

（上接B210版）

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	股权投资	—	—
其中:股票	—	—	—
2	固定收益投资	387,970,731.02	74.40
其中:债券	387,970,731.02	74.40	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	67,000,420.50	12.85
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	49,883,355.77	9.57
6	其他各项资产	16,608,143.01	3.18
7	合计	521,462,650.30	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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
本基金本报告期末未持有股票。

4. 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	29,976,000.00	5.89
3	金融债券	—	—
其中:政策性金融债	—	—	—
4	企业债券	244,819,334.62	48.11
5	企业短期融资券	20,140,000.00	3.96
6	中期票据	31,183,000.00	6.13
7	可转债	61,852,396.40	12.16
8	其他	—	—
9	合计	387,970,731.02	76.24

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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112124	11债-12	400,000	39,600,000.00	7.78
2	122553	12债交通	300,000	30,300,000.00	5.95
3	1001047	10央行票据 47	300,000	29,976,000.00	5.89
4	110015	石化转债	280,000	28,814,800.00	5.86
5	112126	12石化 01	250,000	25,229,750.00	4.96

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资产支持证券投资明细
报告期末本基金未持有资产支持证券。

7. 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
报告期末本基金未持有证券。

8. 投资组合报告附注
1) 本基金本报告期内前十名证券中,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。

2) 本基金投资的前十名证券中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,058.41
2	应收证券清算款	9,020,231.81
3	应收利息	—
4	应收股利	—
5	应收申购款	1,680,260.07
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	16,608,143.01

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	28,814,800.00	5.66
2	113002	11石化转债	9,706,596.40	1.91

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。

十三、基金业绩比较基准

本基金采取买入并持有策略,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业绩,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

截止至2012年12月31日基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比:

(一)富兰克林国海沪港深信用债券证券投资基金A期

阶段	净值增长率①	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)
2012年9月11日—2012年12月31日	1.70%	0.06%	-0.49%	0.05%	2.19%	0.01%

(二)富兰克林国海沪港深信用债券证券投资基金C期

阶段	净值增长率①	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)
2012年9月11日—2012年12月31日	1.60%	0.05%	-0.49%	0.05%	2.09%	0.00%

十四、基金费用与税收

(一)基金费用的种类
1. 基金管理人的管理费;
2. 基金托管人的托管费;
3. 销售服务费;本基金从C类基金份额的基金资产中计提销售服务费;
4. 基金合同生效与基金募集相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5. 基金份额持有人大会费用;
6. 基金的证券交易费用;
7. 基金的银行汇划费用;
8. 证券账户开户费用和银行帐户维护费;
9. 按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金资产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1. 基金管理人的管理费
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提,计算方法如下:
H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为0.7%
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月3个工作日内在基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延至最近可支付日支付。

2. 基金托管人的托管费
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提,计算方法如下:
H=E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.2%
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月3个工作日内在基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延至最近可支付日支付。

3. 销售服务费
本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.3%,本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.3%年费率计提。
计算方法如下:
H=E×0.3%÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值
销售服务费每日计算,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月3个工作日内在基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延至最近可支付日支付。

销售服务费专项用于本基金的营销推广以及基金的持有人服务等各项费用。
4. 上述一、基金费用的种类中第4—8项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)列入基金费用的项目
下列费用列入基金费用:
1. 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2. 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3. 基金合同生效前的相关费用;
4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金费用的调整
本基金管理人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率和服务费方式,降低基金管理费率、基金托管费率和基金销售服务费率,无须召开基金份额持有人大会,基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

(五)基金费用对基金净值的计算
本基金管理人将按照法律法规的规定履行纳税义务。
十五、申购赎回费率及收费模式

(一)基金管理人
1. 基金管理人名称:富兰克林(中国)证券资产管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路1号中国—美国科技企业孵化器二期C—6楼二层
联系人:李洪亮
电话:0755-83198888
传真:0755-83195109
联系人:李洪亮
客户服务热线:95559
公司网址:www.bankcomm.com

3) 招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建强
电话:0755-83198888
传真:0755-83195109
联系人:李洪亮
客户服务热线:95559
公司网址:www.cmbchina.com

4) 中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:姜文斌
电话:010-57092611
联系人:董文海
客户服务热线:95588
公司网址:www.icbc.com.cn

5) 上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉炳轩
电话:021-61618888
传真:021-63601199
联系人:唐芳
客户服务热线:95528
公司网址:www.spdb.com.cn

6) 东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州工业园区星阳街21号
法定代表人:李永宏
电话:0512-62919661
传真:0512-62911770
联系人:叶海霞
客户服务热线:95288
公司网址:www.dwzq.com.cn

7) 渤海银行股份有限公司
注册地址:天津市河西区马场道201-205号
办公地址:天津市河西区马场道201-205号
法定代表人:闫冰雅
电话:022-60391999
联系人:唐芳
客户服务热线:95578
公司网址:www.bhbc.com.cn

8) 中信证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
电话:010-60833888
传真:010-60833646
联系人:李洪亮
客户服务热线:95548
公司网址:www.citics.com

9) 中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街33号新富大厦B座6层
办公地址:北京市西城区金融大街33号新富大厦B座6层
法定代表人:陈共炎
电话:010-66568888
传真:010-66568522
联系人:李洪亮
客户服务热线:4008-188-888
公司网址:www.chinastock.com.cn

10) 富国基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦8楼801
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

11) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

12) 浙江长盛基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路381号4号楼404室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦906室
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

13) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

14) 浙江长盛基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路381号4号楼404室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦906室
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

15) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

16) 浙江长盛基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路381号4号楼404室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦906室
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

17) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

18) 浙江长盛基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路381号4号楼404室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦906室
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

19) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

20) 浙江长盛基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路381号4号楼404室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦906室
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

21) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

22) 浙江长盛基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路381号4号楼404室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦906室
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

23) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

24) 浙江长盛基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路381号4号楼404室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦906室
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

25) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

26) 浙江长盛基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路381号4号楼404室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦906室
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

27) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

28) 浙江长盛基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路381号4号楼404室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦906室
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

29) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

30) 浙江长盛基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路381号4号楼404室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦906室
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

31) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

32) 浙江长盛基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路381号4号楼404室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦906室
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

33) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

34) 浙江长盛基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路381号4号楼404室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦906室
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

35) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

36) 浙江长盛基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路381号4号楼404室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦906室
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

37) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

38) 浙江长盛基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路381号4号楼404室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1669号富国大厦906室
邮政编码:200120
法定代表人:李欣
电话:021-52999987
传真:021-52999777
900004富国基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
办公地址:深圳市福田区福强路504号发展大厦25层J单元邮编:510001
联系人:李洪亮
电话:0755-33229500
客服电话:4006-788-788
联系人:李洪亮
电话:0755-82007988
公司网址:www.fund123.com

39) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
邮政编码:200235
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509987
传真:021-64385308

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提,计算方法如下:
H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为0.2%
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月3个工作日内在基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延至最近可支付日支付。