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
送出日期:2016年3月28日

富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
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2016年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国富成长动力混合
基金主代码	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3月25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
报告期末基金份额总额	89,445,764.26
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于具有内生性增长和外延式扩张的积极成长型企业,在合理控制风险的基础上,力求实现基金资产的长期增值。
投资策略	大类资产配置: 本基金管理人将以大类资产的预期收益率、风险水平和它们之间的相关性为出发点,对于可能影响资产预期风险、收益率和相关性的因素进行综合分析和动态跟踪,据此制定本基金在股票、债券和货币市场工具等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,并进行定期或不定期的调整,以达到投资目标的目的。 股票选择策略: 本基金在适度的大类资产配置的基础上运用"精选成长股"的股票投资策略。 本基金股票的选择分为三个层次:首先,成长型筛选是针对企业历史财务指标,应用数量模型筛选股票,选同研究员实地调研推荐的部分股票,建立备选股票库;其次,对备选股票库的股票应用估值模型进行价值评估;最后,对投资目标的商业模式进行分析,找出未来成长的动力,进行整体优化,选择股票投资组合。 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。债券投资组合的回报主要来自于组合的久期管理,识别收益率曲线中价值低估的部分以及各类债券中价值低估的种类。 权证投资策略: 本基金不直接从二级市场买入权证,可持有股票派发或可分离交易债券所分离的权证。
业绩比较基准	85%×沪深300指数+10%×中债国债总指数(全价)+5%×同业存款利率
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高风险收益特征的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国海富兰克林基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	王永民
	联系电话	021-3855 5555	010-66594896
	电子邮箱	service@ftsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680和021-38789555	95566
传真		021-6888 3050	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	110,051,957.21	16,931,510.79	23,533,369.10
本期利润	89,661,617.95	49,064,909.32	16,722,469.61
加权平均基金份额本期利润	0.5809	0.3832	0.0787
本期加权平均净值利润率	31.95%	41.14%	8.51%
本期基金份额净值增长率	25.62%	51.89%	0.55%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	64,601,198.38	36,968,028.91	-13,932,291.10
期末可供分配基金份额利润	0.7222	0.3710	-0.0974
期末基金资产净值	154,046,962.64	136,616,053.34	129,125,135.82
期末基金份额净值	1.7222	1.3710	0.9026
3.1.3 累计期末指标	2015年末	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	102.33%	61.07%	6.04%

注:
1.上述财务指标采用的计算公式,详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则—第1号《主要财务指标的计算及披露》。
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. 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。
4. 上述基金业绩指标不包括持有人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。

3.2 基金净值表现

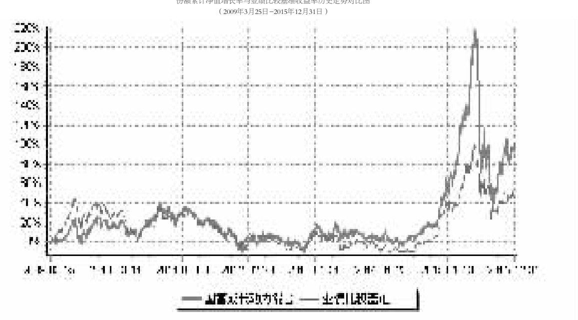
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	32.54%	2.47%	14.22%	1.42%	18.32%	1.05%
过去六个月	-11.39%	3.30%	-13.49%	2.28%	2.10%	1.02%
过去一年	25.62%	2.98%	6.25%	2.11%	19.37%	0.87%
过去三年	91.85%	2.03%	42.39%	1.52%	49.46%	0.51%
过去五年	56.33%	1.76%	19.61%	1.37%	36.72%	0.39%
自基金合同生效日起至今	102.33%	1.69%	47.84%	1.40%	54.49%	0.29%

注:根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定,本基金的业绩比较基准=沪深300指数×85%+中债国债总指数(全价)×10%+同业存款利率×5%。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深300指数,债券投资部分的业绩比较基准采用中债国债总指数(全价),两个指数均具有较强的代表性。
本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理,日收益率(Benchmarkt)按下列公式计算:
Benchmarkt = 85% ×(沪深300指数t/沪深300指数t-1-1) +10%×(中债国债总指数(全价)t /中债国债总指数(全价)t-1-1) + 5% ×同业存款利率/360,其中,t=1,2,3,…, T,T表示时间截止日。

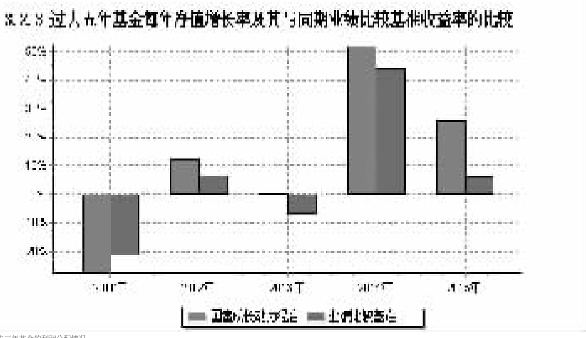
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年3月25日-2015年12月31日)



注:本基金合同生效日为2009年3月25日。本基金在6个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	-	-	-	-	
2014年	-	-	-	-	
2013年	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国海富兰克林基金管理有限公司成立于2004年11月,由国海证券股份有限公司和富兰克林邓普顿投资集团全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建,目前公司注册资本2.2亿元人民币,国海证券股份有限公司持有51%的股份,邓普顿国际股份有限公司持有49%的股份。
国海证券股份有限公司是国内A股市场第16家上市券商,是拥有全业务牌照、营业网点遍布中国主要城市的全国性综合类证券公司。富兰克林邓普顿投资集团是世界知名基金管理公司,在全球市场上有超过65年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿投资集团享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系,借助国海证券股份有限公司的综合业务优势,力争成为国内一流的基金管理公司。
本公司具有丰富的管理基金经验,自2005年6月第一只基金成立开始,截至本报告期末,本公司已经成功管理了23只基金产品(包含A、B、C类债券基金,A、B类货币市场基金)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
卫学海	国富深化价值混合基金及国富成长动力混合基金的基金经理	2015年5月25日	-	12年	卫学海先生,复旦大学工程硕士,历任中国人保资产管理有限公司高级投资经理,长城证券有限责任公司高级投资经理,光大证券资产管理有限公司投资经理,截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富深化价值混合基金及国富成长动力混合基金的基金经理。
杜飞	国富成长动力混合基金的基金经理兼研究员	2015年7月17日	-	4年	杜飞先生,上海财经大学经济学硕士,历任国海富兰克林基金管理有限公司研究助理、研究员,国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金及国富弹性市值混合基金的基金经理助理,截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司研究员、国富成长动力混合基金的基金经理兼研究员。
刘伟亭	公司行业研究主管、国富成长动力混合基金的基金经理	2011年7月27日	2015年5月25日	10年	刘伟亭先生,CFA,复旦大学经济学硕士,历任长江巴黎百富勤证券有限责任公司企业融资部助理经理、资本市场部业务主任和首席销售交易员;国海富兰克林基金管理有限公司研究员、高级研究员、行业研究主管,国富弹性市值混合基金和国富深化价值混合基金的基金经理助理,国富成长动力混合基金的基金经理。

注:
1. 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。
2. 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《富兰克林国海成长动力混合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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司建立了《公平交易管理制度》,确保公司旗下投资组合能够得到公平对待,避免各种投资组合之间的利益输送行为。我们主要从如下几个方面对公平交易进行控制:
1.在研究信息共享方面,投资研究等部门通过定期的例会沟通机制,就相关议题进行讨论;公司建立了统一的研究平台,研究报告信息通过研究平台进行发布。
2.建立投资对象备选库,股票及债券的入库需要由研究报告支持作为依据,并经过相关领导审批;建立研究报告的定期更新机制。
3.在投资决策方面,公司在各类资产管理业务之间建立防火墙,确保业务隔离及人员隔离,同时各投资组合经理投资决策保持独立。
4.公司对所有投资组合的交易指令实行集中交易,公司在交易系统中设置公平交易功能,按照时间优先、价格优先的原则执行各账户所有指令;公司建立和完善了对债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易分配制度,以确保相关投资组合能够得到公平对待。
5.公司建立了《同日反向交易管理办法》,通过事前审批来对反向交易进行事前控制。公司每季度对不同时间窗下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。
6.公司定期对公平交易执行情况进行监察稽核,并在监察稽核定期报告中做专项说明。公司也会在各投资组合的定期报告中,披露公平交易制度执行情况及异常交易行为专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内公司严格执行《公平交易管理制度》,明确了公平交易的原则和目标,制订了实现公平交易的具体措施,并在技术上按照公平交易原则实现了严格的交易公平分配。
报告期末,公司共管理了二十三只公募基金及十四只专户产品,统计所有投资组合分投资类别(股票、债券)过去连续4个季度内在不同时间窗口(T=1,T=3和T=5)存在同向交易价差的样本,并对差价率均值、交易价格占优比率、t值、贡献率等指标进行分析。报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司按照《异常交易监控与报告制度》,系统划分了异常交易的类型、异常交易的界定标准、异常交易的识别程序,制订了异常交易的监控办法,并规范了异常交易的分析、报告制度。
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的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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年,本基金全年基本集中配置在中小盘成长股上,此类公司外延内生并举实现业绩增长,成长性突出,符合中国经济转型方向,为市场所追捧。2015年一季度,政府提出"互联网+战略",明确了中国经济转型的一个重要方向,市场热点迅速从2014年四季度大盘蓝筹股切换到计算机、传媒等中小创板块,并一直延续到2015年5月份。本基金随之及时调仓,捕捉到了本轮行情。2015年上半年的牛市背后是央行利率下行背景下的资金向权益资产配置转移,而两融和杠杆资金入市加速了行情的快速发展。6月份A股估值出现泡沫,存在回调需要,而去杠杆的实施使回调的速度加快,幅度加大,市场一度出现流动性危机。本基金在市场调整期间仓位下调不够及时,持仓结构上没有及时转向估值较低的御性好的金融蓝筹股,净值出现较大回撤。进入四季度,在监管机构出台限制产业资本减持规则和政府出资救市的背景下,A股进入温室行情,本基金及时调高仓位,重仓成长股,把握住了四季度反弹行情。
在利率下行的背景下,市场资金向权益类资产配置,2015年整体呈现人造牛市格局,而国内庞大的高杠杆资金密集入市是A股史上第一次出现,挤泡沫的力度和幅度均超出过往历史,也给我们的操作带来了一定的难度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年,国富成长动力上涨25.62%,同期业绩比较基准上涨6.25%,基金跑赢基准19.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年,我们认为A股市场将进入"温情时代",宽幅震荡,需把握深蹲起跳行情。总体来看,2016年国内经济将呈现L型底部,流动性还有释放空间,两大重要变量是美元加息频率和产业资本减持规模。我们比较担忧美国加息预期将诱发全球资产在上半年先出现一轮下跌,不仅是股市,也包括外汇、商品期货市场,而加息频率和力度取决于美国经济的实际情况。此外在蒙代尔不可能三角模型下,美国加息对国内后续的流动性操作也存在一定抑制作用。产业资本减持在国内监管部门窗口指导的建议下,有望呈现稳步梯次进行的情况。最后国内注册制的推行进度和A股是否可以加入MSCI权重股也将是2016年A股市场的重要事件。
我们认为,2016年国内最大红利是改革红利。不破不立,对传统产业实施供给侧改革,对新兴产业实施重点扶持,预计中国经济在经历阵痛后将逐渐走出L型底部。基于以上分析,我们认为2016年投资应紧抓供给侧改革下的周期性行业投资机会和深挖跌出机会的新兴产业成长股。操作策略上,力争做到仓位灵活机动,把握市场的重要阶段投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程,按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会(简称"估值委员会"),并已制订了《公允价值管理办法》。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务,确保基金估值的公允、合理,保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由总经理或其任命者负责,成员包括投研、风险控制、监察稽核、交易、基金核算方面的部门主管,相关人员均具有丰富的证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末,根据本基金基金合同和相关法律法规的规定,本基金无应分配但尚未实施分配的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

会计师出具了无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	11,153,015.84	7,397,644.43
结算备付金	2,975,676.93	657,234.75
存出保证金	460,096.77	51,069.88
交易性金融资产	123,157,990.76	130,507,718.75
其中:股票投资	123,157,990.76	130,507,718.75
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	19,029,254.31	16,672.76
应收利息	4,047.08	1,723.82
应收股利	-	-
应收申购款	5,293.01	683,242.70
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	156,785,374.70	139,315,307.09
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	409,263.77	-
应付赎回款	290,441.05	1,788,424.16
应付管理人报酬	186,395.99	156,634.39
应付托管费	31,066.02	26,105.69
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,460,321.59	362,706.61
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	360,923.64	365,382.90
负债合计	2,738,412.06	2,699,253.75
所有者权益:		
实收基金	89,445,764.26	99,648,024.43
未分配利润	64,601,198.38	36,968,028.91
所有者权益合计	154,046,962.64	136,616,053.34
负债和所有者权益总计	156,785,374.70	139,315,307.09

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.7222元,基金份额总额89,445,764.26份。

7.2 利润表

会计主体:富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	102,895,837.36	52,830,081.58
1.利息收入	235,669.83	66,143.22
其中:存款利息收入	235,669.83	63,354.33
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	2,788.89
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	121,743,871.59	20,612,576.21
其中:股票投资收益	120,771,039.14	19,676,344.14
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	972,832.45	936,232.07
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-20,390,339.26	32,133,398.53
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,306,635.20	17,963.62
减:二、费用	13,234,219.41	3,765,172.26
1.管理人报酬	4,158,200.78	1,791,343.98
2.托管费	693,033.52	298,557.29
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	7,975,647.80	1,288,413.19
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	407,337.31	386,857.80
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	89,661,617.95	49,064,909.32
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	89,661,617.95	49,064,909.32

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	99,648,024.43	36,968,028.91	136,616,053.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	89,661,617.95	89,661,617.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-10,202,260.17	-62,028,448.48	-72,230,708.65
其中:1.基金申购款	495,870,689.57	407,317,219.68	903,187,909.25
2.基金赎回款	-506,072,949.74	-469,345,668.16	-975,418,617.90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	89,445,764.26	64,601,198.38	154,046,962.64
项 目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	143,057,426.92	-13,932,291.10	129,125,135.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	49,064,909.32	49,064,909.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-43,409,402.49	1,835,410.69	-41,573,991.80
其中:1.基金申购款	30,122,715.43	2,286,407.41	32,409,122.84
2.基金赎回款	-73,532,117.92	-450,996.72	-73,983,114.64
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	99,648,024.43	36,968,028.91	136,616,053.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

吴显玲	胡昕彦	龚宇虹
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金(原富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金,以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2009]第40号《关于核准富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金募集的批复》核准,由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,109,462,046.52元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第39号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金基金合同》于2009年3月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,109,598,820.51份基金份额,其中认购资金利息折合136,773.99份基金份额。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。
根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金于2015年8月8日公告后更名为富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%-95%,债券投资占基金资产的比例范围为0%-40%,权证投资占基金资产净值的比例范围为0%-3%,现金以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:85% × 沪深300指数 + 10% × 中债国债总指数(全价) + 5% × 同业存款利率。
本财务报表由本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于2016年3月23日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:
(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。
(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。
(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金销售机构
国海证券股份有限公司("国海证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
邓普顿国际股份有限公司(Templeton International, Inc.)	基金管理人的股东
国海富兰克林资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国海证券	-	-	65,899,301.60	7.85%

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国海证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国海证券	58,314.26	7.73%	13,005.75	3.59%

注:
1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,158,200.78	1,791,343.98
其中:支付销售机构的客户维护费	778,185.44	187,916.83

注:支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	693,033.52	298,557.29

注:支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值 ×0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
基金合同生效日(2009年3月25日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	14,866,686.49	14,866,686.49
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	14,866,686.49	-
期末持有的基金份额	-	14,866,686.49
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	14.92%

注:基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

1.本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
2.本报告期末和上年度末(2014年12月31日)除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	11,153,015.84	196,691.49	7,397,644.43	57,670.64

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
002612	朗姿股份	2015-12-22	重大事项停牌	75.46	-	-	51,500	2,860,981.00	3,886,190.00

注:本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:
第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 119,271,800.76元,属于第二层次的余额为3,886,190.00 元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次的余额为121,900,800.75元,属于第二层次的余额为8,606,918.00元,无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	123,157,990.76	78.55
	其中:股票	123,157,990.76	78.55
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	14,128,692.77	9.01
7	其他各项资产	19,498,691.17	12.44
8	合计	156,785,374.70	100.00

注:本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

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	57,707,833.35	37.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,443,582.00	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	6,488,202.00	4.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,468,487.37	23.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	15,568,715.90	10.11
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,901,517.14	2.53
R	文化、体育和娱乐业	1,579,653.00	1.03
S	综合	-	-
	合计	123,157,990.76	79.95

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002368	太极股份	223,019	14,964,574.90	9.71
2	000070	特发信息	264,863	8,499,453.67	5.52
3	002113	天润控股	197,267	7,831,499.90	5.08
4	002214	大立科技	489,558	7,774,181.04	5.05
5	300160	秀强股份	159,800	6,399,990.00	4.15
6	002268	卫 士 通	106,853	6,006,207.13	3.90
7	300367	东方网力	79,589	5,547,353.30	3.60
8	600305	恒顺醋业	185,800	4,769,486.00	3.10
9	600745	中茵股份	107,700	4,413,546.00	2.87
10	002612	朗姿股份	51,500	3,886,190.00	2.52

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600048	保利地产	66,745,861.14	48.86
2	600079	人福医药	57,819,790.58	42.32
3	601788	光大证券	47,481,037.84	34.76
4	300168	万达信息	43,823,269.67	32.08
5	300010	立思辰	40,042,753.98	29.31
6	601555	东吴证券	39,896,702.29	29.20
7	601818	光大银行	35,047,752.00	25.65
8	600845	宝信软件	34,720,210.57	25.41
9	601166	兴业银行	31,931,651.00	23.37
10	600358	国旅联合	31,718,271.19	23.22
11	002344	海宁皮城	25,088,156.47	18.36
12	002657	中科金财	24,343,404.44	17.82
13	600687	刚泰控股	24,297,077.90	17.78
14	002396	星网锐捷	24,041,642.01	17.60
15	000712	锦龙股份	23,780,680.66	17.41
16	300255	常山药业	23,704,877.56	17.35
17	002073	软控股份	23,297,565.02	17.05
18	002268	卫 士 通	23,226,529.76	17.00
19	600661	新南洋	22,911,714.70	16.77
20	600469	风神股份	22,845,012.38	16.72
21	600446	金证股份	21,897,808.20	16.03
22	600780	通宝能源	21,233,360.98	15.54
23	600637	东方明珠	20,955,832.33	15.34
24	601336	新华保险	20,360,335.00	14.90
25	300383	光环新网	19,447,413.50	14.24
26	000070	特发信息	18,962,326.04	13.88
27	002051	中工国际	18,922,535.24	13.85
28	600588	用友网络	18,704,393.08	13.69
29	300163	先锋新材	18,676,933.00	13.67
30	300003	乐普医疗	17,827,223.19	13.05
31	300162	雷曼股份	17,658,331.75	12.93
32	000061	农 产 品	17,457,359.00	12.78
33	600850	华东电脑	17,442,576.10	12.77
34	300075	数字政通	17,335,732.00	12.69
35	600790	轻纺城	17,307,718.85	12.67
36	002466	天齐锂业	17,271,224.00	12.64
37	002368	太极股份	17,177,125.34	12.57
38	000728	国元证券	16,501,756.68	12.08
39	002285	世联行	16,301,380.43	11.93
40	600893	中航动力	16,261,687.73	11.90
41	600699	均胜电子	16,172,332.62	11.84
42	300307	慈星股份	15,956,175.33	11.68
43	002450	康得新	15,375,638.00	11.25
44	300142	沃森生物	15,356,389.30	11.24
45	002113	天润控股	15,218,672.50	11.14
46	002332	仙琚制药	15,179,482.00	11.11
47	002189	利达光电	15,005,060.00	10.98
48	002407	多氟多	14,692,787.90	10.75
49	300037	新宙邦	14,573,444.08	10.67
50	002074	国轩高科	14,498,241.77	10.61
51	002273	水晶光电	14,335,934.04	10.49
52	300124	汇川技术	13,833,617.48	10.13
53	300133	华策影视	13,556,333.00	9.92
54	300017	网宿科技	13,359,830.25	9.78
55	000024	招商地产	13,183,913.02	9.65
56	300367	东方网力	13,068,102.12	9.57
57	600198	大唐电信	12,920,122.00	9.46
58	002358	森源电气	12,833,527.84	9.39
59	300273	和佳股份	12,797,149.84	9.37
60	000559	万向钱潮	11,854,339.27	8.68
61	300261	雅本化学	11,826,225.30	8.66
62	300353	东土科技	11,733,646.00	8.59
63	002432	九安医疗	11,645,449.45	8.52
64	000651	格力电器	11,629,209.17	8.51
65	000876	新 希 望	11,618,666.27	8.50
66	002308	威创股份	11,337,400.80	8.30
67	600832	东方明珠	11,162,319.00	8.17
68	002185	华天科技	11,107,688.50	8.13
69	300285	国瓷材料	11,054,929.70	8.09
70	601628	中国人寿	10,697,695.34	7.83
71	600837	海通证券	10,601,925.39	7.76
72	600291	西水股份	10,564,336.07	7.73
73	002236	大华股份	10,547,239.10	7.72
74	000488	晨鸣纸业	10,256,068.71	7.51
75	600305	恒顺醋业	10,232,907.69	7.49
76	000961	中南建设	10,197,501.10	7.46
77	300251	光线传媒	10,159,756.56	7.44
78	002666	德联集团	9,941,652.00	7.28
79	600138	中青旅	9,915,127.00	7.26
80	002630	华西能源	9,850,702.75	7.21
81	000792	盐湖股份	9,813,650.60	7.18
82	300207	欣旺达	9,762,887.70	7.15
83	300198	纳川股份	9,690,001.72	7.09
84	300314	戴维医疗	9,600,452.25	7.03
85	002539	新都化工	9,574,436.34	7.01
86	000801	四川九洲	9,535,879.48	6.98
87	002594	比亚迪	9,364,581.63	6.85
88	000920	南方汇通	9,223,934.42	6.75
89	300212	易华录	9,200,582.26	6.73
90	300302	同有科技	9,193,874.18	6.73
91	002405	四维图新	9,092,639.00	6.66
92	600576	万家文化	9,005,564.11	6.59
93	600397	安源煤业	8,995,366.10	6.58
94	300305	裕兴股份	8,831,844.15	6.46
95	002363	隆基机械	8,597,376.86	6.29
96	002098	浔兴股份	8,582,530.00	6.28
97	002152	广电运通	8,567,129.29	6.27
98	002659	中泰桥梁	8,512,879.00	6.23
99	300041	回天新材	8,486,695.74	6.21
100	002325	洪涛股份	8,467,086.25	6.20
101	002230	科大讯飞	8,025,122.80	5.87
102	601186	中国铁建	7,855,636.00	5.75
103	002642	荣之联	7,835,672.30	5.74
104	600325	华发股份	7,806,167.00	5.71
105	002214	大立科技	7,760,034.77	5.68
106	000807	云铝股份	7,657,257.00	5.60
107	300458	全志科技	7,594,082.50	5.56
108	600136	道博股份	7,555,992.70	5.53
109	601211	国泰君安	7,508,679.05	5.50
110	002304	洋河股份	7,397,940.71	5.42
111	002518	科士达	7,395,766.50	5.41
112	000927	*ST夏利	7,391,384.88	5.41
113	600896	中海海盛	7,332,285.74	5.37
114	601901	方正证券	7,275,016.00	5.33
115	300101	振芯科技	7,194,947.45	5.27
116	300347	泰格医药	7,147,653.30	5.23
117	600386	北巴传媒	7,086,274.71	5.19
118	002477	雏鹰农牧	7,061,214.98	5.17
119	000001	平安银行	6,811,960.48	4.99
120	300450	先导智能	6,781,628.00	4.96
121	000078	海王生物	6,730,575.75	4.93
122	002253	川大智胜	6,720,594.00	4.92
123	002137	麦达数字	6,591,478.45	4.82
124	300432	富临精工	6,583,752.00	4.82
125	600969	郴电国际	6,526,701.00	4.78
126	002009	天奇股份	6,503,243.00	4.76
127	600697	欧亚集团	6,380,850.93	4.67
128	002153	石基信息	6,375,190.00	4.67
129	002036	汉麻产业	6,344,229.00	4.64
130	601998	中信银行	6,262,635.00	4.58
131	601258	庞大集团	6,206,936.69	4.54
132	000988	华工科技	6,137,419.00	4.49
133	000797	中国武夷	6,092,294.00	4.46
134	600016	民生银行	6,082,581.00	4.45
135	300303	聚飞光电	6,031,317.48	4.41
136	300160	秀强股份	5,999,073.00	4.39
137	600266	北京城建	5,994,716.02	4.39
138	002339	积成电子	5,951,415.00	4.36
139	601599	鹿港科技	5,948,810.00	4.35
140	600287	江苏舜天	5,940,715.00	4.35
141	600312	平高电气	5,936,149.00	4.35
142	300336	新文化	5,844,127.00	4.28
143	000971	高升控股	5,833,230.00	4.27
144	601888	中国国旅	5,805,524.00	4.25
145	600872	中炬高新	5,724,169.00	4.19
146	601377	XR兴业证	5,695,659.03	4.17
147	300271	华宇软件	5,678,588.97	4.16
148	300145	南方泵业	5,675,365.00	4.15
149	002229	鸿博股份	5,663,513.73	4.15
150	603555	贵人鸟	5,569,149.00	4.08
151	002280	联络互动	5,383,243.00	3.94
152	600203	福日电子	5,349,507.00	3.92
153	000036	华联控股	5,313,368.00	3.89
154	002279	久其软件	5,308,381.10	3.89
155	300139	晓程科技	5,156,001.00	3.77
156	600498	烽火通信	5,144,005.00	3.77
157	603019	中科曙光	5,098,750.00	3.73
158	002241	歌尔声学	5,055,490.00	3.70
159	300161	华中数控	5,004,233.00	3.66
160	300091	金通灵	5,003,216.38	3.66
161	000687	华讯方舟	4,972,203.12	3.64
162	300287	飞利信	4,949,777.00	3.62
163	600391	成发科技	4,897,222.84	3.58
164	300137	先河环保	4,891,036.00	3.58
165	600999	招商证券	4,891,021.75	3.58
166	002104	恒宝股份	4,889,156.00	3.58
167	601989	中国重工	4,848,786.00	3.55
168	600886	国投电力	4,796,274.00	3.51
169	002385	大北农	4,795,977.00	3.51
170	300244	迪安诊断	4,793,421.98	3.51
171	600958	东方证券	4,779,583.00	3.50
172	002364	中恒电气	4,710,900.00	3.45
173	000633	合金投资	4,708,468.00	3.45
174	601588	北辰实业	4,674,649.00	3.42
175	603308	应流股份	4,614,164.65	3.38
176	002462	嘉事堂	4,561,542.94	3.34
177	000990	诚志股份	4,530,466.00	3.32
178	000501	鄂武商A	4,502,358.00	3.30
179	600104	上汽集团	4,394,520.00	3.22
180	300033	同花顺	4,268,742.00	3.12
181	601318	中国平安	4,255,072.74	3.11
182	600062	华润双鹤	4,194,639.00	3.07
183	300364	中文在线	4,050,851.00	2.97
184	600745	中茵股份	4,044,449.00	2.96
185	600019	宝钢股份	4,011,314.12	2.94
186	300166	东方国信	3,992,536.00	2.92
187	600005	武钢股份	3,992,337.00	2.92
188	002375	亚厦股份	3,980,322.28	2.91
189	603899	晨光文具	3,978,433.60	2.91
190	002350	北京科锐	3,975,415.40	2.91
191	601918	国投新集	3,970,895.00	2.91
192	600663	陆家嘴	3,966,067.00	2.90
193	600438	通威股份	3,961,605.12	2.90
194	601010	文峰股份	3,949,434.00	2.89
195	600685	中船防务	3,911,696.00	2.86
196	600835	上海机电	3,907,534.00	2.86
197	600150	中国船舶	3,884,078.00	2.84
198	600028	中国石化	3,877,503.00	2.84
199	601088	中国神华	3,838,374.16	2.81
200	601126	四方股份	3,805,934.00	2.79
201	600406	国电南瑞	3,791,124.68	2.78
202	002108	沧州明珠	3,771,728.42	2.76
203	002284	亚太股份	3,745,357.00	2.74
204	002208	合肥城建	3,697,657.03	2.71
205	601618	中国中冶	3,675,497.00	2.69
206	600470	六国化工	3,668,848.00	2.69
207	600399	抚顺特钢	3,654,794.00	2.68
208	002292	奥飞动漫	3,641,058.00	2.67
209	600718	东软集团	3,616,830.00	2.65
210	300312	邦讯技术	3,479,639.00	2.55
211	600570	恒生电子	3,452,199.00	2.53
212	603026	石大胜华	3,452,116.00	2.53
213	002612	朗姿股份	3,443,893.00	2.52
214	601021	春秋航空	3,413,447.00	2.50
215	300246	宝莱特	3,405,482.49	2.49
216	000059	*ST华锦	3,382,313.00	2.48
217	300340	科恒股份	3,259,493.00	2.39
218	002329	皇氏集团	3,252,962.40	2.38
219	002707	众信旅游	3,247,583.25	2.38
220	002030	达安基因	3,245,127.80	2.38
221	002072	凯瑞德	3,231,681.00	2.37
222	002425	凯撒股份	3,231,217.00	2.37
223	002439	启明星辰	3,225,322.00	2.36
224	002045	国光电器	3,211,486.00	2.35
225	300070	碧水源	3,178,091.00	2.33
226	600112	天成控股	3,174,402.94	2.32
227	600889	南京化纤	3,172,472.00	2.32
228	600562	国睿科技	3,121,997.10	2.29
229	300390	天华超净	3,119,861.00	2.28
230	002245	澳洋顺昌	3,117,071.39	2.28
231	002475	立讯精密	3,100,866.00	2.27
232	600297	广汇汽车	3,089,880.99	2.26
233	300187	永清环保	3,068,635.00	2.25
234	002134	天津普林	3,006,443.50	2.20
235	002179	中航光电	3,006,348.29	2.20
236	601699	潞安环能	2,995,776.00	2.19
237	002141	蓉胜超微	2,994,499.00	2.19
238	000776	广发证券	2,986,492.00	2.19
239	601688	华泰证券	2,983,384.00	2.18
240	002251	步 步 高	2,979,545.88	2.18
241	300063	天龙集团	2,970,796.00	2.17
242	600783	鲁信创投	2,957,270.38	2.16
243	002632	道明光学	2,951,532.00	2.16
244	000733	振华科技	2,944,027.00	2.15
245	002077	大港股份	2,932,830.01	2.15
246	002126	银轮股份	2,921,248.12	2.14
247	002445	中南重工	2,910,768.00	2.13
248	002488	金固股份	2,902,496.00	2.12
249	600360	华微电子	2,896,602.59	2.12
250	002712	思美传媒	2,894,363.00	2.12
251	300073	当升科技	2,891,879.00	2.12
252	300078	思创医惠	2,891,355.00	2.12
253	000568	泸州老窖	2,882,751.50	2.11
254	300322	硕贝德	2,847,301.02	2.08
255	300339	润和软件	2,838,474.00	2.08
256	601107	四川成渝	2,829,201.00	2.07
257	601398	工商银行	2,815,701.00	2.06
258	300327	中颖电子	2,799,866.00	2.05
259	300113	顺网科技	2,798,530.82	2.05
260	002673	西部证券	2,777,628.70	2.03
261	600460	士兰微	2,754,434.00	2.02
262	300136	信维通信	2,750,580.00	2.01

注:买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600048	保利地产	80,309,226.84	58.78
2	600079	人福医药	59,725,780.45	43.72
3	600845	宝信软件	47,117,092.87	34.49
4	601788	光大证券	44,635,096.17	32.67
5	601818	光大银行	44,061,856.40	32.25
6	300168	万达信息	42,259,337.80	30.93
7	601555	东吴证券	41,141,035.98	30.11
8	600358	国旅联合	38,848,449.75	28.44
9	601166	兴业银行	34,779,801.64	25.46
10	002657	中科金财	29,950,152.89	21.92
11	300010	立思辰	29,567,546.58	21.64
12	000712	锦龙股份	29,323,434.18	21.46
13	600661	新南洋	28,988,799.26	21.22
14	600469	风神股份	27,862,334.02	20.39
15	600687	刚泰控股	27,856,546.45	20.39
16	600637	东方明珠	27,818,052.27	20.36
17	002344	海宁皮城	26,076,223.83	19.09
18	000024	招商地产	24,835,130.00	18.18
19	300307	慈星股份	24,543,455.30	17.97
20	300003	乐普医疗	24,455,056.28	17.90
21	002407	多氟多	23,654,616.24	17.31
22	601336	新华保险	21,733,320.50	15.91
23	002396	星网锐捷	21,566,703.84	15.79
24	002285	世联行	20,860,159.92	15.27
25	600588	用友网络	20,398,113.00	14.93
26	002051	中工国际	20,288,027.29	14.85
27	300383	光环新网	20,235,850.71	14.81
28	300255	常山药业	19,772,498.27	14.47
29	300142	沃森生物	19,424,466.57	14.22
30	300273	和佳股份	19,043,990.59	13.94
31	300353	东土科技	18,997,499.72	13.91
32	002073	软控股份	18,766,829.57	13.74
33	000728	国元证券	17,887,066.91	13.09
34	600893	中航动力	17,753,585.22	13.00
35	601628	中国人寿	17,438,250.46	12.76
36	002074	国轩高科	17,413,046.61	12.75
37	600790	轻纺城	17,232,849.80	12.61
38	002450	康得新	16,845,925.19	12.33
39	002268	卫 士 通	16,623,705.60	12.17
40	300162	雷曼股份	16,601,912.94	12.15
41	002363	隆基机械	16,391,475.70	12.00
42	600780	通宝能源	16,353,414.92	11.97
43	002273	水晶光电	16,291,481.10	11.93
44	600699	均胜电子	15,913,854.26	11.65
45	600291	西水股份	15,901,369.22	11.64
46	002666	德联集团	15,745,925.23	11.53
47	002368	太极股份	15,555,070.36	11.39
48	002189	利达光电	15,403,518.05	11.28
49	300037	新宙邦	14,640,419.21	10.72
50	600850	华东电脑	14,485,673.12	10.60
51	002466	天齐锂业	13,892,009.33	10.17
52	300133	华策影视	13,494,058.44	9.88
53	600287	江苏舜天	13,404,393.00	9.81
54	000061	农 产 品	13,357,723.20	9.78
55	300017	网宿科技	13,131,313.41	9.61
56	000876	新 希 望	13,003,056.50	9.52
57	000961	中南建设	12,905,623.75	9.45
58	002308	威创股份	12,898,776.94	9.44
59	300305	裕兴股份	12,415,489.42	9.09
60	000488	晨鸣纸业	12,357,761.67	9.05
61	000801	四川九洲	12,337,250.02	9.03
62	300124	汇川技术	12,195,829.86	8.93
63	000651	格力电器	12,125,764.00	8.88
64	002185	华天科技	12,118,164.44	8.87
65	603555	贵人鸟	12,088,268.75	8.85
66	000070	特发信息	11,777,141.70	8.62
67	000559	万向钱潮	11,466,757.97	8.39
68	002432	九安医疗	11,454,453.59	8.38
69	600397	安源煤业	11,378,930.00	8.33
70	002358	森源电气	11,378,530.53	8.33
71	600016	民生银行	11,374,667.63	8.33
72	600198	大唐电信	11,359,541.23	8.31
73	600837	海通证券	11,121,373.32	8.14
74	600832	东方明珠	10,853,134.00	7.94
75	600446	金证股份	10,768,130.00	7.88
76	300198	纳川股份	10,639,156.29	7.79
77	300251	光线传媒	10,332,860.77	7.56
78	601318	中国平安	10,319,719.14	7.55
79	300075	数字政通	10,315,503.01	7.55
80	002009	天奇股份	10,196,694.00	7.46
81	002113	天润控股	10,156,825.51	7.43
82	300207	欣旺达	9,989,383.92	7.31
83	300302	同有科技	9,916,221.63	7.26
84	002539	新都化工	9,888,224.20	7.24
85	300101	振芯科技	9,733,200.40	7.12
86	000927	*ST夏利	9,484,522.39	6.94
87	300163	先锋新材	9,412,784.67	6.89
88	600138	中青旅	9,384,958.31	6.87
89	000792	盐湖股份	9,240,606.40	6.76
90	002594	比亚迪	9,210,824.53	6.74
91	002405	四维图新	9,203,688.40	6.74
92	300285	国瓷材料	9,101,176.37	6.66
93	002098	浔兴股份	9,002,404.45	6.59
94	002630	华西能源	8,924,275.61	6.53
95	600576	万家文化	8,833,196.05	6.47
96	300212	易华录	8,749,097.38	6.40
97	002332	仙琚制药	8,738,018.40	6.40
98	002642	荣之联	8,540,649.07	6.25
99	002036	汉麻产业	8,510,976.20	6.23
100	000920	南方汇通	8,474,497.17	6.20
101	002230	科大讯飞	8,401,564.38	6.15
102	600136	道博股份	8,324,416.84	6.09
103	000807	云铝股份	8,257,432.01	6.04
104	002325	洪涛股份	8,198,495.65	6.00
105	300041	回天新材	8,186,026.16	5.99
106	300261	雅本化学	8,123,967.94	5.95
107	601211	国泰君安	7,996,825.62	5.85
108	002236	大华股份	7,925,231.64	5.80
109	600325	华发股份	7,657,964.00	5.61
110	002152	广电运通	7,638,440.00	5.59
111	600386	北巴传媒	7,476,623.20	5.47
112	002659	中泰桥梁	7,423,833.24	5.43
113	601186	中国铁建	7,307,781.97	5.35
114	300367	东方网力	7,237,450.68	5.30
115	002518	科士达	7,142,520.92	5.23
116	300458	全志科技	7,093,787.50	5.19
117	002477	雏鹰农牧	7,087,657.29	5.19
118	300303	聚飞光电	7,065,497.48	5.17
119	600697	欧亚集团	7,009,979.16	5.13
120	002153	石基信息	6,976,239.04	5.11
121	300336	新文化	6,934,049.85	5.08
122	601258	庞大集团	6,872,783.00	5.03
123	002304	洋河股份	6,791,430.88	4.97
124	002137	麦达数字	6,754,917.42	4.94
125	002253	川大智胜	6,751,330.87	4.94
126	300432	富临精工	6,606,455.43	4.84
127	000988	华工科技	6,566,388.79	4.81
128	300314	戴维医疗	6,550,877.60	4.80
129	601901	方正证券	6,528,404.00	4.78
130	000001	平安银行	6,498,760.25	4.76
131	600000	浦发银行	6,382,075.98	4.67
132	300137	先河环保	6,379,472.46	4.67
133	600598	北大荒	6,358,968.03	4.65
134	601328	交通银行	6,349,245.00	4.65
135	300450	先导智能	6,322,459.76	4.63
136	601998	中信银行	5,998,986.20	4.39
137	600312	平高电气	5,913,251.00	4.33
138	600305	恒顺醋业	5,911,257.09	4.33
139	600872	中炬高新	5,730,034.99	4.19
140	601377	XR兴业证	5,682,528.59	4.16
141	000971	高升控股	5,679,572.64	4.16
142	002339	积成电子	5,678,083.81	4.16
143	600266	北京城建	5,663,768.36	4.15
144	601010	文峰股份	5,606,113.00	4.10
145	300145	南方泵业	5,514,883.56	4.04
146	600498	烽火通信	5,465,360.25	4.00
147	000797	中国武夷	5,444,488.46	3.99
148	300091	金通灵	5,444,451.67	3.99
149	601888	中国国旅	5,385,610.39	3.94
150	002712	思美传媒	5,312,686.50	3.89
151	600391	成发科技	5,255,320.00	3.85
152	000687	华讯方舟	5,243,231.29	3.84
153	600970	中材国际	5,241,024.56	3.84
154	002675	东诚药业	5,232,540.00	3.83
155	600104	上汽集团	5,196,566.32	3.80
156	002229	鸿博股份	5,188,142.26	3.80
157	002279	久其软件	5,157,966.06	3.78
158	601989	中国重工	5,092,189.36	3.73
159	600958	东方证券	5,016,735.80	3.67
160	600969	郴电国际	4,967,421.83	3.64
161	600259	广晟有色	4,941,026.90	3.62
162	600999	招商证券	4,932,521.52	3.61
163	000831	五矿稀土	4,922,458.31	3.60
164	002385	大北农	4,860,193.57	3.56
165	600062	华润双鹤	4,856,648.20	3.55
166	002241	歌尔声学	4,797,776.56	3.51
167	300244	迪安诊断	4,675,032.81	3.42
168	601588	北辰实业	4,597,431.62	3.37
169	000501	鄂武商A	4,590,990.43	3.36
170	300347	泰格医药	4,584,607.00	3.36
171	000078	海王生物	4,583,782.00	3.36
172	300287	飞利信	4,528,432.43	3.31
173	600657	信达地产	4,525,605.32	3.31
174	300139	晓程科技	4,524,337.00	3.31
175	002108	沧州明珠	4,509,374.00	3.30
176	000633	合金投资	4,469,481.77	3.27
177	000069	华侨城A	4,465,571.00	3.27
178	002350	北京科锐	4,462,988.80	3.27
179	603019	中科曙光	4,454,413.34	3.26
180	300161	华中数控	4,417,922.04	3.23
181	601599	鹿港科技	4,392,824.00	3.22
182	000990	诚志股份	4,387,917.88	3.21
183	600886	国投电力	4,385,448.00	3.21
184	002462	嘉事堂	4,342,312.70	3.18
185	603308	应流股份	4,329,369.85	3.17
186	600019	宝钢股份	4,198,282.75	3.07
187	600005	武钢股份	4,179,035.82	3.06
188	300364	中文在线	4,156,872.48	3.04
189	300033	同花顺	4,095,120.00	3.00
190	000036	华联控股	4,094,527.10	3.00
191	601021	春秋航空	4,070,096.10	2.98
192	002292	奥飞动漫	4,040,965.75	2.96
193	600835	上海机电	4,013,035.53	2.94
194	601088	中国神华	3,973,524.73	2.91
195	600297	广汇汽车	3,957,607.00	2.90
196	000733	振华科技	3,949,730.00	2.89
197	603899	晨光文具	3,919,082.79	2.87
198	600896	中海海盛	3,915,938.16	2.87
199	002375	亚厦股份	3,884,096.00	2.84
200	600470	六国化工	3,867,604.97	2.83
201	000732	泰禾集团	3,850,203.40	2.82
202	600203	福日电子	3,821,653.08	2.80
203	002104	恒宝股份	3,809,667.92	2.79
204	601126	四方股份	3,806,766.04	2.79
205	600559	老白干酒	3,768,620.00	2.76
206	002425	凯撒股份	3,739,319.08	2.74
207	600406	国电南瑞	3,728,467.08	2.73
208	300312	邦讯技术	3,681,330.00	2.69
209	002134	天津普林	3,675,794.54	2.69
210	300246	宝莱特	3,669,365.79	2.69
211	300078	思创医惠	3,650,157.05	2.67
212	600663	陆家嘴	3,619,900.00	2.65
213	600150	中国船舶	3,595,583.10	2.63
214	002146	荣盛发展	3,579,231.00	2.62
215	600199	金种子酒	3,576,385.60	2.62
216	002364	中恒电气	3,448,776.60	2.52
217	600399	抚顺特钢	3,428,819.37	2.51
218	002280	联络互动	3,384,910.16	2.48
219	601618	中国中冶	3,352,890.00	2.45
220	002445	中南重工	3,323,592.33	2.43
221	600889	南京化纤	3,320,293.68	2.43
222	600112	天成控股	3,298,438.96	2.41
223	603026	石大胜华	3,257,351.20	2.38
224	002475	立讯精密	3,242,050.90	2.37
225	300340	科恒股份	3,231,659.78	2.37
226	000776	广发证券	3,219,779.46	2.36
227	002707	众信旅游	3,199,010.17	2.34
228	000059	*ST华锦	3,194,589.79	2.34
229	002208	合肥城建	3,172,444.60	2.32
230	600570	恒生电子	3,158,641.97	2.31
231	002439	启明星辰	3,144,587.38	2.30
232	300322	硕贝德	3,141,380.06	2.30
233	601918	国投新集	3,135,383.87	2.30
234	002329	皇氏集团	3,122,062.78	2.29
235	300063	天龙集团	3,117,788.00	2.28
236	601688	华泰证券	3,111,523.00	2.28
237	002072	凯瑞德	3,090,292.05	2.26
238	002251	步 步 高	3,069,754.00	2.25
239	002179	中航光电	3,066,129.16	2.24
240	300187	永清环保	3,062,873.20	2.24
241	300291	华录百纳	3,053,591.20	2.24
242	002632	道明光学	2,996,016.80	2.19
243	002030	达安基因	2,982,630.88	2.18
244	600487	亨通光电	2,975,752.77	2.18
245	000568	泸州老窖	2,964,144.75	2.17
246	300113	顺网科技	2,950,402.07	2.16
247	600783	鲁信创投	2,948,364.00	2.16
248	300390	天华超净	2,936,110.99	2.15
249	601398	工商银行	2,934,788.00	2.15
250	600028	中国石化	2,909,719.00	2.13
251	300070	碧水源	2,904,786.40	2.13
252	601107	四川成渝	2,904,545.61	2.13
253	002045	国光电器	2,889,465.67	2.12
254	601699	潞安环能	2,886,275.90	2.11
255	002141	蓉胜超微	2,878,886.88	2.11
256	300327	中颖电子	2,856,411.85	2.09
257	300271	华宇软件	2,851,653.00	2.09
258	300136	信维通信	2,849,000.00	2.09
259	002126	银轮股份	2,837,084.28	2.08
260	000738	中航动控	2,826,959.00	2.07

注:卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	2,573,858,246.52
卖出股票的收入(成交)总额	2,681,588,674.39

注:买入股票成本总额及卖出股票收入总额均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

根据基金合同,本基金不投资贵金属。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1本基金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。
8.12.2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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	460,096.77
2	应收证券清算款	19,029,254.31
3	应收股利	-
4	应收利息	4,047.08
5	应收申购款	5,293.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,498,691.17

8.12.4 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间的可转债。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002612	朗姿股份	3,886,190.00	2.52	重大事项停牌

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
9,206	9,716.03	182,372.68	0.20%	89,263,391.58	99.80%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	25,074.95	0.028034%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年3月25日)基金份额总额	1,109,598,820.51
本报告期期初基金份额总额	99,648,024.43
本报告期基金总申购份额	495,870,689.57
减:本报告期基金总赎回份额	506,072,949.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	89,445,764.26

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(一)基金管理人重大人事变动

1、经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第十次会议审议通过,毕国强先生不再担任公司总经理,由公司董事长吴显玲女士代为履行总经理职责。详情请参阅2015年4月18日相关公告。
2、经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第二十一次会议审议通过,李彪先生不再担任公司副总经理。详情请参阅2015年12月12日相关公告。
期后事项说明: 经国海富兰克林基金管理有限公司股东会2015年第八次会议和第四届董事会第二十二次会议分别审议,同意自2016年1月4日起,Gregory E. McGowan先生担任公司董事长;同意吴显玲女士自2016年1月7日起担任公司总经理,全面主持经营管理工作。详情请参阅2016年1月9日相关公告。
3、经公司第四届董事会第十二次会议审议通过,同意刘伟亭先生辞去富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金的基金经理,同意聘任卫学海先生担任该基金的基金经理。公司已办理完成上述基金经理的注册变更手续,详情请参阅2015年5月26日相关公告。
4、经公司决定,同意增聘杜飞为富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金的基金经理,与现任基金经理卫学海共同管理该基金。公司已办理完成上述基金经理的注册手续,详情请参阅2015年7月17日相关公告。

(二)基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

2015年4月,李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人应支付给会计师事务所的审计费用是人民币60000.00元,本基金自成立以来对其进行审计的均为普华永道中天会计师事务所,未曾改聘其他会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

(一)基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

(二)基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	1,284,841,692.96	24.45%	1,181,956.74	24.83%	
海通证券	2	1,240,557,122.97	23.61%	1,104,892.51	23.21%	
光大证券	1	591,935,617.93	11.26%	541,819.05	11.38%	
招商证券	1	479,177,291.39	9.12%	427,891.59	8.99%	
长江证券	2	362,082,469.37	6.89%	329,758.67	6.93%	
华创证券	1	345,230,499.48	6.57%	314,608.62	6.61%	
兴业证券	1	336,972,921.15	6.41%	306,048.86	6.43%	
中银国际	1	180,020,172.28	3.43%	159,299.97	3.35%	
东方证券	2	162,053,672.06	3.08%	144,553.41	3.04%	
申万宏源	2	153,800,272.38	2.93%	140,733.92	2.96%	
广发证券	1	118,757,028.94	2.26%	108,519.44	2.28%	
国海证券	2	-	-	-	-	
中信建投	2	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	
华泰证券	1	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
瑞银证券	1	-	-	-	-	
民生证券	1	-	-	-	-	

注:
1. 专用交易单元的选择标准和程序
1)选择代理基金证券买卖的证券经营机构的标准
基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构,并租用其交易单元作为基金的专用交易单元。选择的标准是:
①资历雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币;
②财务状况良好,经营行为规范,最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚;
③内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;
④具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务;
⑤研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的特定要求,提供专题研究报告。
2)公司基金交易佣金分配依据券商提供的研究报告和服务质量,评判标准包括但不限于:
①全面及时向公司提供高质量的关于宏观、行业和市场的研究报告;
②具有数量研究和开发能力;
③能有效组织上市公司调研;
④能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告;
⑤上门路演和电话会议的质量;
⑥与我公司投资和研究人员的信息交流和沟通能力;
⑦其他与投资相关的服务和支持。
3)租用基金专用交易单元的程序
①基金管理人根据上述标准考察证券经营机构,考察结果经公司领导审批后,我司与被选中的证券经营机构签订《券商交易单元租用协议》和《研究服务协议》,并办理基金专用交易单元租用手续。
②之后,基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况,根据如下选择标准细化的评价体系,每季度对签约证券经营机构的服务进行一次综合评价:
A 提供的研究报告质量和数量;
B 由基金管理人提出课题,证券经营机构提供的研究论文质量;
C 证券经营机构协助我公司研究员调研情况;
D 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况;
E 其他可评价的量化标准。
经过评价,对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留,并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。若本公司认为签约机构的服务不能满足要求,或签约机构违规受到国家有关部门的处罚,本公司有权终止签署的协议,并撤销租用的交易单元;基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构,租用其交易单元。
③交易单元租用协议期限为一年,到期后若双方没有异议可自动延期一年。
2.报告期内证券公司基金专用交易单元的变更情况
报告期内,本基金新增广发证券深圳交易单元1个;新增长江证券深圳交易单元1个;减少广发证券上海交易单元1个;减少东海证券上海交易单元1个。

国海富兰克林基金管理有限公司
二〇一六年三月二十八日