

富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金

2013第四季度报告

2013年12月31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:二〇一四年一月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监察保证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。

基金托管人和银行对本基金合同规定，在2014年1月16日核对了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核无误，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。

本报告不构成财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国富潜力组合股票
基金代码 450003
交易代码 450003
基金运作方式 灵活的股票型开放式
基金合同生效日 2007年3月22日
报告期末基金份额总额 3,599,070,066.49份
投资目标 重点投资于长期增长、投资未来收益具有成长性和资产价值低估的上市公司股票，为投资者赚取长期稳定的资本增值。
资产配置策略：
本基金采用“自下而上”的投资策略，从上市公司的具体发展前景和未来的盈利分析入手，自下而上“跟踪”后，根据市场环境的变化，找出市场的各种获利机会和未来的投资风险，确定本基金资产配置组合的进阶选择。
本基金运用逐级配置方法，通过对于上市公司的基本面和增长潜力分析，挑选出具有投资价值且具有成长性的股票投资。
本基金的债券投资将根据市场条件选择投资于货币市场工具、短期投资组合型基金等资产。
业绩比较基准 85%×MSCI中国股票指数+10%×债券国债指数(指数 3.6%×国股存息基金)

风险收益特征 基金的风险收益特征属中高风险、中高收益类型，适合追求长期稳定收益的投资者。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日-2013年12月31日) 1,444,388,572.03
1.本期已实现收益 -76,739,720.85
3.本期平均基金份额本期利润 -0.0212
4.期末基金份额净值 3,627,336,094.18
5.期末基金份额总额 1,0192

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),计算费用后实际盈亏以当年列示。
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.基金净值表现

3.2.1 本基金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 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差值④ (1)③ (2)④
过去三个月 -2.06% 1.23% -2.81% 0.96% 0.75% -0.27%

3.2.2 本基金合同生效以来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

本基金合同生效以来基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较
累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图
2007年3月22日至2013年12月31日

图:本基金合同生效以来基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

注:本基金的基金合同生效日为2007年3月22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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理助理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明
朱国庆 公司权益投资总监、CFA、CPA, 复旦大学应用经济学硕士, 历任上海浦东发展银行社会金融部基金经理, 大鹏证券有限公司投资银行部项目经理, 国海证券有限责任公司基金筹备组成员、国海富兰克林基金管理有限公司行业研究员、国海富兰克林基金管理有限公司投资总监, 国富潜力组合股票基金和国富策略增长股票基金的基金经理
注:在任“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各项工作总和。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

报告期内,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《富兰克林国海潜力组合型股票型证券投资基金合同》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取最大利益。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、法规和基金合同的约定。

4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司在公平交易制度、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》。严格按照规定对异常交易进行控制和审批。

4.4 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司未发现存在不公平交易和利益输送的情况。

4.5 报告期内本基金投资组合的重大关联交易说明

4.6 报告期内基金的利润分配情况

4.7 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.8 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.9 报告期内基金的估值政策和程序

4.10 报告期内基金的会计政策和会计估计

4.11 报告期内基金的财务会计报告

4.12 报告期内基金的临时公告

4.13 报告期内基金的清算报告

4.14 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.15 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.16 报告期内基金的估值政策和程序

4.17 报告期内基金的财务会计报告

4.18 报告期内基金的清算报告

4.19 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.20 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.21 报告期内基金的估值政策和程序

4.22 报告期内基金的财务会计报告

4.23 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.24 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.25 报告期内基金的估值政策和程序

4.26 报告期内基金的财务会计报告

4.27 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.28 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.29 报告期内基金的估值政策和程序

4.30 报告期内基金的财务会计报告

4.31 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.32 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.33 报告期内基金的估值政策和程序

4.34 报告期内基金的财务会计报告

4.35 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.36 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.37 报告期内基金的估值政策和程序

4.38 报告期内基金的财务会计报告

4.39 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.40 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.41 报告期内基金的估值政策和程序

4.42 报告期内基金的财务会计报告

4.43 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.44 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.45 报告期内基金的估值政策和程序

4.46 报告期内基金的财务会计报告

4.47 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.48 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.49 报告期内基金的估值政策和程序

4.50 报告期内基金的财务会计报告

4.51 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.52 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.53 报告期内基金的估值政策和程序

4.54 报告期内基金的财务会计报告

4.55 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.56 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.57 报告期内基金的估值政策和程序

4.58 报告期内基金的财务会计报告

4.59 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.60 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.61 报告期内基金的估值政策和程序

4.62 报告期内基金的财务会计报告

4.63 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.64 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.65 报告期内基金的估值政策和程序

4.66 报告期内基金的财务会计报告

4.67 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.68 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.69 报告期内基金的估值政策和程序

4.70 报告期内基金的财务会计报告

4.71 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.72 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.73 报告期内基金的估值政策和程序

4.74 报告期内基金的财务会计报告

4.75 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.76 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.77 报告期内基金的估值政策和程序

4.78 报告期内基金的财务会计报告

4.79 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.80 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.81 报告期内基金的估值政策和程序

4.82 报告期内基金的财务会计报告

4.83 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.84 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.85 报告期内基金的估值政策和程序

4.86 报告期内基金的财务会计报告

4.87 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.88 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.89 报告期内基金的估值政策和程序

4.90 报告期内基金的财务会计报告

4.91 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.92 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.93 报告期内基金的估值政策和程序

4.94 报告期内基金的财务会计报告

4.95 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.96 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.97 报告期内基金的估值政策和程序

4.98 报告期内基金的财务会计报告

4.99 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.10 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.11 报告期内基金的估值政策和程序

4.12 报告期内基金的财务会计报告

4.13 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.14 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.15 报告期内基金的估值政策和程序

4.16 报告期内基金的财务会计报告

4.17 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.18 报告期内基金管理人评价本基金的情况

4.19 报告期内基金的估值政策和程序

4.20 报告期内基金的财务会计报告

4.21 报告期内基金份额持有人数及持有人结构变动情况

4.22 报告期内