



Disclosure 信息披露

2014年7月18日 星期五
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B153

富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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: 二〇一四年七月十八日

§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7月16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,也不保证基金资产净值不受损失。

基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中所列数据截至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富强化收益债券
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2009年12月24日
报告期末基金总份额	25,073,942.23份
投资目标	通过主动的资产管理,在严格控制风险、保证资产充分流动性的基础上,力求为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	固定收益品种投资策略: 本基金采取积极主动的投资策略,以中长期利率趋势分析为主,结合经济周期、宏观经济运行中的价格指标、资金供求分析、货币政策、财政政策研判及收益率曲线分析,在充分流动性和风险控制的前提下,实施积极的债券投资组合管理。 动态资产配置策略: 本基金根据市场的动态变化,采取多种形式的策略,获取超额收益。 股票投资策略: 本基金主要采用“自下而上”的选股策略,将发现的优质股票和成长性好的公司深入研究相结合,选取具有良好发展前景、估值合理和价格具有吸引力的上市公司股票。
业绩比较基准	中债综合指数(货币)
风险收益特征	本基金属于固定收益类基金,属于证券投资基金中较低风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于混合型基金、高于货币型基金。
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

国富强化收益债券A 国富强化收益债券C

国富强化收益债券A 国富强化收益债券C

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期末(2014年6月30日)	报告期末(2014年6月30日)
1.本期已实现收益	2,822,812.20	279,271.36
2.本期利润	7,596,259.74	755,713.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.0009	0.0009
4.期末基金份额净值	258,316.8021	26,560,587.48
5.期末基金资产净值	1,124.7	1,124.8

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可能低于所列收益水平。
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公允价值变动收益。
3.本基金净值表现
4.本基金净值表现
5.本基金净值表现

3.2 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.3 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.4 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.5 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.6 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.7 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.8 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.9 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.10 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.11 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.12 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.13 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.14 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.15 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.16 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.17 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.18 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.19 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.20 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.21 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.22 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.23 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.24 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.25 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.26 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.27 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.28 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.29 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.30 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.31 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.32 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.33 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.34 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.35 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

3.36 基金合同生效以来基金资产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

国富强化收益债券A

国富强化收益债券C

5 买入返售金融资产 1,600,000.00 0.42
其中:买入返售金融资产 1,600,000.00 0.42
6 银行存款和拆出资金 4,204,045.73 1.09
7 其他资产 7,515,695.10 1.96
8 合计 38,434,362.16 100.00

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	9,449,986.13	3.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	金融业	6,100.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,205,080.00	0.42
J	房地产业	2,860,416.00	1.00
K	租赁业	-	-
L	批发和零售业	-	-
M	住宿和餐饮业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	建筑业、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	合计	13,521,582.13	4.71

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	000202	中航光电	421,900	4,003,831.00	1.40
2	600030	中信证券	249,600	2,860,416.00	1.00
3	002311	南方集团	245,813	2,706,401.13	0.94
4	601965	中国汽研	160,000	1,979,200.00	0.69
5	300299	富春通信	94,000	1,205,080.00	0.42
6	600841	纬达光电	28,200	760,354.00	0.27
7	072727	一心堂	500	6,100.00	0.00
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

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	国债债券	1,318,000.00	0.46
2	央行票据	-	-
3	金融债	37,238,400.00	12.98
4	其中:政策性金融债	37,238,400.00	12.98
5	企业债	224,459,269.60	78.24
6	企业短期融资券	36,123,000.00	12.59
7	中期票据	30,049,000.00	10.47
8	其他	30,049,000.00	9.90
9	合计	357,933,039.20	124.65

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十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122685	12年城投	230,240	23,714,720.00	8.27
2	140402	14年城投	200,000	20,700,000.00	7.35
3	1202535	12年MTN1	200,000	20,134,000.00	7.02
4	124078	12年城投	195,010	19,783,764.50	6.90
5	124303	13年城投	200,100	19,409,700.00	6.77

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

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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金报告期内未持有股票,无报告期内发行主体被监管部门立案调查,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或处罚的情况。

5.11.2 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投资比例之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

5.11.4 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	8,858,688.00	3.09
2	110008	国电转债	7,526,072.00	2.63
3	113005	平安转债	6,195,560.00	2.16
4	113002	工行转债	2,803,640.00	0.98
5	125089	深证转债	2,085,060.00	0.73
6	113003	重工转债	1,135,600.00	0.40

5.11.5 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.6 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.7 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.8 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.9 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.10 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.11 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.12 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.13 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.14 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.15 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.16 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.17 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.18 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.19 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.20 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.21 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.22 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.23 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.24 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.25 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.26 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.27 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

5.11.28 报告期末持有的资产支持证券明细

序号	代码	名称	摊余成本/公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	减值准备计提说明
1	000727	一心堂	6,100.00	0.00	新债上市

富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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: 二〇一四年七月十八日

§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7月16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,也不保证基金资产净值不受损失。

基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中所列数据截至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富深化价值股票
基金代码	450004
交易代码	450004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月3日
报告期末基金总份额	510,913,889.96份
投资策略	本基金以沪深300指数为基准,采用积极的投资策略,在严格控制风险的前提下,追求超越基准的长期资本增值。本基金主要采用“自下而上”的选股策略,将发现的优质股票和成长性好的公司深入研究相结合,选取具有良好发展前景、估值合理和价格具有吸引力的上市公司股票。
业绩比较基准	85%×沪深300指数+15%×中国国债指数(货币)
风险收益特征	本基金为价值型股票证券投资基金,具有较高风险和较高收益的特征,属于证券投资基金