

富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一四年四月二十一日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年4月17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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告中财务资料截止于2014年3月31日止。

1.2 基金产品概况

基金简称	国海沪深300指数增强
基金代码	450008
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9月31日
报告期末基金份额总额	624,075,002.90

本基金采用指数增强投资策略,通过量化风险管理方法,控制投资组合与指数的构成和偏离,同时结合基本面分析,在控制跟踪误差的前提下,力争实现超越指数的投资收益,追求基金资产的长期增值。在正常市场环境下,本基金对业绩比较基准的年度跟踪误差率不超过2%。

投资目标
本基金采用指数增强投资策略,通过量化风险管理方法,控制投资组合与指数的构成和偏离,同时结合基本面分析,在控制跟踪误差的前提下,力争实现超越指数的投资收益,追求基金资产的长期增值。在正常市场环境下,本基金对业绩比较基准的年度跟踪误差率不超过2%。

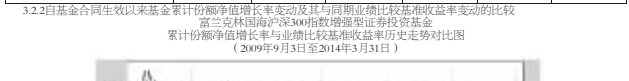
投资策略
本基金将在对宏观经济和资本市场运行趋势进行判断的基础上,对标的指数成份股进行分析和筛选,结合基本面分析,在控制跟踪误差的前提下,力争实现超越指数的投资收益,追求基金资产的长期增值。在正常市场环境下,本基金对业绩比较基准的年度跟踪误差率不超过2%。

3.1 主要财务指标和基金净值表现

1.本期已实现收益	-10,522,360.05
2.本期利润	-64,149,751.22
3.本期基金份额净值增长率	-10.07%
4.期末基金份额净值	999.2993
5.期末基金资产净值	624,075,002.90
6.期末基金份额持有人数	8,814

3.2 基金业绩比较基准

阶段	净值增长率	业绩比较基准	超额收益率	①-③	②-④
过去三个月	-7.79%	1.12%	-7.48%	1.13%	-6.01%



4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张明	基金经理	2009-9-3	2014-2-21	10年	复旦大学, CFA, 曾任国海证券研究员, 国海基金基金经理, 国海基金基金经理, 国海基金基金经理。

4.2 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.3 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.4 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.5 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.6 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.7 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.8 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.9 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.10 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.11 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.12 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.13 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.14 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.15 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.16 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.17 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.18 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.19 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.20 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一四年四月二十一日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年4月17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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告中财务资料截止于2014年3月31日止。

1.2 基金产品概况

基金简称	国海中小盘股票
基金代码	450009
交易代码	450008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月23日
报告期末基金份额总额	1,092,110,879.18

本基金投资于具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票,力求在有效控制风险的前提下,获得基金资产的长期增值。

投资目标
本基金投资于具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票,力求在有效控制风险的前提下,获得基金资产的长期增值。

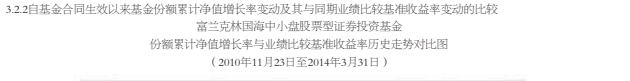
投资策略
本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

3.1 主要财务指标和基金净值表现

1.本期已实现收益	-10,522,360.05
2.本期利润	-64,149,751.22
3.本期基金份额净值增长率	-10.07%
4.期末基金份额净值	999.2993
5.期末基金资产净值	624,075,002.90
6.期末基金份额持有人数	8,814

3.2 基金业绩比较基准

阶段	净值增长率	业绩比较基准	超额收益率	①-③	②-④
过去三个月	-7.79%	1.12%	-7.48%	1.13%	-6.01%



4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张明	基金经理	2010-11-23	-	10年	复旦大学, CFA, 曾任国海证券研究员, 国海基金基金经理, 国海基金基金经理, 国海基金基金经理。

4.2 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.3 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.4 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.5 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.6 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.7 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.8 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.9 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.10 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.11 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.12 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.13 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.14 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.15 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.16 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.17 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.18 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.19 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

4.20 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

5.1 报告期末按行业分类的股权投资投资组合

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	43,700.00	0.00
B	医药	-	-
C	制造业	774,971,798.15	78.04
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	5,404,846.72	0.54
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	250,214.00	1.21
H	住宿和餐饮业	12,051,221.00	1.21
I	信息技术、软件和信息技术服务业	29,807,215.54	2.97
J	金融业	57,734,354.32	5.81
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	16,623,703.25	1.67
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育、体育和娱乐业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		896,336,898.08	90.27

5.2 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	002034	洋河股份	1,683,977	82,834,828.63	8.34
2	000568	泸州老窖	4,013,627	68,930,805.51	6.93
3	002099	海螺水泥	10,847,808	66,930,975.36	6.74
4	000858	五粮液	3,758,647	62,656,645.49	6.31
5	002488	长园股份	3,246,220	38,277,400.60	3.90
6	601179	东信证券	999,883	35,565,648.28	3.59
8	300257	华信股份	999,981	33,969,355.71	3.47
9	600559	老白干酒	1,576,471	33,842,714.62	3.41
10	002422	科伦药业	778,478	31,372,640.33	3.16

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债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	合计	18,170,000.00	1.83

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资产支持证券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国开行债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	合计	18,170,000.00	1.83

5.5 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权证投资明细

序号	权证品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	122808	1162元债	200,000	18,174,000.00	1.83
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.6 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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国开行债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	合计	18,170,000.00	1.83

5.7 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权证投资明细

序号	权证品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	122808	1162元债	200,000	18,174,000.00	1.83
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.8 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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国开行债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	合计	18,170,000.00	1.83

5.9 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权证投资明细

序号	权证品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	122808	1162元债	200,000	18,174,000.00	1.83
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国开行债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	合计	18,170,000.00	1.83

6.1 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.2 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.3 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.4 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.5 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.6 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.7 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.8 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.9 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.10 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.11 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.12 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.13 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.14 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.15 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.16 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.17 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

6.18 基金管理人及基金托管人简介
基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司

富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一四年四月二十一日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年4月17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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告中财务资料截止于2014年3月31日止。

1.2 基金产品概况

基金简称	国海成长动力股票
基金代码	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7月21日
报告期末基金份额总额	137,708,814.79

本基金投资于具有良好成长性的股票,追求基金资产的长期增值。在正常市场环境下,本基金对业绩比较基准的年度跟踪误差率不超过2%。

投资目标
本基金投资于具有良好成长性的股票,追求基金资产的长期增值。在正常市场环境下,本基金对业绩比较基准的年度跟踪误差率不超过2%。

投资策略
本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

3.1 主要财务指标和基金净值表现

1.本期已实现收益	-1,223,459.66
2.本期利润	-9,821,168.98
3.本期基金份额净值增长率	-10.07%
4.期末基金份额净值	134,540,465.10
5.期末基金资产净值	134,540,465.