	37,080,758.48	3.08
5	600418	江淮汽车	36,895,863.69	2.99
6	600314	江苏银行	26,336,614.67	2.19
7	600787	中国铁建	26,280,722.85	2.18
8	300257	开山股份	25,828,348.03	2.14
9	600893	紫光股份	24,691,080.03	2.05
10	600000	浦发银行	23,511,205.66	1.95
11	000568	泸州老窖	22,626,345.57	1.88
12	000858	五粮液	22,371,617.21	1.85
13	600422	昆明制药	22,254,100.21	1.85
14	600287	南京医药	22,254,054.04	1.85
15	000528	广弘济世	20,264,199.02	1.76
16	002443	金通股份	20,363,427.95	1.69
17	601336	新华保险	20,056,851.11	1.66
18	600312	华微电子	19,870,752.26	1.63
19	600000	浦发银行	19,614,298.38	1.63
20	002385	大友股份	19,505,461.40	1.62

注: 卖出股票的成本总额及卖出股票的成本总额

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值的比例(%)
1	002034	洋河股份	45,387,588.65	3.77
2	600809	山西汾酒	42,763,604.41	3.55
3	002037	久联发展	41,947,561.85	3.48
4	002039	云南白药	37,080,758.48	3.08
5	600418	江淮汽车	36,895,863.69	2.99
6	600314	江苏银行	26,336,614.67	2.19
7	600787	中国铁建	26,280,722.85	2.18
8	300257	开山股份	25,828,348.03	2.14
9	600893	紫光股份	24,691,080.03	2.05
10	600000	浦发银行	23,511,205.66	1.95
11	000568	泸州老窖	22,626,345.57	1.88
12	000858	五粮液	22,371,617.21	1.85
13	600422	昆明制药	22,254,100.21	1.85
14	600287	南京医药	22,254,054.04	1.85
15	000528	广弘济世	20,264,199.02	1.76
16	002443	金通股份	20,363,427.95	1.69
17	601336	新华保险	20,056,851.11	1.66
18	600312	华微电子	19,870,752.26	1.63
19	600000	浦发银行	19,614,298.38	1.63
20	002385	大友股份	19,505,461.40	1.62

注: 卖出股票的成本总额及卖出股票的成本总额

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值的比例(%)
1	002034	洋河股份	45,387,588.65	3.77
2	600809	山西汾酒	42,763,604.41	3.55
3	002037	久联发展	41,947,561.85	3.48
4	002039	云南白药	37,080,758.48	3.08
5	600418	江淮汽车	36,895,863.69	2.99
6	600314	江苏银行	26,336,614.67	2.19
7	600787	中国铁建	26,280,722.85	2.18
8	300257	开山股份	25,828,348.03	2.14
9	600893	紫光股份	24,691,080.03	2.05
10	600000	浦发银行	23,511,205.66	1.95
11	000568	泸州老窖	22,626,345.57	1.88
12	000858	五粮液	22,371,617.21	1.85
13	600422	昆明制药	22,254,100.21	1.85
14	600287	南京医药	22,254,054.04	1.85
15	000528	广弘济世	20,264,199.02	1.76
16	002443	金通股份	20,363,427.95	1.69
17	601336	新华保险	20,056,851.11	1.66
18	600312	华微电子	19,870,752.26	1.63
19	600000	浦发银行	19,614,298.38	1.63
20	002385	大友股份	19,505,461.40	1.62

注: 卖出股票的成本总额及卖出股票的成本总额

网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值的比例(%)
1	002034	洋河股份	4	