

富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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:中国农业银行股份有限公司 报告送出日期:2015年10月26日

81 重要提示 基金管理人的董事会及董事对本报告期内所载资料内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任...

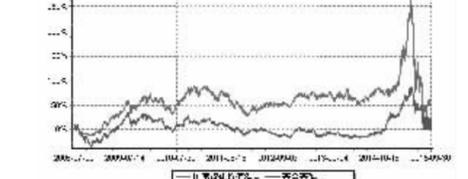
82 基金产品概况 基金名称:富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金 基金代码:450005 基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日期:2008年7月24日

注:根据2014年8月8日起施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于不同基金类别所适用投资比例的规定...

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2015年7月1日至2015年9月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期公允价值变动收益, etc.

3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金的基金合同生效日为2008年7月3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。

84 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 本基金的基金经理任期, 证券从业年限. Rows include 王宇奇.

注:表中“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期,其中,首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。

4.2 基金经理(或基金经理小组)简介 报告期内,本公司在研究投行业务公平性、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》...

4.3 公平交易专项说明 报告期内,公司在研究投行业务公平性、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》...

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现 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《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金合同》的规定...

4.5 报告期内基金净值表现 2015年三季度,基金净值下跌33.41%,业绩基准下跌24.22%。基金净值增长率9.19个百分点,波动的大幅度弱于业绩基准。

4.6 报告期内基金持有人户数或基金份额净值得变动情况 无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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(%)

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

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五名债券投资明细

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资产支持证券投资明细

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五名贵金属投资明细

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

5.8 本报告期末基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 本报告期末基金投资的国债期货交易情况说明

5.10 本报告期末基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 本报告本期投资的前十名证券中,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、处罚的证券。

5.11.1 本基金投资的前十名股票中,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、处罚的证券。

5.11.2 本基金投资的前十名债券中,无投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

86 开放式基金份额变动 单位:人民币元

Table with 2 columns: 基金份额, 期初, 期末. Rows include 报告期初基金份额总额, 报告期基金总申购份额, etc.

注:本基金管理人持有本基金份额变动情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期初持有本基金份额 10,377,316.51

报告期末持有本基金份额 10,377,316.51

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期末持有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

81 备查文件目录 1. 中国证监会核准富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金设立的文件;

2. 《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金合同》;

3. 《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金托管协议》;

4. 富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金招募说明书;

5. 中国证监会要求的其他文件。

82 存放地点 基金管理人和本基金托管人的住所并载于基金管理人网站:www.fundam.com。

83 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. 投资者登录基金管理人网站www.fundam.com查阅。

富兰克林国海基金管理有限公司 二〇一五年十月二十六日

富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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:中国农业银行股份有限公司 报告送出日期:2015年10月26日

81 重要提示 基金管理人的董事会及董事对本报告期内所载资料内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任...

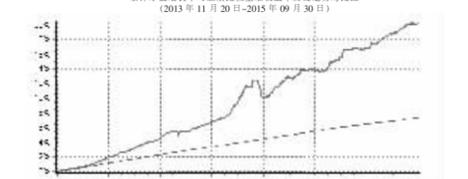
82 基金产品概况 基金名称:富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金 基金代码:000011 基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日期:2013年11月20日

注:根据2014年8月8日起施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于不同基金类别所适用投资比例的规定...

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2015年7月1日至2015年9月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期公允价值变动收益, etc.

3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金的基金合同生效日为2013年11月20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。

84 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 本基金的基金经理任期, 证券从业年限. Rows include 胡冰燕.

注:表中“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期,其中,首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。

4.2 基金经理(或基金经理小组)简介 报告期内,本公司在研究投行业务公平性、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》...

4.3 公平交易专项说明 报告期内,公司在研究投行业务公平性、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》...

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现 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《富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金合同》的规定...

4.5 报告期内基金净值表现 2015年三季度,基金净值下跌1.14%,业绩基准下跌1.14%。基金净值增长率0.86个百分点,波动的大幅度弱于业绩基准。

4.6 报告期内基金持有人户数或基金份额净值得变动情况 无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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(%)

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

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五名债券投资明细

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资产支持证券投资明细

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五名贵金属投资明细

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

5.8 本报告期末基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 本报告期末基金投资的国债期货交易情况说明

5.10 本报告期末基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 本报告本期投资的前十名证券中,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、处罚的证券。

5.11.1 本基金投资的前十名股票中,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、处罚的证券。

5.11.2 本基金投资的前十名债券中,无投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

86 开放式基金份额变动 单位:份

Table with 2 columns: 基金份额, 期初, 期末. Rows include 报告期初基金份额总额, 报告期基金总申购份额, etc.

注:本基金管理人持有本基金份额变动情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期初持有本基金份额 256,801,167.76

报告期末持有本基金份额 256,801,167.76

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期末持有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

81 备查文件目录 1. 中国证监会核准富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金设立的文件;

2. 《富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金合同》;

3. 《富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金托管协议》;

4. 富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金招募说明书;

5. 中国证监会要求的其他文件。

82 存放地点 基金管理人和本基金托管人的住所并载于基金管理人网站:www.fundam.com。

83 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. 投资者登录基金管理人网站www.fundam.com查阅。

富兰克林国海基金管理有限公司 二〇一五年十月二十六日

富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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:中国农业银行股份有限公司 报告送出日期:2015年10月26日

81 重要提示 基金管理人的董事会及董事对本报告期内所载资料内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任...

82 基金产品概况 基金名称:富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金 基金代码:000050 基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日期:2013年11月20日

注:根据2014年8月8日起施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于不同基金类别所适用投资比例的规定...

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2015年7月1日至2015年9月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期公允价值变动收益, etc.

3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金的基金合同生效日为2013年11月20日,并于2013年12月18日推出C类收费模式,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。

84 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 本基金的基金经理任期, 证券从业年限. Rows include 胡冰燕.

注:表中“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期,其中,首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。

4.2 基金经理(或基金经理小组)简介 报告期内,本公司在研究投行业务公平性、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》...

4.3 公平交易专项说明 报告期内,公司在研究投行业务公平性、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》...

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现 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《富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金合同》的规定...

4.5 报告期内基金净值表现 2015年三季度,基金净值下跌0.65%,业绩基准下跌0.65%。基金净值增长率1.96个百分点,波动的大幅度弱于业绩基准。

4.6 报告期内基金持有人户数或基金份额净值得变动情况 无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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(%)

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

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五名债券投资明细

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资产支持证券投资明细

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五名贵金属投资明细

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

5.8 本报告期末基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 本报告期末基金投资的国债期货交易情况说明

5.10 本报告期末基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 本报告本期投资的前十名证券中,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、处罚的证券。

5.11.1 本基金投资的前十名股票中,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、处罚的证券。

5.11.2 本基金投资的前十名债券中,无投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

86 开放式基金份额变动 单位:人民币元

Table with 2 columns: 基金份额, 期初, 期末. Rows include 报告期初基金份额总额, 报告期基金总申购份额, etc.

注:本基金管理人持有本基金份额变动情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期初持有本基金份额 386,889,031.18

报告期末持有本基金份额 386,889,031.18

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期末持有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

81 备查文件目录 1. 中国证监会核准富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金设立的文件;

2. 《富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金合同》;

3. 《富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金托管协议》;

4. 富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金招募说明书;

5. 中国证监会要求的其他文件。

82 存放地点 基金管理人和本基金托管人的住所并载于基金管理人网站:www.fundam.com。

83 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. 投资者登录基金管理人网站www.fundam.com查阅。

富兰克林国海基金管理有限公司 二〇一五年十月二十六日

81 重要提示 基金管理人的董事会及董事对本报告期内所载资料内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任...

82 基金产品概况 基金名称:富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金 基金代码:000011 基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日期:2013年11月20日

注:根据2014年8月8日起施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于不同基金类别所适用投资比例的规定...

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2015年7月1日至2015年9月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期公允价值变动收益, etc.

3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金的基金合同生效日为2013年11月20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。

84 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 本基金的基金经理任期, 证券从业年限. Rows include 胡冰燕.

注:表中“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期,其中,首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。

4.2 基金经理(或基金经理小组)简介 报告期内,本公司在研究投行业务公平性、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》...

4.3 公平交易专项说明 报告期内,公司在研究投行业务公平性、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》...

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现 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《富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金合同》的规定...

4.5 报告期内基金净值表现 2015年三季度,基金净值下跌1.14%,业绩基准下跌1.14%。基金净值增长率0.86个百分点,波动的大幅度弱于业绩基准。

4.6 报告期内基金持有人户数或基金份额净值得变动情况 无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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(%)

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

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五名债券投资明细

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资产支持证券投资明细

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五名贵金属投资明细

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

5.8 本报告期末基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 本报告期末基金投资的国债期货交易情况说明

5.10 本报告期末基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 本报告本期投资的前十名证券中,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、处罚的证券。

5.11.1 本基金投资的前十名股票中,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、处罚的证券。

5.11.2 本基金投资的前十名债券中,无投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

86 开放式基金份额变动 单位:份

Table with 2 columns: 基金份额, 期初, 期末. Rows include 报告期初基金份额总额, 报告期基金总申购份额, etc.

注:本基金管理人持有本基金份额变动情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期初持有本基金份额 256,801,167.76

报告期末持有本基金份额 256,801,167.76

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期末持有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

81 备查文件目录 1. 中国证监会核准富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金设立的文件;

2. 《富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金合同》;

3. 《富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金托管协议》;

4. 富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金招募说明书;

5. 中国证监会要求的其他文件。

82 存放地点 基金管理人和本基金托管人的住所并载于基金管理人网站:www.fundam.com。

83 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. 投资者登录基金管理人网站www.fundam.com查阅。

富兰克林国海基金管理有限公司 二〇一五年十月二十六日