

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

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺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约定,于2014年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况等,但并不对其准确性、完整性及真实性负责。

2.1 基金基本情况
基金名称: 富兰克林国海策略回报混合
基金代码: 480101
基金运作方式: 契约型开放式
基金合同生效日期: 2013年8月21日

2.2 基金产品说明
本基金为主动型股票型基金,追求超越业绩比较基准的长期资本增值,在有效控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。
本基金主要投资于国内A股市场,投资于具有良好成长性的上市公司股票,同时适当参与可转债、股指期货、权证等金融衍生品投资,以分散投资风险,提高基金资产收益率。

2.3 基金管理人基本情况
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
基金管理人地址: 深圳市福田区福中三路100号新华保险大厦19楼

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 主要会计数据和财务指标
本报告期: 2013年12月31日
本报告期末: 2013年12月31日
本报告期初: 2013年9月30日

3.2 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率\*60%+中证500指数收益率\*40%
本基金业绩比较基准的选取依据: 本基金为主动型股票型基金,追求超越业绩比较基准的长期资本增值,因此选取沪深300指数和中证500指数作为业绩比较基准。

3.3 基金投资组合报告
3.3.1 基金资产组合情况
截至2013年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资: 48,291,437.50元,占基金资产净值的94.23%
债券投资: 0元,占基金资产净值的0.00%
货币市场工具: 2,766,562.50元,占基金资产净值的5.37%

3.3.2 基金行业配置情况
截至2013年12月31日,本基金行业配置如下:
信息技术: 15.23%
金融: 14.81%
工业: 13.73%
消费品: 10.28%

3.3.3 基金持仓集中度
截至2013年12月31日,本基金持仓集中度如下:
前十大重仓股: 占基金资产净值的54.12%
前十大重仓股名称: 万科A, 招商局A, 中国国航, 中国石化, 工商银行, 建设银行, 农业银行, 交通银行, 中信银行, 光大银行

3.3.4 基金流动性分析
截至2013年12月31日,本基金流动性分析如下:
基金资产净值: 50,998,000.00元
基金资产流动性: 良好

3.3.5 基金费用
截至2013年12月31日,本基金费用如下:
基金管理费: 1,839,272.24元
基金托管费: 318,663.02元
销售服务费: 1,619,043.01元

3.3.6 基金业绩评价
截至2013年12月31日,本基金业绩评价如下:
基金净值增长率: 15.23%
业绩比较基准收益率: 14.81%

3.3.7 基金管理人报告
基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司,秉承“诚信、专业、稳健、创新”的经营理念,为基金份额持有人提供优质的投资管理服务。

3.3.8 基金托管人报告
基金托管人中国农业银行股份有限公司,严格遵守基金合同约定,认真履行托管职责,确保基金资产的安全和完整。

3.3.9 会计师事务所报告
会计师事务所德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)对基金管理人提供的财务报表进行了审计,并出具了标准无保留意见的审计报告。

3.3.10 基金管理人内部控制制度
基金管理人建立了完善的内部控制制度,确保基金运作的合规性和安全性,防范和控制各类风险。

3.3.11 基金管理人承诺
基金管理人承诺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。

3.3.12 基金管理人声明
基金管理人声明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。

3.3.13 基金管理人其他事项
基金管理人其他事项: 无

富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金

2013年度报告摘要

2013年12月31日
在宏观经济和市场环境复杂多变的情况下,本基金管理人秉承“诚信、专业、稳健、创新”的经营理念,积极应对市场挑战,实现了基金资产的稳健增值。

7.4.1 2013年度主要财务指标
7.4.1.1 主要财务指标
7.4.1.2 主要财务指标
7.4.1.3 主要财务指标

7.4.2 2013年度主要财务指标
7.4.2.1 主要财务指标
7.4.2.2 主要财务指标
7.4.2.3 主要财务指标

7.4.3 2013年度主要财务指标
7.4.3.1 主要财务指标
7.4.3.2 主要财务指标
7.4.3.3 主要财务指标

7.4.4 2013年度主要财务指标
7.4.4.1 主要财务指标
7.4.4.2 主要财务指标
7.4.4.3 主要财务指标

7.4.5 2013年度主要财务指标
7.4.5.1 主要财务指标
7.4.5.2 主要财务指标
7.4.5.3 主要财务指标

7.4.6 2013年度主要财务指标
7.4.6.1 主要财务指标
7.4.6.2 主要财务指标
7.4.6.3 主要财务指标

7.4.7 2013年度主要财务指标
7.4.7.1 主要财务指标
7.4.7.2 主要财务指标
7.4.7.3 主要财务指标

7.4.8 2013年度主要财务指标
7.4.8.1 主要财务指标
7.4.8.2 主要财务指标
7.4.8.3 主要财务指标

7.4.9 2013年度主要财务指标
7.4.9.1 主要财务指标
7.4.9.2 主要财务指标
7.4.9.3 主要财务指标

7.4.10 2013年度主要财务指标
7.4.10.1 主要财务指标
7.4.10.2 主要财务指标
7.4.10.3 主要财务指标

7.4.11 2013年度主要财务指标
7.4.11.1 主要财务指标
7.4.11.2 主要财务指标
7.4.11.3 主要财务指标

7.4.12 2013年度主要财务指标
7.4.12.1 主要财务指标
7.4.12.2 主要财务指标
7.4.12.3 主要财务指标

7.4.13 2013年度主要财务指标
7.4.13.1 主要财务指标
7.4.13.2 主要财务指标
7.4.13.3 主要财务指标

7.4.14 2013年度主要财务指标
7.4.14.1 主要财务指标
7.4.14.2 主要财务指标
7.4.14.3 主要财务指标

7.4.15 2013年度主要财务指标
7.4.15.1 主要财务指标
7.4.15.2 主要财务指标
7.4.15.3 主要财务指标

7.4.16 2013年度主要财务指标
7.4.16.1 主要财务指标
7.4.16.2 主要财务指标
7.4.16.3 主要财务指标

7.4.17 2013年度主要财务指标
7.4.17.1 主要财务指标
7.4.17.2 主要财务指标
7.4.17.3 主要财务指标

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 名称, 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 25 holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例. Lists top 5 bond holdings.

国海富兰克林基金管理有限公司
二〇一四年三月三十一日