富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年 12 月 31 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
报告送出日期：二〇一二年三月二十九日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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，应阅读年度报告报告正文。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国富成长动力股票
基金主代码	450007
交易代码	450007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年 3 月 25 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
报告期末基金份额总额	1,078,292,728.49 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于具有内生性增长和外延式扩张的积极成长型企业，在合理控制风险的基础上，力求实现基金资产的长期增值。
投资策略	大类资产配置： 本基金管理人将以大类资产的预期收益率、风险水平和它们之间的相关性为出发点，对于可能影响资产预期风险、收益率和相关性的因素进行综合分析和动态跟踪，据此制定本基金在股票、债券和货币市场工具等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，并进行定期或不定期的调整，以达到控制风险、增加收益的目的。 股票选择策略： 本基金在适度的大类资产配置的基础上运用“精选成长股”的股票投资策略。 本基金股票的选择分为三个层次：首先，成长型筛选是针对企业历史财务指标，应用数量模型筛选股票，连同研究员实地调研推荐的部分股票，建立备选股票库；其次，对备选股票库的股票应用估值模型进行价值评估；最后，对投资目标的商业模式进行分析，找出未来成长的动力，进行整体优化，选择股票投资组合。 债券投资策略： 本基金的债券投资为股票投资由于市场条件所限，不易实施预定投资策略时，使部分资产保值增值的防守性措施。债券投资组合的回报主要来自于组合的久期管理，识别收益率曲线中价值低估的部分以及各类债券中价值低估的种类。 权证投资策略： 本基金不直接从二级市场买入权证，可持有股票派发或可分离交易债券所分离的权证。
业绩比较基准	85%×沪深 300 指数+ 10%×中债国债总指数（全价）+ 5%×同业存款息率
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于较高收益，较高风险的投资品种。

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
信息披露负责人	姓名	储丽莉	唐州徽
	联系电话	021-3855 5555	010-66594855
	电子邮箱	service@ftsfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555	95566
传真		021-6888 3050	010-66594942

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.ftsfund.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	2011年	2010年	2009年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-90,972,147.25	71,516,886.75	127,515,162.84
本期利润	-243,854,285.45	-1,607,037.40	209,354,428.32
加权平均基金份额本期利润	-0.3581	-0.0061	0.2403
本期基金份额净值增长率	-27.55%	5.16%	23.07%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2019	0.2942	0.1664
期末基金资产净值	860,607,745.52	237,153,507.31	537,559,888.78
期末基金份额净值	0.7981	1.2942	1.2307

注：1.本基金合同生效日为 2009 年 3 月 25 日，本基金 2009 年度主要财务指标的计算期间为 2009 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日。

2.上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则-第 1 号《主要财务指标的计算及披露》。

3.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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4. 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（为期末余额，不是当期发生数）。

5.上述基金业绩指标不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，计入费用后实际收益要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

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①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-12.14%	1.45%	-7.42%	1.19%	-4.72%	0.26%
过去六个月	-22.20%	1.30%	-19.46%	1.15%	-2.74%	0.15%
过去一年	-27.55%	1.22%	-21.21%	1.10%	-6.34%	0.12%
自基金合同生效起至今	-6.24%	1.40%	-2.62%	1.37%	-3.62%	0.03%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准=沪深 300 指数×85%+中债国债总指数（全价）×10% + 同业存款利率×5%。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准采用中债国债总指数（全价），两个指数均具有较强的代表性。

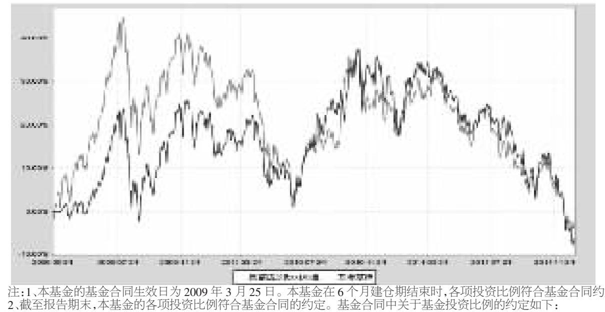
本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率（Benchmarkt）按下列公式计算：

Benchmarkt = 85% ×（沪深 300 指数 t/沪深 300 指数 t-1-1）+10%×（中债国债总指数（全价）t /中债国债总指数（全价）t-1-1）+ 5% ×同业存款利率/360

其中，t=1，2，3，…，T，T 表示时间截止日。

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

富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2009 年 3 月 25 日至 2011 年 12 月 31 日）



注：1、本基金的基金合同生效日为 2009 年 3 月 25 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

2、截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同的约定。基金合同中关于基金投资比例的约定如下：

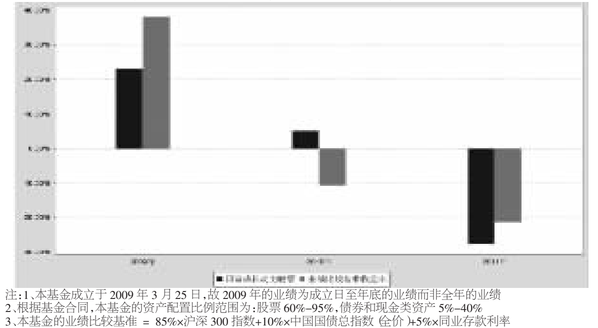
股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，债券投资占基金资产的比例范围为 0%-40%，权证投资占基金资产净值的比例范围为 0%-3%，现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述约定比例的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的除外。

3、本基金本报告期遵守法律、法规和基金合同的比例限制进行证券投资。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金
合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：1、本基金成立于 2009 年 3 月 25 日，故 2009 年的业绩为成立日至年底的业绩而非全年的业绩

2、根据基金合同，本基金的资产配置比例范围为：股票 60%-95%，债券和现金类资产 5%-40%

3、本基金的业绩比较基准 = 85%×沪深 300 指数+10%×中国国债总指数（全价）+5%×同业存款利率

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 份基金份额分红数	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
2011	1.800	206,119,328.26	7,437,287.02	213,556,615.28	-
2010	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2009	0.000	0.00	0.00	0.00	-
合计	1.800	206,119,328.26	7,437,287.02	213,556,615.28	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国海富兰克林基金管理有限公司成立于 2004 年 11 月，由国海证券股份有限公司和富兰克林邓普顿投资集团全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建，目前公司注册资本 2.2 亿元人民币，国海证券股份有限公司持有 51%的股份，邓普顿国际股份有限公司持有 49%的股份。富兰克林邓普顿投资集团是世界知名基金管理公司，在全球市场上有超过 60 年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿投资集团享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系，力争成为国内一流的基金管理公司。

本公司具有丰富的管理基金经验。截至本报告期末，从 2005 年 6 月第一只基金成立到现在，本公司已成功管理了 9 只基金产品（包含 A、C 类债券基金）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
潘江	本基金的原任基金经理	2009-03-25	2011-07-29	13年	潘江先生，CFA，耶鲁大学管理学院 MBA 和中国科学技术大学电子学学士。曾任职美国韦里逊电信公司投资经理，国泰基金管理有限公司研究部经理，万家基金管理有限公司首席策略师、研究总监、基金经理、投资决策委员会委员，国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部总经理，2009 年 3 月 25 日至 2011 年 7 月 29 日期间，任富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金的基金经理。
刘伟亭	本基金的基金经理及行业研究主管	2011-07-27	-	6年	刘伟亭先生，复旦大学经济学硕士和上海理工大学工学学士，曾任长江巴黎百富勤证券有限责任公司企业融资部助理经理，资本市场部业务主任和首席债券交易员。2007 年 6 月加入国海富兰克林基金管理有限公司后，曾任研究员，高级研究员，富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金和富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金的基金经理助理。现任富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金的基金经理及行业研究主管。
王晓宁	本基金的原任基金经理助理、富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金的基金经理助理及行业研究主管	2009-07-13	2011-07-29	8年	王晓宁先生，中央财经大学学士学位。曾任万家基金管理有限公司研究员、研究总监助理、基金经理助理。2008 年 4 月加入国海富兰克林基金管理有限公司，2009 年 7 月 13 日至 2011 年 7 月 29 日期间，同时担任本基金和富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金的基金经理助理。现任富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金和富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理及行业研究主管。

注：表中“证券从业年限”的计算标准为该名员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内公司严格执行《公平交易管理制度》，明确了公平交易的原则和目标，制订了实现公平交易的具体措施，并在技术上按照公平交易原则实现了严格的交易公平分配。报告期内不存在基金间通过价差交易进行利益输送的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

报告期末，公司共管理了九只基金，即富兰克林国海中国收益证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金、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、富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金和富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金，其中富兰克林国海中国收益证券投资基金和富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金为混合型基金，富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金为债券型基金，其余六只基金为股票型基金。公司已开展特定客户资产管理业务，共管理了五只产品，即“中行国富配置一号”、“兴业国富互惠一号”、“兴业国富互惠二号”、“中行国富互惠一号”和“中行国富配置二号”。公司尚未开展企业年金、社保基金资产管理业务。报告期内未发生公司管理的投资风格相似的不同基金之间的业绩表现差异超过 5%的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司按照《异常交易监控与报告制度》，系统划分了异常交易的类型、异常交易的界定标准、异常交易的识别程序，制订了异常交易的监控办法，并规范了异常交易的分析、报告制度。

报告期内未发生法规严格禁止的同一基金或不同基金之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年政策主基调是紧缩控通胀，资金成本随之上升，加之欧债危机持续发酵，市场风险溢价不断上升，整个市场处于不断行业轮动杀估值过程中。到了下半年，随着经济增速的下滑，市场开始担心经济硬着陆，于是又开始一轮不断下调企业盈利预测的过程。直到 10 月份随着通胀压力逐步减轻，开始看到政府明显的微调，这也是市场在 10 月份反弹的主要原因。但是随后市场意识到政府的这次微调和政策转向是有着很大的区别，力度上是不可能相提并论的。然后市场又回到了原来的担心经济下滑的逻辑中去。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金全年净值下跌了 27.55%，逊于沪深 300 指数 25.01%的跌幅。除了第一季度、6 月份和 10 月份市场有过可操作但幅度也只有 10%左右的反弹外，其余的时间几乎都在单边的向下，整个市场呈现悲观的情绪。全年来看表现食品饮料、银行和地产表现较好，表现最差的行业是有色，机械设备和电子元器件。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在这个时间点上，流动性上，总体可以肯定的是比前几个季度会有所改善，这一点我们可以从实际利率情况得到佐证。因此，如果说 2011 年是“戴维斯双杀”，那么至少对于一些中大型市值的股票，估值方面的风险是得到了释放的，2012 年这些股票面临的是业绩的风险，“双杀”只剩下了“一杀”。从这点看，我们觉得 2012 年的市场要比 2011 年要好。

在未来的一年，我们继续采取轻仓位重个股策略，从行业发展趋势、企业综合竞争能力和估值三维去挑选合意的投资标的，保持稳健的投资风格，为持有人争取好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会（简称“估值委员会”），并已制订了《公允估值管理办法》。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由普华永道中天会计师事务所进行审核并出具报告，由托管银行进行复核。公司估值委员会主席为总经理（或其任命者）；投票成员：主席，投资总监，营运总监，风险管理经理，基金会计经理，监察稽核部负责人，法务主管；非投票成员（观察员，列席表达相关意见）：督察长，基金经理，交易室负责人。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金已于 2011 年实施利润分配 213,556,615.28 元。

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施分配的利润。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

经普华永道中天会计师事务所审计，注册会计师为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金
报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		124,007,870.16	21,903,681.18
结算备付金		2,195,145.21	579,594.10
存出保证金		471,259.47	249,886.91
交易性金融资产		729,022,549.82	210,099,396.78
其中：股票投资		729,022,549.82	210,099,396.78
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		8,142,559.17	-
应收利息		16,605.64	3,832.19
应收股利		-	-
应收申购款		1,103.71	5,752,782.50
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		863,857,093.18	238,589,173.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		225,620.31	188,590.42
应付管理人报酬		1,168,023.24	312,841.47
应付托管费		194,670.55	52,140.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,080,628.53	397,516.72
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		580,405.03	484,577.50
负债合计		3,249,347.66	1,435,666.35
所有者权益：			
实收基金		1,078,292,728.49	183,238,089.73
未分配利润		-217,684,982.97	53,915,417.58
所有者权益合计		860,607,745.52	237,153,507.31
负债和所有者权益总计		863,857,093.18	238,589,173.66

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7981 元，基金份额总额 1,078,292,728.49 份。

7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金
本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入		-226,205,412.10	7,259,592.39
1.利息收入		800,173.21	389,902.78
其中：存款利息收入		800,173.21	389,902.78
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-74,564,729.85	79,447,009.03
其中：股票投资收益		-77,996,148.33	78,028,977.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		3,431,418.48	1,418,031.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-152,882,138.20	-73,123,924.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		441,282.74	546,604.73
减：二、费用		17,648,873.35	8,866,629.79
1.管理人报酬		10,084,987.95	4,753,954.05
2.托管费		1,680,831.37	792,325.68
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		5,461,609.56	2,909,036.04
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		421,444.47	411,314.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-243,854,285.45	-1,607,037.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列		-243,854,285.45	-1,607,037.40

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金
本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	183,238,089.73	53,915,417.58	237,153,507.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-243,854,285.45	-243,854,285.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	895,054,638.76	185,810,500.18	1,080,865,138.94
其中：1.基金申购款	1,192,449,575.07	198,228,271.23	1,390,677,846.30
2.基金赎回款	-297,394,936.31	-12,417,771.05	-309,812,707.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-213,556,615.28	-213,556,615.28
五、期末所有者权益（基金净值）	1,078,292,728.49	-217,684,982.97	860,607,745.52
项目	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	436,784,660.52	100,775,228.26	537,559,888.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,607,037.40	-1,607,037.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-253,546,570.79	-45,252,773.28	-298,799,344.07
其中：1.基金申购款	111,630,382.56	21,740,118.11	133,370,500.67
2.基金赎回款	-365,176,953.35	-66,992,891.39	-432,169,844.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	183,238,089.73	53,915,417.58	237,153,507.31

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：李雄厚，主管会计工作负责人：董卫军，会计机构负责人：黄宇虹

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金本报告期不存在重大会计差错。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
国海证券股份有限公司（“国海证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
邓普顿国际股份有限公司（Templeton International，Inc.）	基金管理人的股东

注：1.根据国海证券股份有限公司董事会于 2011 年 8 月 16 日在巨潮资讯发布的《国海证券股份有限公司关于承继原国海证券有限责任公司各项业务的公告》以及桂林集琦药业股份有限公司董事会于 2011 年 8 月 3 日在巨潮资讯发布的《桂林集琦药业股份有限公司关于工商登记变更的提示公告》，国海证券有限责任公司借壳桂林集琦药业股份有限公司上市，国海证券有限责任公司于 2011 年 7 月 6 日办理了工商注销登记手续，桂林集琦药业股份有限公司于 2011 年 8 月 1 日办理了名称、经营范围及注册资本的工商登记变更手续。国海证券股份有限公司接收了原国海证券有限责任公司的全部资产、负债和业务。

2.关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国海证券	714,448,971.22	18.64%	113,595,008.90	6.22%

7.4.3.1.2 权证交易

无。

7.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国海证券	598,640.43	18.72%	349,508.10	32.34%
关联方名称	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国海证券	93,429.09	6.16%	19,467.91	4.90%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,084,987.95	4,753,954.05
其中：支付销售机构的客户维护费	349,438.90	425,924.76

注：支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,680,831.37	792,325.68

注：支付基金托管人中国银行的基金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：日基金托管费=前一日基金资产净值 ×0.25% / 当年天数。

7.4.3.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	14,866,686.49	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	14,866,686.49
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	14,866,686.49	14,866,686.49
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.38%	8.11%

7.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末和上年度末（2010 年 12 月 31 日）除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	124,007,870.16	741,329.05	21,903,681.18	381,165.63

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。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期和上年度可比期间（2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日）均未参与关联方承销证券。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.4 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期无银行间正回购抵押的债券。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期无交易所正回购抵押的债券。

7.4.5 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

（a）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很小。

（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整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

（ii）各层次金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 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余额为 729,022,549.82 元，无属于第二层级的余额，无属于第三层级的余额（2010 年 12 月 31 日：第一层级 205,042,249.73 元，第二层级 5,057,147.05 元，无第三层级）。

（iii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和债券的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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

（iv）第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

（2）除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	729,022,549.82	84.39
	其中：股票	729,022,549.82	84.39
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	126,203,015.37	14.61
6	其他各项资产	8,631,527.99	1.00
7	合计	863,857,093.18	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	52,321,498.59	6.08
C	制造业	450,942,613.02	52.40
C0	食品、饮料	61,845,617.40	7.19
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	27,970,640.43	3.25
C6	金属、非金属	84,344,842.56	9.80
C7	机械、设备、仪表	184,439,705.42	21.43
C8	医药、生物制品	92,341,807.21	10.73
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,281,561.21	0.50
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	94,315,703.65	10.96
H	批发和零售贸易	11,283,603.10	1.31
I	金融、保险业	45,935,083.89	5.34
J	房地产业	52,329,144.88	6.08
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	17,613,341.48	2.05
	合计	729,022,549.82	84.71

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600403	大有能源	2,352,558	58,131,708.18	6.75
2	300090	盛运股份	4,919,606	46,834,649.12	5.44
3	600036	招商银行	3,869,847	45,935,083.89	5.34
4	000568	泸州老窖	1,155,902	43,115,144.60	5.01
5	000401	冀东水泥	2,273,442	37,898,278.14	4.40
6	600048	保利地产	3,378,945	33,789,450.00	3.93
7	600104	上海汽车	2,366,598	33,463,695.72	3.89
8	600166	福田汽车	5,149,724	29,919,896.44	3.48
9	600557	康缘药业	2,016,975	29,669,702.25	3.45
10	600348	阳泉煤业	1,824,236	27,691,902.48	3.22

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于国海富兰克林基金管理有限公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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比例（%）
1	000858	五 粮 液	88,158,076.50	37.17
2	601166	兴业银行	85,680,797.27	36.13
3	600403	大有能源	74,951,468.95	31.60
4	300090	盛运股份	69,730,971.75	29.40
5	600036	招商银行	64,369,736.96	27.14
6	002024	苏宁电器	63,775,603.29	26.89
7	600048	保利地产	63,670,865.89	26.85
8	600837	海通证券	61,568,817.18	25.96
9	000024	招商地产	57,395,139.70	24.20
10	600585	海螺水泥	54,442,055.10	22.96
11	600815	厦工股份	50,933,575.01	21.48
12	000568	泸州老窖	49,976,577.20	21.07
13	600425	青松建化	49,629,383.39	20.93
14	600383	金地集团	46,663,731.01	19.68
15	600000	浦发银行	46,579,682.24	19.64
16	600895	张江高科	44,880,923.64	18.92
17	000401	冀东水泥	41,860,575.75	17.65
18	600348	阳泉煤业	40,884,156.60	17.24
19	000012	南 玻 A	40,547,277.36	17.10
20	600395	盘江股份	39,715,508.65	16.75
21	600309	烟台万华	39,403,546.19	16.62
22	600166	福田汽车	38,838,773.13	16.38
23	600104	上汽集团	36,694,299.99	15.47
24	000937	冀中能源	35,417,814.93	14.93
25	600801	华新水泥	33,725,382.97	14.22
26	000063	中兴通讯	33,282,430.90	14.03
27	600582	天地科技	29,083,222.77	12.26
28	000983	西山煤电	28,628,376.93	12.07
29	000597	东北制药	27,113,693.16	11.43
30	000895	双汇发展	25,324,185.26	10.68
31	601169	北京银行	24,133,548.89	10.18
32	601888	中国国旅	24,082,289.82	10.15
33	600557	康缘药业	23,862,586.98	10.06
34	600499	科达机电	23,421,506.80	9.88
35	000933	神火股份	22,822,135.64	9.62
36	600518	康美药业	22,547,355.88	9.51
37	000680	山推股份	22,497,319.30	9.49
38	002073	软控股份	22,330,564.81	9.42
39	601992	金隅股份	22,289,832.25	9.40
40	000059	辽通化工	22,158,257.79	9.34
41	600015	华夏银行	22,072,582.00	9.31
42	601799	星宇股份	21,558,293.78	9.09
43	600475	华光股份	21,408,796.82	9.03
44	000877	天山股份	20,984,245.95	8.85
45	002307	北新路桥	20,952,851.42	8.84
46	600563	法拉电子	20,186,410.84	8.51
47	000960	锡业股份	20,129,026.28	8.49
48	000551	创元科技	19,996,440.21	8.43
49	000968	煤 气 化	19,550,002.12	8.24
50	600376	首开股份	19,499,535.98	8.22
51	600038	哈飞股份	19,441,462.49	8.20
52	600495	晋西车轴	19,323,600.05	8.15
53	600458	时代新材	18,961,432.66	8.00
54	002029	七 匹 狼	18,335,646.32	7.73
55	600189	吉林森工	18,208,878.22	7.68
56	002436	兴森科技	18,191,833.05	7.67
57	600312	平高电气	17,809,005.05	7.51
58	000826	桑德环境	17,450,076.78	7.36
59	002564	张化机	16,874,478.06	7.12
60	600881	亚泰集团	16,834,680.05	7.10
61	000028	国药一致	16,424,089.48	6.93
62	600079	人福医药	16,304,254.94	6.87
63	600594	益佰制药	15,874,534.65	6.69
64	600990	四创电子	15,323,908.25	6.46
65	600118	中国卫星	15,265,420.05	6.44
66	000661	长春高新	13,360,453.54	5.63
67	600970	中材国际	11,328,077.54	4.78
68	300171	东富龙	10,808,213.02	4.56
69	601898	中煤能源	10,647,537.00	4.49
70	002482	广田股份	9,684,634.45	4.08
71	600276	恒瑞医药	9,458,389.26	3.99
72	600498	烽火通信	8,466,012.26	3.57
73	600754	锦江股份	7,445,236.54	3.14
74	600742	一汽富维	6,390,539.33	2.69
75	002261	拓维信息	6,053,984.54	2.55
76	000501	鄂武商 A	5,002,327.63	2.11
77	600123	兰花科创	4,961,024.00	2.09

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

8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000858	五 粮 液	87,278,111.78	36.80
2	601166	兴业银行	84,276,610.54	35.54
3	002024	苏宁电器	80,236,369.16	33.83
4	600837	海通证券	61,089,562.19	25.76
5	000024	招商地产	53,957,681.35	22.75
6	600000	浦发银行	49,188,930.14	20.74
7	600309	烟台万华	46,126,820.04	19.45
8	600383	金地集团	41,647,020.33	17.56
9	600395	盘江股份	38,939,561.21	16.42
10	600585	海螺水泥	37,000,910.79	15.60
11	600815	厦工股份	33,398,854.22	14.08
12	600048	保利地产	32,824,708.84	13.84
13	000983	西山煤电	32,209,589.52	13.58
14	000012	南 玻 A	32,189,976.98	13.57
15	000063	中兴通讯	31,004,948.86	13.07
16	000895	双汇发展	30,432,276.32	12.83
17	601888	中国国旅	30,147,656.11	12.71
18	300090	盛运股份	26,322,223.90	11.10
19	002073	软控股份	24,755,096.68	10.44
20	601169	北京银行	23,612,482.70	9.96
21	600518	康美药业	23,066,362.15	9.73
22	600015	华夏银行	22,875,243.77	9.65
23	000933	神火股份	22,688,636.08	9.57
24	601992	金隅股份	22,424,213.60	9.46
25	600475	华光股份	22,176,441.39	9.35
26	002307	北新路桥	22,107,745.54	9.32
27	002029	七 匹 狼	21,303,930.89	8.98
28	000960	锡业股份	21,242,074.57	8.96
29	000551	创元科技	19,791,746.99	8.35
30	000826	桑德环境	19,642,956.40	8.28
31	000680	山推股份	18,193,113.17	7.67
32	000877	天山股份	18,002,577.99	7.59
33	000059	辽通化工	17,492,476.87	7.38
34	600458	时代新材	17,353,045.14	7.32
35	600881	亚泰集团	16,887,133.50	7.12
36	600036	招商银行	16,847,780.22	7.10
37	600189	吉林森工	16,366,673.16	6.90
38	600895	张江高科	15,851,155.12	6.68
39	600495	晋西车轴	14,601,750.78	6.16
40	002564	张化机	13,470,286.35	5.68
41	000937	冀中能源	13,213,426.91	5.57
42	601799	星宇股份	13,140,204.86	5.54
43	600801	华新水泥	11,240,987.04	4.74
44	002202	金风科技	11,132,865.98	4.69
45	600425	青松建化	10,853,854.10	4.58
46	601898	中煤能源	10,793,984.43	4.55
47	600970	中材国际	9,512,839.53	4.01
48	000968	煤 气 化	9,182,621.88	3.87
49	000651	格力电器	7,656,043.50	3.23
50	600754	锦江股份	7,536,780.47	3.18
51	601699	潞安环能	7,171,654.46	3.02
52	600312	平高电气	6,890,080.81	2.91
53	000568	泸州老窖	6,802,940.03	2.87
54	600742	一汽富维	6,537,828.83	2.76
55	600720	祁连山	6,229,037.43	2.63
56	000630	铜陵有色	5,811,360.95	2.45
57	600741	华域汽车	5,591,722.02	2.36
58	000401	冀东水泥	5,544,727.67	2.34
59	600123	兰花科创	5,520,543.65	2.33
60	000550	江铃汽车	5,502,758.75	2.32
61	000501	鄂武商 A	5,455,332.72	2.30
62	600594	益佰制药	5,019,941.70	2.12
63	002038	双鹭药业	4,974,644.71	2.10
64	600362	江西铜业	4,928,508.05	2.08
65	002261	拓维信息	4,822,686.58	2.03

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,291,676,461.28
卖出股票的收入（成交）总额	1,541,875,021.71

注：“买入股票成本总额”及“卖出股票收入总额”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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金本期投资的前十名证券中，无报告期内发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

8.9.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	471,259.47
2	应收证券清算款	8,142,559.17
3	应收股利	-
4	应收利息	16,605.64
5	应收申购款	1,103.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,631,527.99

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期间的可转债。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
10,387	103,811.76	912,071,524.44	84.58%	166,221,204.05	15.42%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	20,876.16	0.0019%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 3 月 25 日）基金份额总额	1,109,598,820.51
本报告期期初基金份额总额	183,238,089.73
本报告期基金总申购份额	1,192,449,575.07
减：本报告期基金总赎回份额	297,394,936.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,078,292,728.49

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（一）基金管理人重大人事变动

1、经国海富兰克林基金管理有限公司第二届董事会第二十八次会议审议通过，金哲非女士不再担任公司总经理，由副总经理李雄厚先生代为履行总经理职务。相关公告已于 2011 年 5 月 4 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露。

2、经国海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审议通过，由李雄厚先生担任公司总经理。相关公告已于 2011 年 9 月 30 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露。

（二）基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理。因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理，刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人应支付给会计师事务所的审计费用是人民币 60000.00 元，本基金自成立以来对其进行审计的均为普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

（一）基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

（二）基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	274,967,982.99	7.17%	233,722.09	7.31%	-
东方证券	2	573,641,808.61	14.96%	466,665.58	14.60%	-
光大证券	1	135,044,024.23	3.52%	114,787.25	3.59%	-
广发证券	1	25,321,027.61	0.66%	21,523.04	0.67%	-
国海证券	2	714,448,971.22	18.64%	598,640.43	18.72%	-
国信证券	1	277,124,582.60	7.23%	235,555.29	7.37%	-
海通证券	1	386,322,844.01	10.08%	328,373.34	10.27%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	100,647,983.47	2.63%	85,550.76	2.68%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	2	361,152,437.58	9.42%	293,813.35	9.19%	-
银河证券	1	229,453,085.45	5.99%	195,034.69	6.10%	-
招商证券	1	173,208,339.10	4.52%	140,732.69	4.40%	-
中金公司	2	96,217,213.78	2.51%	80,857.53	2.53%	-
中信建投	2	239,191,149.08	6.24%	201,558.66	6.30%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	246,738,533.26	6.44%	200,476.65	6.27%	-

注：1. 专用交易单元的选择标准和程序

1）选择代理基金证券买卖的证券经营机构的标准

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，并租用其交易单元作为基金的专用交易单元。选择的标准是：

①资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

②财务状况良好，经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚；

③内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

④具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

⑤研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2）租用基金专用交易单元的程序

①基金管理人根据上述标准考察证券经营机构，考察结果经公司领导审批后，我司与被选中的证券经营机构签订《券商交易单元租用协议》和《研究服务协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。

②之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系，每季度对签约证券经营机构的服务进行一次综合评价：

A 提供的研究报告质量和数量；

B 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；

C 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；

D 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；

E 其他可评价的量化标准。

经过评价，对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。

③交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

2、报告期内证券公司基金专用交易单元的租用与变更情况

报告期内，根据上述基金专用报告期内，根据上述基金专用交易单元选择标准和程序，本基金逐步租用证券公司的交易单元合计 22 个：其中国海证券和中金公司、申银万国证券、中信建投证券、东方证券各 2 个，光大证券、长江证券、中信证券、海通证券、银河证券、中银国际证券、齐鲁证券、招商证券、华泰证券、国信证券、瑞银证券和广发证券各 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

国海富兰克林基金管理有限公司
二〇一二年三月二十九日