

富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金

富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30日

2011 第三季度 报告

2011年9月30日

基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年十月二十八日

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年7月1日至2011年9月30日)

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用...
注:2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额...

§4 基金管理人报告

1.1 基金管理人及基金管理人主要人员情况
1.2 基金管理人内部控制制度
1.3 基金管理人内部控制制度的执行情况

§5 投资组合报告

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

§6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 本报告期初基金份额总额, 本报告期末基金份额总额

§7 影响投资者决策的其他重要信息

1. 经国富富兰克林基金管理有限公司第三届董事会第二次会议决议于二〇一一年七月八日审议通过,任命李德厚先生担任公司总经理...

§8 备查文件目录

- 1. 中国证监会批准富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金设立的文件
- 2. 富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金基金合同
- 3. 富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金招募说明书
- 4. 富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金托管协议
- 5. 中国证监会要求的其他文件

§9 基金管理人及基金托管人

富兰克林国海基金管理有限公司
二〇一一年十月二十八日

基金管理人:富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年十月二十八日

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年7月1日至2011年9月30日)

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用...
注:2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额...

§4 基金管理人报告

1.1 基金管理人及基金管理人主要人员情况
1.2 基金管理人内部控制制度
1.3 基金管理人内部控制制度的执行情况

§5 投资组合报告

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

§6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 本报告期初基金份额总额, 本报告期末基金份额总额

§7 影响投资者决策的其他重要信息

1. 经国富富兰克林基金管理有限公司第三届董事会第二次会议决议于二〇一一年七月八日审议通过,任命李德厚先生担任公司总经理...

§8 备查文件目录

- 1. 中国证监会批准富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金设立的文件
- 2. 富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金基金合同
- 3. 富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书
- 4. 富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金托管协议
- 5. 中国证监会要求的其他文件

§9 基金管理人及基金托管人

富兰克林国海基金管理有限公司
二〇一一年十月二十八日

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望 2011 年四季度,我们认为,国内通胀水平将继续回落,预计投资增速受保障房的开工建设维持 25%左右,预计四季度经济增速将保持较快增长,但由于通胀仍然居高水平,货币政策将保持偏紧,地 产政策不会放松,房地产市场面临下行压力越来越大...

§5 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

§5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

§5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

§5.3 报告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

Table with 5 columns: 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(%)

§5.3.2 报告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

Table with 5 columns: 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(%)

§5.3.2 报告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

Table with 5 columns: 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(%)

§5.4 报告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

Table with 5 columns: 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(%)

§5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

§5.4.2 报告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

Table with 5 columns: 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(%)

§5.5 报告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指期货投资

Table with 5 columns: 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(%)

§5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资

Table with 5 columns: 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(%)

§6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 本报告期初基金份额总额, 本报告期末基金份额总额

§7 影响投资者决策的其他重要信息

1. 经国富富兰克林基金管理有限公司第三届董事会第二次会议决议于二〇一一年七月八日审议通过,任命李德厚先生担任公司总经理...

§8 备查文件目录

- 1. 中国证监会批准富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金设立的文件
- 2. 富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金基金合同
- 3. 富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书
- 4. 富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金托管协议
- 5. 中国证监会要求的其他文件