

基金管理人: 国富富兰克林基金管理有限公司
基金托管人: 中国工商银行股份有限公司

富兰克林国海中国收益证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或资产增值。

基金的投资业绩并不构成对未来表现的承诺,投资者欲了解详细情况,应阅读本半年度报告全文。

本半年度报告摘要摘自半年度报告全文,投资者欲了解详细情况,应阅读半年度报告全文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2012年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况

基金名称: 富兰克林国海中国收益基金
基金代码: 450001
基金运作方式: 契约型开放式
基金合同生效日期: 2005年6月1日

2.2 基金产品说明
投资目标: 本基金富兰克林国海中国收益证券投资基金,在充分组合国内证券市场具有良好流动性的股票、债券和货币市场工具的基础上,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期增值。

投资策略: 本基金遵循以每个季度为一个调整周期,资产配置分析会,对宏观经济和宏观政策进行跟踪,基金投资组合进行一次对下一个季度投资组合的跟踪调整,调整资产配置,形成最终持仓。

业绩比较基准: 40%×沪深300指数+55%×中国国债指数+5%×银行活期存款利率
风险收益特征: 本基金属于证券投资基金中收益稳定、风险较低的种类,风险程度低于债券和股票型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国工商银行股份有限公司

2.4 信息披露方式
信息披露网址: www.fund.com.cn
信息披露联系人: 基金管理人及基金托管人的住所

3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: 指标名称, 金额/元. Rows include 1.1.1 期初基金份额总额, 1.1.2 本期已实现收益, 1.1.3 期末基金份额总额, 1.1.4 期末基金份额净值.

注: 1. 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; 2. 1.1.1至1.1.4指标的计算公式,详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则。

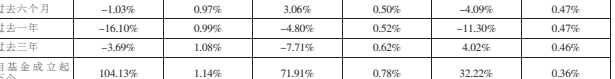
3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 阶段, 基金份额净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, ①-②, ③-④. Rows include 过去一个月, 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 过去二年, 过去三年, 自基金成立起至今.

注: 1. 本基金的投资组合投资限制的有关约定,本基金的业绩比较基准=40%×沪深300指数+55%×中国国债指数+5%×银行活期存款利率,本基金业绩比较基准采用沪深300指数、中国国债指数、债券指数部分的业绩比较基准采用中国国债总指数(全价),两个指数均具有较强的代表性。

2. 本基金各交易日内对业绩比较基准进行再平衡处理,1日收益率(Benchmark)按下列公式计算: Benchmark = 40% × 沪深300指数收益率 + 55% × 中国国债总指数收益率 + 5% × 中国国债总指数收益率(全价) + 1-11% × 5% × 银行活期存款利率/360

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注: 1. 本基金的基金合同生效日为2005年6月1日,本基金在6个月建仓期结束后,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20%至65%,债券资产占35%至75%,现金资产占5%至20%。本基金的股票资产主要集中在具有良好流动性的上市公司,该部分股票和债券投资比例不低于本基金资产的80%。

3. 本基金本报告遵守法律、法规和基金合同的限制进行证券投资。

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海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管理公司共同出资设立,注册资本为2.2亿元人民币,国海证券股份有限公司持有51%的股权。

4.1.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.2 基金管理人及基金托管人
4.2.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.2.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.3 基金管理人及基金托管人
4.3.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.3.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.4 基金管理人及基金托管人
4.4.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.4.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.5 基金管理人及基金托管人
4.5.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.5.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.6 基金管理人及基金托管人
4.6.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.6.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.7 基金管理人及基金托管人
4.7.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.7.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.8 基金管理人及基金托管人
4.8.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.8.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.9 基金管理人及基金托管人
4.9.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.9.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.10 基金管理人及基金托管人
4.10.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.10.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.11 基金管理人及基金托管人
4.11.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.11.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.12 基金管理人及基金托管人
4.12.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.12.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.13 基金管理人及基金托管人
4.13.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.13.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.14 基金管理人及基金托管人
4.14.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.14.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.15 基金管理人及基金托管人
4.15.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.15.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.16 基金管理人及基金托管人
4.16.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.16.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.17 基金管理人及基金托管人
4.17.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.17.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.18 基金管理人及基金托管人
4.18.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.18.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.19 基金管理人及基金托管人
4.19.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.19.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.20 基金管理人及基金托管人
4.20.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.20.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.21 基金管理人及基金托管人
4.21.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.21.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.22 基金管理人及基金托管人
4.22.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.22.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.23 基金管理人及基金托管人
4.23.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.23.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.24 基金管理人及基金托管人
4.24.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.24.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.25 基金管理人及基金托管人
4.25.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.25.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

4.26 基金管理人及基金托管人
4.26.1 基金管理人及其管理职责的说明
富兰克林国海基金管理有限公司,在2005年6月1日基金合同生效后,在本公司已经成功管理了12只基金,基金资产A/C类资产规模达1000亿元人民币。

4.26.2 基金托管人及其管理职责的说明
中国工商银行股份有限公司,在证券市场从事超过60年的投资管理,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管理全球的投资机制,研究分析中国宏观经济形势,力争成为国内一流的基金管理公司。

6.1 资产负债表

6.2 利润表

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

6.4 现金流量表

6.5 利润分配表

6.6 所有者权益(基金净值)变动表

6.7 现金流量表

6.8 利润分配表

6.9 所有者权益(基金净值)变动表

6.10 现金流量表

6.11 利润分配表

6.12 所有者权益(基金净值)变动表

6.13 现金流量表

6.14 利润分配表

6.15 所有者权益(基金净值)变动表

6.16 现金流量表

6.17 利润分配表

6.18 所有者权益(基金净值)变动表

6.19 现金流量表

6.20 利润分配表

6.21 所有者权益(基金净值)变动表

6.22 现金流量表

6.23 利润分配表

6.24 所有者权益(基金净值)变动表

6.25 现金流量表

6.26 利润分配表

6.27 所有者权益(基金净值)变动表

6.28 现金流量表

6.29 利润分配表

6.30 所有者权益(基金净值)变动表

6.31 现金流量表

6.32 利润分配表

6.33 所有者权益(基金净值)变动表

6.34 现金流量表

6.35 利润分配表

6.36 所有者权益(基金净值)变动表

6.37 现金流量表

6.38 利润分配表

6.39 所有者权益(基金净值)变动表

6.40 现金流量表

6.41 利润分配表

6.42 所有者权益(基金净值)变动表

6.43 现金流量表

6.44 利润分配表

6.45 所有者权益(基金净值)变动表

6.46 现金流量表

6.47 利润分配表

6.48 所有者权益(基金净值)变动表

6.49 现金流量表

6.50 利润分配表

6.51 所有者权益(基金净值)变动表

6.52 现金流量表

6.53 利润分配表

6.54 所有者权益(基金净值)变动表

6.55 现金流量表

6.56 利润分配表

6.57 所有者权益(基金净值)变动表

6.58 现金流量表

6.59 利润分配表

6.60 所有者权益(基金净值)变动表

6.61 现金流量表

6.62 利润分配表

6.63 所有者权益(基金净值)变动表

6.64 现金流量表

6.65 利润分配表

6.66 所有者权益(基金净值)变动表

6.67 现金流量表

6.68 利润分配表

6.69 所有者权益(基金净值)变动表

6.70 现金流量表

6.71 利润分配表

6.72 所有者权益(基金净值)变动表

6.73 现金流量表

6.74 利润分配表

6.75 所有者权益(基金净值)变动表

6.76 现金流量表

6.77 利润分配表

6.78 所有者权益(基金净值)变动表

6.79 现金流量表

6.80 利润分配表

6.81 所有者权益(基金净值)变动表

6.82 现金流量表

6.83 利润分配表

6.84 所有者权益(基金净值)变动表

6.85 现金流量表

6.86 利润分配表

6.87 所有者权益(基金净值)变动表

7.1 期末资产金额

7.2 期末负债金额

7.3 期末净资产金额

7.4 期末净资产金额

7.5 期末净资产金额

7.6 期末净资产金额

7.7 期末净资产金额

7.8 期末净资产金额

7.9 期末净资产金额

7.10 期末净资产金额

7.11 期末净资产金额

7.12 期末净资产金额

7.13 期末净资产金额

7.14 期末净资产金额

7.15 期末净资产金额

7.16 期末净资产金额

7.17 期末净资产金额

7.18 期末净资产金额

7.19 期末净资产金额

7.20 期末净资产金额

7.21 期末净资产金额

7.22 期末净资产金额

7.23 期末净资产金额

7.24 期末净资产金额

7.25 期末净资产金额

7.26 期末净资产金额

7.27 期末净资产金额

7.28 期末净资产金额

7.29 期末净资产金额

7.30 期末净资产金额

7.31 期末净资产金额

7.32 期末净资产金额

7.33 期末净资产金额

7.34 期末净资产金额

7.35 期末净资产金额

7.36 期末净资产金额

7.37 期末净资产金额