富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年十月二十三日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富弹性市值股票
基金主代码	450002
交易代码	450002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年6月14日
报告期末基金份额总额	2,780,702,844.87份
投资目标	本基金以富兰克林邓普顿投资集团环球资产管理平台为依托，在充分结合国内新兴证券市场特性的原则下，通过主要投资于具有独特且可持续竞争优势、未来收益具有成长性的上市公司股票，辅助投资于资产价值低估的上市公司股票，以达到基金财产长期增值的目的。
投资策略	资产配置策略： 一般情况下，投资决策委员会负责基金财产的配置策略，并采用资产配置分析会的形式来实施，以资产配置分析会的组织形式保证资产配置决策的正确性和科学性。资产配置分析会由投资总监主持，基金经理和研究部总监参加。 在具体的资产配置过程中，本基金采用“自下而上”的资产配置方法，从上市公司的具体发展前景和未来的盈利分析，到行业的发展趋势，再到宏观经济形势，确定大类资产的配置。 在运用了“自下而上”策略之后，根据市场环境的变化、市场出现的各种套利机会和未来的发展趋势判断，确定本基金财产配置最终的选择标准。 股票选择策略： 本基金重点关注和选择具有成长性的股票，那些收益增长潜力尚未完全反映在目前股价上的股票构成了本基金投资组合的基础，在此基础上，再根据市场机会的变化，捕捉新利性和特殊性机会，以降低基金的整体风险并提升基金的超额收益。 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。
业绩比较基准	70%×MSCI中国A股指数+25%×中债国债总指数(全价)+5%×同业存款息率
风险收益特征	本基金是一只主动型投资的股票型基金，属于股票型基金中的中高风险品种，本基金的风险与预期收益都高于混合型基金。
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-35,610,183.24
2.本期利润	296,263,778.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0986
4.期末基金资产净值	3,612,123,950.93
5.期末基金份额净值	1.2990

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（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

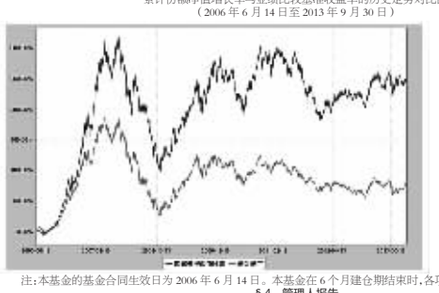
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.15%	1.02%	6.95%	0.97%	1.20%	0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2006年6月14日至2013年9月30日）



注：本基金的基金合同生效日为2006年6月14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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张晓东	公司副总经理、公募投资决策委员会主席、首席基金经理、国富弹性市值股票基金和国富深化价值股票基金基金经理	2006-6-14	-	20年	张晓东先生，美国多米尼克学院国际经济政治分析硕士。历任中国企业管理无锡培训中心助教、中欧管理研究生项目（现改为中欧国际管理学院）助教/中方院长助理，无锡虹美电器集团销售/项目经理，美国纽堡太平洋投资管理公司高级投资经理，阳光国际管理公司董事，中信资本市场控股公司董事（非董事会成员），国海富兰克林基金管理有限公司基金经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理、公募投资决策委员会主席，首席基金经理，管理国富弹性市值股票基金和国富深化价值股票基金。

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《富兰克林国海弹性市值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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配、信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》，严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。报告期内公司不存在投资组合之间发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年三季度市场表现较好，尤其是权重股走出了自8号文出台以来的年内较强行情。从经济基本面来看，七月和八月连续两个月的经济数据超出市场预期，带动了市场整体走出较好行情。除了经济数据略超市场预期外，三季度市场的主题热点也此起彼伏，上海自贸区/土地流转/金融改革等政策热点的频繁出台刺激了市场在相关题材股票上的投资热情，三季度沪深300指数上涨9.47%。

出于市场对经济增长的预期由悲观逐步转换，我们在三季度保持了较高的仓位，但在行业配置上进行了一定的调整。考虑到新一届政府在三公消费和反腐方面的监管力度大大超过我们年初的预期，因此我们在三季度降低了白酒行业的仓位。同时出于对一些传统行业改革的预期，我们在三季度增加了铁路/化工等行业个股的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年三季度，基金净值上涨8.15%，业绩基准上涨6.95%，基金跑赢业绩基准1.2个百分点。本基金仓位配置最大的医药行业在三季度表现较好，是本季基金业绩跑赢业绩基准的主要原因。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,953,697,476.17	74.91
	其中：股票	2,953,697,476.17	74.91
2	固定收益投资	36,981,526.70	0.94
	其中：债券	36,981,526.70	0.94
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	418,000,537.00	10.60
	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	532,207,551.89	13.50
6	其他各项资产	2,213,925.97	0.06
7	合计	3,943,101,017.73	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,960,736,232.25	54.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	217,762,367.04	6.03
F	批发和零售业	437,559,540.74	12.11
G	交通运输、仓储和邮政业	140,982,843.44	3.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	72,313,068.00	2.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	124,343,424.70	3.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,953,697,476.17	81.77

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

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（%）
1	002422	科伦药业	5,460,693	293,239,214.10	8.12
2	600694	大商股份	7,566,809	221,102,158.98	6.12
3	600276	恒瑞医药	6,008,421	218,526,271.77	6.05
4	000963	华东医药	4,922,144	216,082,121.60	5.98
5	600267	海正药业	11,314,974	215,210,805.48	5.96
6	002250	联化科技	7,598,125	182,582,943.75	5.05
7	601333	广深铁路	47,629,339	140,982,843.44	3.90
8	600594	益佰制药	4,030,928	135,439,180.80	3.75
9	000887	中鼎股份	17,171,699	133,080,667.25	3.68
10	601633	长城汽车	2,451,493	125,222,262.44	3.47

5.4 报告期末按债券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	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	19,908,500.00	0.55
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	17,073,026.70	0.47
8	其他	-	-
9	合计	36,981,526.70	1.02

5.5 报告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

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	110023	民生转债	146,390	15,489,525.90	0.43
2	112120	12联发债	150,000	14,910,000.00	0.41
3	098060	09宇通债	50,000	4,998,500.00	0.14
4	125887	中鼎转债	13,440	1,583,500.80	0.04
5	-	-	-	-	-

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金本期投资的前十名证券中，无投资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。

四川科伦药业股份有限公司2013年5月21日公告披露，于2013年5月20日收到中国证监会稽查总队的《调查通知书》，因涉嫌信息披露违法违规，中国证监会决定对其立案调查。科伦药业表示主要是公司2011年收购崇州君健塑胶有限公司时存在未真实、准确、完整披露交易对方的情况及交易双方之间的关联关系的问题，公司决定就收购君健塑胶100%股权事项按照关联交易的决策程序重新履行审议程序，并于2013年5月30日获得了股东大会表决通过。截至本报告期末，立案调查仍在进行中，暂无相关事项公告。

本基金对科伦药业投资决策说明：本公司的投研团队经过充分调研，本基金通过长期跟踪该公司认为科伦药业符合本基金价值投资的理念，对该股的投资决策遵循公司投资制度的规定。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	900,916.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,050,791.80
5	应收申购款	262,218.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,213,925.97

5.10.4 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	110023	民生转债	15,489,525.90	0.43
2	125887	中鼎转债	1,583,500.80	0.04

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	3,256,419,095.36
本报告期基金总申购份额	21,532,241.85
减：本报告期基金总赎回份额	497,248,492.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,780,702,844.87

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本公司管理的该基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金设立的文件；

2、《富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金基金合同》；

3、《富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金招募说明书》；

4、《富兰克林国海弹性市值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。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站：www.ftsfund.com。

8.3 查阅方式

1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件。

2、登陆基金管理人网站 www.ftsfund.com 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

二〇一三年十月二十三日

富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年十月二十三日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富亚洲机会股票（QDII）
基金主代码	457001
交易代码	457001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年2月22日
报告期末基金份额总额	58,712,590.67份
投资目标	本基金的投资目标是通过投资在亚洲地区（不包括日本）证券市场进行交易以及公司总部或经营范围在亚洲地区（不包括日本）的上市公司以实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在投资过程中首先强调亚洲国家和地区上市公司的品质与成长性的结合。采取“自下而上”的选股策略，注重个股成长性指标分析，挖掘拥有更佳成长特性的公司，构建股票池。同时，在亚洲国家和地区经济发展格局下，注重各区域市场环境、政经前景分析，甄别不同亚洲国家与地区、行业与板块的投资机会，优先考虑国家与地区的资产配置，决定行业与板块的基本布局，并从中筛选出具有国际比较优势的优质上市公司。最后通过深入的投资价值评估，形成优化的投资组合。 在固定收益类投资部分，其资产布局坚持安全性、流动性和收益性为资产配置原则，并结合现金管理、货币市场工具等来制订具体策略。
业绩比较基准	MSCI亚洲（除日本）净总收益指数
风险收益特征	本基金为区域性股票型证券投资基金，基金预期投资风险收益水平高于混合型基金和债券型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的基金品种。
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
境外投资顾问英文名称	Franklin Advisers, Inc.,
境外投资顾问中文名称	富兰克林顾问公司
境外资产托管人英文名称	JP Morgan Chase Bank, National Association
境外资产托管人中文名称	摩根大通银行

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	609,080.01
2.本期利润	1,427,927.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0257
4.期末基金资产净值	57,775,039.57
5.期末基金份额净值	0.984

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（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

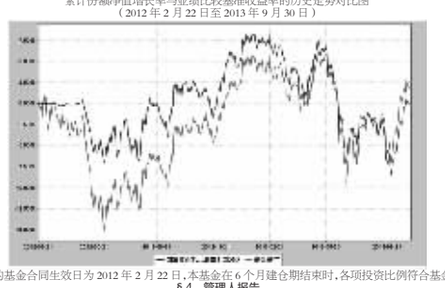
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.44%	0.84%	4.86%	0.97%	-3.42%	-0.13%

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

富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2012年2月22日至2013年9月30日）



注：本基金的基金合同生效日为2012年2月22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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
管宇	国富亚洲机会股票（QDII）基金经理	2012-2-22	-	9年	管宇先生，法国籍，CFA，巴黎高等商学院研究生硕士。历任汇丰集团信汇资产管理公司基金经理助理，交易员，Financière de l'Echiquier基金经理助理，股票分析师。现任国海富兰克林基金管理有限公司国富亚洲机会股票（QDII）基金的基金经理。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
斯蒂芬·多佛（Stephen H.Dover）	董事总经理和国际首席投资官	28年	他负责韩国、巴西和印度地区管理和销售的基金产品和其他受托管理资产的投资，以及富兰克林艾下的亚洲股权类成长性投资产品的投资。他也是国海富兰克林基金管理有限公司投资团队的顾问。
苏库玛拉贾（Sukumar Rajah）	常务董事和亚洲权益资本的首席投资官	22年	他负责印度权益类投资团队，并管理印度国内的富兰克林权益类基金、富兰克林印度基金和印度以外的机构账户。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《富兰克林国海亚洲（除日本）机会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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配、信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》，严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。报告期内公司不存在投资组合之间发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

经过二季度的下跌之后，三季度亚洲市场有所反弹。一方面由于经济复苏前景尚未明朗，美联储并未如之前市场预期减少债券购买计划，量化宽松政策得以维持。另一方面，中国经济数据的好转，以及中国政府领导人对维持经济增长的决心，有助于改善市场投资者情绪。最后，欧洲经济的企稳复苏，也对亚洲各国家和地区的出口产生了正面的作用。但总体上，受海外诸多不确定性因素的影响，三季度市场的波动性仍然较大，尤其反映在印度，印尼等国家的货币和股市的表现上。

本季度，国富亚洲机会基金提高了股票仓位，利用市场的波动性布局成长性较好，公司质地较好的上市公司。国别配置方面，本基金加大了对香港、韩国和新加坡市场的配置，降低了对印度和泰国市场的配置。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金净值在三季度上涨1.44%。相比之下，业绩比较基准（MSCI亚洲除日本净总收益指数，以美元计价）同期上涨4.86%。基金业绩表现落后比较基准的主要原因为部分股票表现不达预期以及人民币相对美元的小幅升值。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	51,855,162.25	84.83
	其中：普通股	46,017,321.48	75.28
	存托凭证	5,837,840.77	9.55
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	1,389,079.12	2.27
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,178,601.51	8.47
8	其他各项资产	2,708,058.85	4.43
9	合计	61,130,901.73	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
香港	15,563,551.60	26.94
韩国	10,169,558.21	17.60
美国	6,616,593.79	11.45
台湾	6,158,707.88	10.66
新加坡	6,018,192.97	10.42
泰国	3,796,468.17	6.57
印度尼西亚	2,217,452.17	3.84
英国	780,165.83	1.35
卢森堡	329,261.67	0.57
马来西亚	205,209.96	0.36
合计	51,855,162.25	89.75

注：以上国家（地区）均按照股票及存托凭证上市交易地点进行统计。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
材料	1,434,839.60	2.48
电信服务	-	-
信息技术	14,179,289.02	24.54
非必需消费品	12,408,438.91	21.48
必需消费品	932,438.44	1.61
能源	3,884,655.22	6.72
保健	984,694.08	1.70
金融	13,419,534.80	23.23
工业	2,786,529.45	4.82
公用事业	1,824,742.73	3.16
合计	51,855,162.25	89.75

注：以上分类采用GICS行业分类标准。

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股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Taiwan Semicon. Manufacturing	台积电	BBG000BN2JD8	台湾证券交易所	台湾	160,000	3,338,167.82	5.78
2	Samsung Electronics Co Ltd	三星电子	BBG000BCY2S8	韩国证券交易所	韩国	395	3,089,131.99	5.35
3	ICICI Bank Ltd	-	BBG000DRM796	纽约证券交易所	美国	14,900	2,792,126.50	4.83
4	AIA Group Ltd	友邦保险	BBG0016XR1Q8	香港联合交易所	香港	68,600	1,982,547.65	3.43
5	China Resources Gas Group Ltd	华润燃气	BBG000DP29N2	香港联合交易所	香港	116,000	1,824,742.73	3.16
6	China Construction Bank Corp	中国建设银行	BBG000NW2S18	香港联合交易所	香港	371,000	1,756,103.98	3.04
7	CJ O Shopping Co Ltd	-	BBG000C43FR1	场外交易市场	韩国	865	1,733,512.99	3.00
8	Ezion Holdings Ltd	-	BBG000C1NPM8	新加坡证券交易所	新加坡	159,000	1,713,875.04	2.97
9	Meritz Fire & Marine Insurance	-	BBG000BD7P8	韩国证券交易所	韩国	20,400	1,610,571.87	2.79
10	Cheng Shin Rubber Industry Co	-	BBG000BD8KR6	台湾证券交易所	台湾	96,700	1,553,780.11	2.69

注：1.本基金对以上证券代码采用彭博BBG-ID。

2.上述表格“所属国家（地区）”均按照股票及存托凭证上市交易地点统计。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金本期投资的前十名证券中，无投资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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	371,748.29
3	应收股利	72,059.31
4	应收利息	762.19
5	应收申购款	1,846,715.94
6	其他应收款	416,773.12
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,708,058.85

5.10.4 报告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的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	63,091,597.37
本报告期基金总申购份额	19,264,705.03
减：本报告期基金总赎回份额	23,643,711.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	58,712,590.67

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本公司管理的该基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富兰克林国海亚洲机会（除日本）股票型证券投资基金设立的文件；

2、《富兰克林国海亚洲机会（除日本）股票型证券投资基金基金合同》；

3、《富兰克林国海亚洲机会（除日本）股票型证券投资基金招募说明书》；

4、《富兰克林国海亚洲机会（除日本）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。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站：www.ftsfund.com。

8.3 查阅方式

1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件。

2、登陆基金管理人网站 www.ftsfund.com 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

二〇一三年十月二十三日

富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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：二〇一三年十月二十三日

§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2013年10月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富潜力组合股票
基金主代码	450003
交易代码	450003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月22日
报告期末基金份额总额	3,697,697,769.23份
投资目标	注重基金资产长期增值，投资未来收益具有成长性和资产价值低估的上市公司股票，为投资者赚取长期稳定的资本增值。
投资策略	资产配置策略： 本基金采用“自下而上”的组合构建方法，从上市公司的具体发展前景和未来的盈利分析，到行业的发展趋势，再到宏观经济形势，确定大类资产的配置。 在运用了“自下而上”策略之后，根据市场环境的变化、市场出现的各种套利机会和未来的发展趋势判断，确定本基金资产配置最终的选择标准。 股票选择策略： 本基金将运用定性和定量方法，通过对上市公司的财务分析和增长潜力分析，挑选出其中股价下跌风险最低且上涨空间最大的股票构建具体的股票组合。 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。
业绩比较基准	85%×MSCI中国A股指数+10%×中债国债总指数（全价）+5%×同业存款息率
风险收益特征	本基金是一只主动型投资的股票型基金，属于基金类型中具有中高等级风险的基金品种，本基金的风险与预期收益都高于混合型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-104,788,024.00
2.本期利润	480,897,194.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.1264
4.期末基金资产净值	3,847,975,778.28
5.期末基金份额净值	1.0406

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（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	13.74%	1.23%	9.13%	1.17%	4.61%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2007年3月22日至2013年9月30日）