
富兰克林国海中国收益证券投资基金
2011 年年度报告
2011 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年三月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 22 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。

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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
§ 2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	14
§ 6	审计报告	14
6.1	管理层对财务报表的责任.....	14
6.2	注册会计师的责任	15
6.3	审计意见	15
§ 7	年度财务报表	15
7.1	资产负债表	15
7.2	利润表	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4	报表附注	19
§ 8	投资组合报告	41
8.1	期末基金资产组合情况	41
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	42
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	46
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	46
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	46

8.9	投资组合报告附注	46
§ 9	基金份额持有人信息	47
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	47
§ 10	开放式基金份额变动	47
§ 11	重大事件揭示	48
11.1	基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
11.4	基金投资策略的改变	48
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	49
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
11.8	其他重大事件	51
§ 12	备查文件目录	54
12.1	备查文件目录	54
12.2	存放地点	54
12.3	查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海中国收益证券投资基金
基金简称	国富中国收益混合
基金主代码	450001
交易代码	450001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 6 月 1 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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1, 806, 321, 063. 90 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以富兰克林邓普顿投资集团全球资产管理平台为依托，在充分结合国内新兴证券市场特性的原则下，通过投资稳健分红的股票和各种优质的债券，达到基金资产稳健增长的目的，为投资者创造长期稳定的投资收益。
投资策略	<p>资产配置量化策略： 一般情况下，投资决策委员会负责基金资产的配置策略，并采用资产配置分析会的形式来实施，以资产配置分析会的组织形式保证资产配置决策的正确性和科学性。资产配置分析会由投资总监主持，基金经理和研究部总监参加。本基金通常以每个季度为一个调整周期，在资产配置分析会上，对拟定的投资组合调整方案进行检验。基金经理负责提交一份对未来一个季度投资组合建议的调整报告，供委员会讨论，形成最终结论，投资总监在投资决策委员会的授权下，根据市场变化情况拥有一定权限对投资组合进行灵活调整。</p> <p>股票选择策略： 为了能够恰当地运用富兰克林邓普顿投资集团的全球化标准，股票分析员必须对行业的整体趋势和该行业在中国的具体特点有一个深入而清楚的研究。之后，股票分析员以行业整体趋势为背景，寻找最契合所在行业发展趋势的公司，并着重评估公司管理层、公司战略、公司品质以及潜在的变化和风险等基本因素；通过综合最优评价系统对潜在的股票进行优化分析。</p> <p>债券投资策略： 本基金债券组合的回报来自于三个方面：组合的久期管理、识别收益率曲线中价值低估的部分以及识别各类债券中价值低估的种类（例如企业债存在信用升级的潜力）。</p>

业绩比较基准	40%×富时中国 A200 指数+ 55%×中国国债指数(全价)+5%×同业存款息率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中收益稳定、风险较低的品种。风险系数介于股票和债券之间。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	储丽莉
	联系电话	021-3855 5555
	电子邮箱	service@ftsfund.com
客户服务电话	400-700-4518、9510-5680和021-38789555	95588
传真	021-6888 3050	010-66105798
注册地址	广西南宁市琅东滨湖路46号	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期9层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	吴显玲	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	国海富兰克林基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期9层

§ 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	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-11,078,505.55	206,186,874.12	183,514,720.64
本期利润	-210,815,255.92	64,046,359.29	544,159,112.82
加权平均基金份额本期利润	-0.1195	0.0285	0.3065
本期加权平均净值利润率	-20.98%	4.47%	41.46%
本期基金份额净值增长率	-19.69%	5.00%	53.38%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	-187,515,991.40	207,617,881.67	355,576,189.89
期末可供分配基金份额利润	-0.1038	0.1033	0.1976
期末基金资产净值	862,380,234.69	1,375,566,630.88	1,477,161,093.08
期末基金份额净值	0.4774	0.6846	0.8209
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	106.25%	156.81%	144.58%

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
最近 3 个月	-5.18%	1.14%	-1.26%	0.56%	-3.92%	0.58%
最近 6 个月	-15.23%	1.00%	-7.63%	0.54%	-7.60%	0.46%
最近 1 年	-19.69%	0.95%	-8.37%	0.52%	-11.32%	0.43%
最近 3 年	29.34%	1.12%	10.69%	0.66%	18.65%	0.46%
最近 5 年	25.44%	1.28%	12.79%	0.86%	12.65%	0.42%
自基金合同生效起至今	106.25%	1.15%	66.80%	0.79%	39.45%	0.36%

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=40% × 富时中国 A200 指数+ 55% × 中国国债指数(全价)+5% × 同业存款息率。本基金股票投资部分的业绩比较基准

采用富时中国 A200 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，1 日收益率（ $Benchmark_t$ ）按下列公式计算：

$$Benchmark_t = 40\% \times (\text{富时中国 A200 指数}_t / \text{富时中国 A200 指数}_{t-1}) + 55\% \times (\text{中债国债总指数 (全价)}_t / \text{中债国债总指数 (全价)}_{t-1}) + 5\% \times \text{同业存款利率} / 360$$

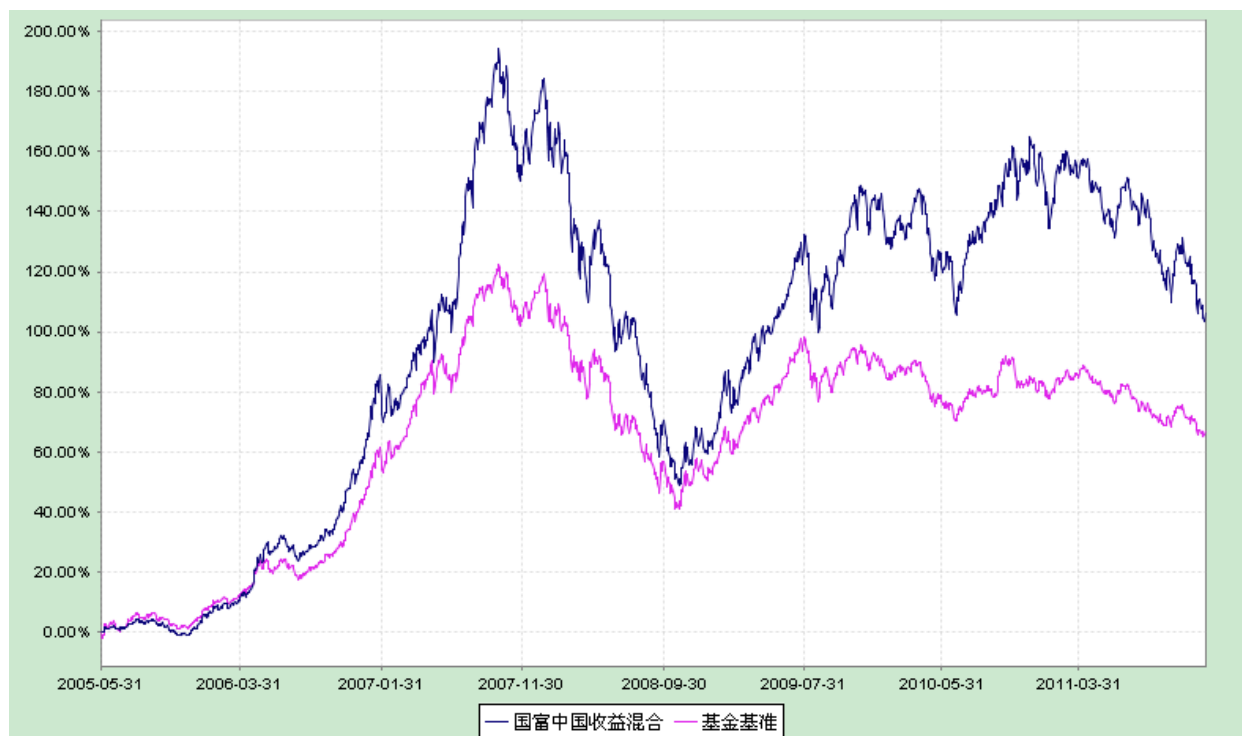
其中， $t=1,2,3,\dots,T$ ， T 表示时间截止日。

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

富兰克林国海中国收益证券投资基金

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

（2005 年 6 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日）



注：1、本基金的基金合同生效日为 2005 年 6 月 1 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。

2、截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同的约定。基金合同中关于基金投资比例的约定如下：

“股票投资为基金资产的 20%至 65%，债券为 35%至 75%，现金类资产为 5%至 20%。本基金的股票投资主要集中于具有良好分红记录的上市公司，该部分股票和债券投资比例将不低于本基金资产的 80%。”

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述约定比例的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的除外。

3、本基金本报告期遵守法律、法规和基金合同的比例限制进行证券投资。

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

富兰克林国海中国收益证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：1、根据基金合同，本基金的资产配置比例范围为：股票 20%—65%，债券 35%—75%，现金 5%—20%。

2、本基金的业绩比较基准 = 40% × 富时中国 A200 指数+ 55% × 中国国债指数(全价) +5% × 同业存款息率。

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
2011	0.900	106,724,932.95	65,755,900.15	172,480,833.10	-
2010	1.700	293,449,331.09	128,556,195.21	422,005,526.30	-
2009	1.500	139,864,336.94	114,661,074.73	254,525,411.67	-
合计	4.100	540,038,600.98	308,973,170.09	849,011,771.07	-

§ 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。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 60 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，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。截至报告期末，从 2005 年 6 月第一只基金成立到现在，本公司已经成功管理了 9 只基金产品（包含 A、C 类债券基金）。

1. 截至 2011 年 12 月末：富兰克林国海中国收益证券投资基金荣获晨星（Morningstar）三年期标准混合型四星评级；

2. 截至 2010 年 12 月末：富兰克林国海中国收益证券投资基金荣获晨星（Morningstar）三年期标准混合型四星评级。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
刘怡敏	本基金和富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金的基金经理	2010-03-27	-	8 年	刘怡敏女士，CFA，四川大学金融学硕士。曾任西南证券研究发展中心债券研究员，并曾在富国基金管理有限公司从事债券投资及研究工作。现任本基金和富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金的基金经理。
徐荔蓉	本基金的基金经理、研究分析部总经理	2010-09-29	-	14 年	徐荔蓉先生，CFA，CPA（非执业），律师（非执业），中央财经大学经济学硕士，曾任职融通基金管理有限公司研究策划部副总监、通乾基金经理助理、通利债券基金经理，申万巴黎基金有限公司盛利精选基金基金经理，国海富兰克林基金有限公司研究分析部总经理和资产管理部总经理兼

					专户投资经理等职。现任本基金的基金经理、并同时担任国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部总经理。
--	--	--	--	--	--------------------------------------------------

注：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合规守信情况的说明

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《富兰克林国海中国收益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。报告期内不存在基金间通过价差交易进行利益输送的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

报告期末，公司共管理了九只基金，即富兰克林国海中国收益证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金、富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金、富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金和富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金，其中富兰克林国海中国收益证券投资基金和富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金为混合型基金，富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金为债券型基金，其余六只基金为股票型基金。公司已开展特定客户资产管理业务，共管理了五只产品，即“中行国富配置一号”、“兴业国富互惠一号”、“兴业国富互惠二号”、“中行国富互惠一号”和“中行国富配置二号”。公司尚未开展企业年金、社保基金资产管理业务。报告期内未发生公司管理的投资风格相似的不同基金之间的业绩表现差异超过 5% 的情况。

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。

报告期内未发生法规严格禁止的同一基金或不同基金之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。

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

2011 年股票市场整体呈现横盘然后逐级振荡走低的格局，沪深 300 指数全年下跌 25.01%，而以创业板为代表的中小股票则基本为单边下跌格局，创业板综合指数全年下跌 35.8%。从风格资产上看，周期类公司在上半年表现抢眼后持续下跌，而成长类公司以振荡走低，估值中枢下移为主，相对而言，低估值的银行等股票全年表现较好。

本基金在 2011 年坚持均衡持仓的投资思路，对周期类、成长类和低估值类公司均进行了配置，但总体上在周期类和成长类股票上的配置略偏重。在上半年市场振荡的过程中相对保持了较好的投资节奏，但在下半年单边下跌过程中，对仓位和结构的调整不甚理想，未能争取更好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2011 年下跌 19.69%，未能战胜业绩基准。从归因分析看，相对于业绩基准更高的股票仓位是最主要的原因，个股选择和可转换债券也提供了部分负贡献。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为中国资本市场和中国经济一样已经进入了新的转型期，宏观经济预期将保持略低的经济增长速度和较高的通货膨胀率的组合，而这种“高增长、高通胀”的组合对企业的利润率必然形成更大的压力，而宏观整体的流动性也乏善可陈，因此资本市场的整体宏观环境并不是非常有利，而股票市场制度变革逐步增大的压力使得市场环境更加复杂。

我们应对这种复杂的市场环境的策略是坚持研究指导投资的思路，设定合理的预期收益率，同时在股票仓位的变化上保持一定的灵活性，投资重点将集中在积极挖掘和选择那些可能在经济转型中长期受益的公司上。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司督察长带领监察稽核部门严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规和中国证监会的有关规定，认真开展监察稽核工作，确保了公司各项业务依法合规进行，为公司的发展壮大提供了有力的保障。

一、监察稽核部门积极发挥合规控制职能，对基金及公司运作各环节进行了有效地监控

公司股东、董事会和管理层一直重视和支持监察稽核工作，使监察稽核部门保持了独立性与权威性，为监察稽核部门发挥合规与风险控制职能提供了良好的内控环境。本报告期，监察稽核部针对公司各种新业务的开展、特定资产管理业务产品的发行、QDII 产品的准备及发行工作要求，积极加强对公司各部门、各主要运作环节的监控，并通过组织修订完善公司制度流程、开展多层次的员工合规教育和日常提示、继续推进公司重大风险点排查和评估工作、严格的合规审核等措施，强化员工风控意识，努力营造合规经营文化来实现事前监控；在事中监控上，从保护基金持有人和公司利益的角度，结合当前行业与市场热点和难点问题，强化公司各业务环节的监察及信息披露；同时不断检查制度流程和重大风险点控制的贯彻落实，及时揭示和督促整改，以此加大事后监控力度，严肃合规纪律，为公司规范运作提供了监察支持与保障。

二、由监察稽核部负责具体组织和督办，对公司制度进行补充完善

公司在 2011 年根据最新法律法规要求，并结合公司的业务特点，为确保公司内控制度的合理性及有效性，及时完成对公司《公平交易制度》、《异常交易监控和报告制度》、《投资组合间同日反向交易管理办法》、《反洗钱内部控制制度》、《公司网站管理制度》的修订，制定了《防止市场操纵的风险控制措施》，并完成对公司投资决策委员会议事规则、投资组合经理授权流程等的制订或修订，巩固了公司合规运作的基础。

三、严格按照相关法规要求，进行基金募集与持续营销申请材料、市场推广宣传材料、代销协议、席位租用协议等各项材料的合规性审核工作；完善代销协议内容，以符合客户服务、反洗钱等法律法规要求；协助客户服务部门解答投资者疑问，处理投资者投诉，夯实客户服务工作基础；以及日常法律事务工作，做到风险事先防范，堵塞管理漏洞。

四、认真履行部门职责，及时、准确、完整地在指定报刊和公司网站上进行了各项法定信息披露，并及时完成了向中国证监会有关材料的报告报备工作，未发生重大差错，为基金份额持有人及时掌握信息、进行决策提供了信息来源。

五、公司从 5 个方面着手监控，确保基金投资的安全、合规、高效：

（一）配备了具有相关业务资格的人员，负责进行基金投资分析、决策和风险控制，以专业化的经营方式管理和运作基金财产。

（二）明晰职责。投资决策委员会按期召开会议，进行投资决策，并有完整的会议纪要；基金经理在授权范围内独立行使投资决策权；公司以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为，维护基金份额持有人合法权益。

（三）坚持合规运作。基金投资有研究报告的支持，严格在授权范围内进行投资交易；通过严格

执行法规与基金合同，尤其是设立严格的内部风险政策，基金的投资范围、各项投资比例符合法规与基金合同的规定或在基金合同约定的时间内做出了调整；基金经理每日的投资决策记录完整并妥善保管；动态监控基金经理是否存在违反谨慎、勤勉义务，操纵市场，内幕交易等造成投资人利益损失的行为。

（四）严禁利益输送。报告期内公司严格执行关联交易与公平交易管理制度。公司对所管理的不同基金、专户分别管理，公平对待，未发生公司管理的投资风格相似的不同基金、专户之间的业绩表现差异超过 5% 的情况。

（五）实行独立的风险与绩效评价。风险控制经理每月进行独立的基金投资风险评估，并对基金的投资业绩进行分析，出具业绩分析报告。

4.7 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《公允估值管理办法》。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普华永道中天会计师事务所进行审核并出具报告，由托管银行进行复核。公司估值委员会主席为总经理（或其任命者）；投票成员：主席，投资总监，营运总监，风险管理经理，基金会计经理，监察稽核部负责人，法务主管；非投票成员（观察员，列席表达相关意见）：督察长，基金经理，交易室负责人。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金已于 2011 年实施利润分配 172,480,833.10 元。

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。

§ 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

2011 年，本基金托管人在对富兰克林国海中国收益证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华

《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年，富兰克林国海中国收益证券投资基金的管理人——国海富兰克林管理有限公司在富兰克林国海中国收益证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，富兰克林国海中国收益证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 172,480,833.10 元。

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

本托管人依法对国海富兰克林基金管理有限公司编制和披露的富兰克林国海中国收益证券投资基金 2011 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2012) 第 20530 号

富兰克林国海中国收益证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的富兰克林国海中国收益证券投资基金（以下简称“国富中国收益混合”）的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是国富中国收益混合的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述 国富中国收益混合 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了 国富中国收益混合 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司

注册会计师 薛竞 张振波

上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

2012-03-26

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海中国收益证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	7,865,426.17	11,995,174.47
结算备付金		1,403,702.65	4,121,376.55
存出保证金		848,780.49	1,274,878.91
交易性金融资产	7.4.7. 2	844,577,828.82	1,358,828,835.38
其中：股票投资		539,854,246.76	886,636,286.38
基金投资		-	-
债券投资		304,723,582.06	472,192,549.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7. 3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7. 4	-	-
应收证券清算款		4,230,632.71	-
应收利息	7.4.7. 5	3,205,581.33	6,131,573.36
应收股利		-	-
应收申购款		5,824,939.94	39,598.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7. 6	-	-
资产总计		867,956,892.11	1,382,391,437.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		552,175.43	115,434.95
应付管理人报酬		1,024,761.56	1,624,439.78
应付托管费		185,645.21	294,282.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7. 7	461,628.56	1,879,885.88
应交税费		1,900,163.40	1,560,503.40
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,452,283.26	1,350,259.75
负债合计		5,576,657.42	6,824,806.35
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,049,896,226.09	1,167,948,749.21
未分配利润	7.4.7.10	-187,515,991.40	207,617,881.67
所有者权益合计		862,380,234.69	1,375,566,630.88
负债和所有者权益总计		867,956,892.11	1,382,391,437.23

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.4774 元，基金份额总额 1,806,321,063.90 份。

7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海中国收益证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年12 月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12 月31日
一、收入		-187,127,981.76	98,323,708.65
1. 利息收入		8,453,598.74	15,831,422.35
其中：存款利息收入	7.4.7.11	302,040.35	533,079.93
债券利息收入		8,150,020.86	15,236,051.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,537.53	62,290.54
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,543,514.38	224,089,417.55
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,840,967.51	217,189,662.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-6,478,111.13	-1,628,774.81
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	4,180,658.00	8,528,530.34
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-199,736,750.37	-142,140,514.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填	7.4.7.17	611,655.49	543,383.58

列)			
减：二、费用		23,687,274.16	34,277,349.36
1. 管理人报酬		13,887,620.19	19,795,713.63
2. 托管费		2,515,873.19	3,586,180.12
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	6,391,589.95	9,322,182.29
5. 利息支出		447,449.04	1,121,652.79
其中：卖出回购金融资产支出		447,449.04	1,121,652.79
6. 其他费用	7.4.7.19	444,741.79	451,620.53
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-210,815,255.92	64,046,359.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-210,815,255.92	64,046,359.29

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：富兰克林国海中国收益证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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)	1,167,948,749.21	207,617,881.67	1,375,566,630.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-210,815,255.92	-210,815,255.92
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)	-118,052,523.12	-11,837,784.05	-129,890,307.17
其中：1. 基金申购款	309,159,513.44	23,712,939.06	332,872,452.50
2. 基金赎回款	-427,212,036.56	-35,550,723.11	-462,762,759.67
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)	-	-172,480,833.10	-172,480,833.10
五、期末所有者权益(基金净值)	1,049,896,226.09	-187,515,991.40	862,380,234.69
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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)	1,045,843,476.36	431,317,616.72	1,477,161,093.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	64,046,359.29	64,046,359.29
三、本期基金份额交易产生的基金净	122,105,272.85	134,259,431.96	256,364,704.81

值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	631,493,350.86	190,772,019.12	822,265,369.98
2. 基金赎回款	-509,388,078.01	-56,512,587.16	-565,900,665.17
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）	-	-422,005,526.30	-422,005,526.30
五、期末所有者权益（基金净值）	1,167,948,749.21	207,617,881.67	1,375,566,630.88

报告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：

基金管理公司负责人：李雄厚，主管会计工作负责人：董卫军，会计机构负责人：黄宇虹

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富兰克林国海中国收益证券投资基金(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”)证监基金字[2005]第 36 号《关于同意富兰克林国海中国收益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《富兰克林国海中国收益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人民币 671,504,027.15 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(2005)第 77 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海中国收益证券投资基金基金合同》于 2005 年 6 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 671,658,080.51 份基金份额，其中认购资金利息折合 154,053.36 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《富兰克林国海中国收益证券投资基金招募说明书》和《富兰克林国海中国收益证券投资基金基金份额拆分比例公告》的有关规定，本基金于 2007 年 5 月 15 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1.7204887030，并于 2007 年 5 月 16 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海中国收益证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行的股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的范围为：股票投资为基金资产的 20%-65%，债券为 35%-75%，现金类资产为 5%-20%。本基金的股票投资主要集中于具有良好分红记录的上市公司，该部分股票和债券投资比

例将不低于本基金资产的 80%。本基金的原业绩比较基准为： $40\% \times$ 新华富时 A200 指数 $+55\% \times$ 汇丰中国国债指数 $+5\% \times$ 同业存款利率，根据本基金的基金管理人发布的《国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下部分基金更改业绩比较基准和修改基金合同的公告》和《关于修改〈富兰克林国海中国收益证券投资基金基金合同〉的公告》，本基金的业绩比较基准自 2010 年 12 月 23 日起变更为： $40\% \times$ 富时中国 A200 指数 $+55\% \times$ 中债国债总指数(全价) $+5\% \times$ 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 2012 年 3 月 26 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海中国收益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 2011 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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其

变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考

类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	7,865,426.17	11,995,174.47
定期存款	-	-

其他存款	-	-
合计	7,865,426.17	11,995,174.47

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		655,157,961.14	539,854,246.76	-115,303,714.38
债券	交易所市场	178,994,039.77	174,935,582.06	-4,058,457.71
	银行间市场	128,999,386.35	129,788,000.00	788,613.65
	合计	307,993,426.12	304,723,582.06	-3,269,844.06
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		963,151,387.26	844,577,828.82	-118,573,558.44
项目		上年度末 2010年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		813,393,685.04	886,636,286.38	73,242,601.34
债券	交易所市场	187,800,969.67	198,995,549.00	11,194,579.33
	银行间市场	276,470,988.74	273,197,000.00	-3,273,988.74
	合计	464,271,958.41	472,192,549.00	7,920,590.59
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,277,665,643.45	1,358,828,835.38	81,163,191.93

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	5,239.91	8,653.40

应收定期存款利息		
应收其他存款利息		
应收结算备付金利息	631.70	1,442.50
应收债券利息	3,199,665.22	6,121,442.86
应收买入返售证券利息		
应收申购款利息		
其他	44.50	34.60
合计	3,205,581.33	6,131,573.36

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
交易所市场应付交易费用	460,291.06	1,875,491.54
银行间市场应付交易费用	1,337.50	4,394.34
合计	461,628.56	1,879,885.88

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	2,283.26	259.75
信息披露费	850,000.00	750,000.00
审计费	100,000.00	100,000.00
合计	1,452,283.26	1,350,259.75

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,009,434,056.93	1,167,948,749.21
本期申购	531,897,051.60	309,159,513.44
本期赎回（以“-”号填列）	-735,010,044.63	-427,212,036.56
本期末	1,806,321,063.90	1,049,896,226.09

注：注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	242,975,566.13	-35,357,684.46	207,617,881.67
本期利润	-11,078,505.55	-199,736,750.37	-210,815,255.92
本期基金份额交易产生的变动数	-15,643,123.64	3,805,339.59	-11,837,784.05
其中：基金申购款	53,731,384.90	-30,018,445.84	23,712,939.06
基金赎回款	-69,374,508.54	33,823,785.43	-35,550,723.11
本期已分配利润	-172,480,833.10	-	-172,480,833.10
本期末	43,773,103.84	-231,289,095.24	-187,515,991.40

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
活期存款利息收入	263,084.90	484,491.54
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	34,692.28	36,405.83
其他	4,263.17	12,182.56
合计	302,040.35	533,079.93

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
卖出股票成交总额	2,162,817,262.68	3,122,642,124.47
减：卖出股票成本总额	2,156,976,295.17	2,905,452,462.45
买卖股票差价收入	5,840,967.51	217,189,662.02

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	721,200,340.77	1,070,434,460.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	716,248,229.58	1,062,199,266.35
减：应收利息总额	11,430,222.32	9,863,968.66
债券投资收益	-6,478,111.13	-1,628,774.81

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
股票投资产生的股利收益	4,180,658.00	8,528,530.34
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,180,658.00	8,528,530.34

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
1. 交易性金融资产	-199,736,750.37	-142,140,514.83
——股票投资	-188,546,315.72	-147,175,956.39
——债券投资	-11,190,434.65	5,035,441.56
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-199,736,750.37	-142,140,514.83

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
基金赎回费收入	610,339.36	538,820.30
转换费收入	1,316.13	2,132.96
其他	-	-
印花税手续费返还	-	2,430.32
合计	611,655.49	543,383.58

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
交易所市场交易费用	6,387,427.45	9,311,207.29
银行间市场交易费用	4,162.50	10,975.00
合计	6,391,589.95	9,322,182.29

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	320,000.00	320,000.00
债券帐户维护费	18,000.00	18,000.00
银行汇划费用	6,741.79	13,620.53
合计	444,741.79	451,620.53

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 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、基金发起人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
国海证券股份有限公司(“国海证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
邓普顿国际股份有限公司(Templeton International, Inc.)	基金管理人的股东

注：1.根据国海证券股份有限公司董事会于2011年8月16日在巨潮资讯发布的《国海证券股份有限公司关于承继原国海证券有限责任公司各项业务的公告》以及桂林集琦药业股份有限公司董事会于2011年8月3日在巨潮资讯发布的《桂林集琦药业股份有限公司关于工商登记变更的提示公告》，国海证券有限责任公司借壳桂林集琦药业股份有限公司上市，国海证券有限责任公司于2011年7月6日办理了工商注销登记手续，桂林集琦药业股份有限公司于2011年8月1日办理了名称、经营范围及注册资本的工商登记变更手续。国海证券股份有限公司接收了原国海证券有限责任公司的全部资产、负债

和业务。

2.关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	549,020,789.05	13.26%	877,950,670.92	14.51%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期债券成 交总额的比 例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
国海证券	82,980,295.05	13.07%	25,406,579.49	7.88%

注：债券交易不计佣金。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期债券回 购成交总额 的比例	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例
国海证券	10,000,000.00	1.85%	0.00	0.00%

注：回购交易不计佣金。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011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	453,586.58	13.11%	180,654.98	39.25%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	713,626.42	14.14%	222,076.00	11.84%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费后的净额列示。

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,887,620.19	19,795,713.63
其中：支付销售机构的客户维护费	2,097,365.09	2,140,237.61

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 1.38% 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 × 1.38% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,515,873.19	3,586,180.12

注：支付基金托管人中国工商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。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2011年1月1日至2011年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	10,126,130.14	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	20,027,226.85	-	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期和上年度可比期间（2010年1月1日至2010年12月31日）基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本报告期末和上年度末（2010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。

7.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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
中国工商银行	7,865,426.17	263,084.90	11,995,174.47	484,491.54

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2011年1月1日至2011年12月31日				
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

				数量（单位：股/张）	总金额
国海证券	1180078	11 霍煤债 01	新债分销	100,000	10,000,000.00
上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

注：1、本基金在本报告期内向"11 霍煤债 01"主承销商华林证券认购了 1000 万元该公司债券，国海证券为该债券分销商之一。

2、本基金在上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	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	利润分配 合计	备注
2011	2011-03-24	2011-03-24	0.900	106,724,932.95	65,755,900.15	172,480,833.10	-
合计	-	-	0.900	106,724,932.95	65,755,900.15	172,480,833.10	-

7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于债券型基金而低于股票型基金，谋求稳定和可持续的长期收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险控制部负责投资风险管理与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，主要是发掘各类风险的风险点，判断风险发生的频度和损失，对风险实行分级管理。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的分析报告，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时对各种风险进行监控和评估，并通过风险处置流程，将风险控制在可承受的范围之内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险指在基金投资及交易过程中，因交易对手违约而产生的交割风险，以及基金所投资证券之发行人出现拒绝支付利息或到期拒绝支付本息的违约，或由于所投资证券或其发行人信用质量下降而导致证券价格下跌的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行的交

易均只与内部评估认可的交易对手库中的交易对手进行，并根据交易对手信用状况对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年末 2010 年 12 月 31 日
A-1	-	59,688,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	48,319,000.00	-
合计	48,319,000.00	59,688,000.00

注：未评级的债券投资为国债、中央银行票据及政策性金融债

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年末 2010 年 12 月 31 日
AAA	141,628,289.70	183,943,038.00
AAA 以下	48,128,989.36	50,348,511.00
未评级	66,647,303.00	178,213,000.00
合计	256,404,582.06	412,504,549.00
未评级	-	-
合计	-	-

注：未评级的债券投资为国债、中央银行票据及政策性金融债。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及资产支持证券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2011年12月31日					
资产					
银行存款	7,865,426.17	-	-	-	7,865,426.17
结算备付金	1,403,702.65	-	-	-	1,403,702.65
存出保证金	98,780.49	-	-	750,000.00	848,780.49
交易性金融资产	62,653.876.60	156,022.670.06	86,047.035.40	539,854.246.76	844,577.828.82
应收证券清算款	-	-	-	4,230,632.71	4,230,632.71
应收利息	-	-	-	3,205,581.33	3,205,581.33
应收申购款	-	-	-	5,824,939.94	5,824,939.94
资产总计	72,021,785.91	156,022.670.06	86,047.035.40	553,865.400.74	867,956.892.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	552,175.43	552,175.43
应付管理人报酬	-	-	-	1,024,761.56	1,024,761.56
应付托管费	-	-	-	185,645.21	185,645.21
应付交易费用	-	-	-	461,628.56	461,628.56
应交税费	-	-	-	1,900,163.40	1,900,163.40
其他负债	-	-	-	1,452,283.26	1,452,283.26
负债总计	-	-	-	5,576,657.42	5,576,657.42
利率敏感	72,021,78	156,022,6	86,047,03	548,288,7	862,380,2

度缺口	5.91	70.06	5.40	43.32	34.69
上年度末 2010年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,995,17 4.47	-	-	-	11,995,17 4.47
结算备付 金	4,121,376 .55	-	-	-	4,121,376 .55
存出保证 金	98,780.49	-	-	1,176,098 .42	1,274,878 .91
交易性金 融资产	196,481,2 02.20	120,693,9 96.00	155,017,3 50.80	886,636,2 86.38	1,358,828 ,835.38
应收利息	-	-	-	6,131,573 .36	6,131,573 .36
应收申购 款	-	-	-	39,598.56	39,598.56
资产总计	212,696,5 33.71	120,693,9 96.00	155,017,3 50.80	893,983,5 56.72	1,382,391 ,437.23
负债					
应付赎回 款	-	-	-	115,434.9 5	115,434.9 5
应付管理 人报酬	-	-	-	1,624,439 .78	1,624,439 .78
应付托管 费	-	-	-	294,282.5 9	294,282.5 9
应付交易 费用	-	-	-	1,879,885 .88	1,879,885 .88
应交税费	-	-	-	1,560,503 .40	1,560,503 .40
其他负债	-	-	-	1,350,259 .75	1,350,259 .75
负债总计	-	-	-	6,824,806 .35	6,824,806 .35

利率敏感	212,696,5	120,693,9	155,017,3	887,158,7	1,375,566
度缺口	33.71	96.00	50.80	50.37	,630.88

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
	1. 市场利率下降 25 个基点	增加约 289 万元	增加约 220 万元
	2. 市场利率上升 25 个基点	下降约 286 万元	下降约 219 万元

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 20%-65%，债券为 35%-75%，现金类资产为 5%-20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	539,854,246.76	62.60	886,636,286.38	64.46
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	539,854,246.76	62.60	886,636,286.38	64.46

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除富时中国 A200 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	富时中国 A200 指数上 升 5%	增加约 2,672 万元	增加约 4,212 万元
	富时中国 A200 指数下 降 5%	下降约 2,672 万元	下降约 4,212 万元

7.4.14 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) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 714,789,828.82 元，属于第二层级的余额为 129,788,000.00 元，无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第一层级 1,085,631,835.38 元，第二层级 273,197,000.00 元，无第三层级)。

(iii) 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，本基金分别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不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；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级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	539,854,246.76	62.20
	其中：股票	539,854,246.76	62.20
2	固定收益投资	304,723,582.06	35.11

	其中：债券	304,723,582.06	35.11
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	9,269,128.82	1.07
6	其他各项资产	14,109,934.47	1.63
7	合计	867,956,892.11	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	36,615,544.60	4.25
C	制造业	313,408,275.96	36.34
C0	食品、饮料	17,784,894.05	2.06
C1	纺织、服装、皮毛	25,175,000.00	2.92
C2	木材、家具	11,197,846.88	1.30
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	27,369,446.65	3.17
C5	电子	14,873,193.94	1.72
C6	金属、非金属	31,238,344.40	3.62
C7	机械、设备、仪表	149,019,091.29	17.28
C8	医药、生物制品	36,750,458.75	4.26
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	23,639,479.92	2.74
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	27,644,295.00	3.21
H	批发和零售贸易	116,412,651.28	13.50
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	22,134,000.00	2.57
M	综合类	-	-
	合计	539,854,246.76	62.60

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600582	天地科技	2,454,514	45,408,509.00	5.27
2	600312	平高电气	4,499,909	37,574,240.15	4.36
3	002024	苏宁电器	4,025,295	33,973,489.80	3.94
4	002230	科大讯飞	789,837	27,644,295.00	3.21
5	601699	潞安环能	1,300,000	27,508,000.00	3.19
6	600688	S 上石化	4,599,907	27,369,446.65	3.17
7	600697	欧亚集团	1,000,800	26,671,320.00	3.09
8	600276	恒瑞医药	900,000	26,496,000.00	3.07
9	002291	星期六	2,500,000	25,175,000.00	2.92
10	300090	盛运股份	2,543,485	24,213,977.20	2.81
11	600970	中材国际	1,499,967	23,639,479.92	2.74
12	600875	东方电气	1,000,000	23,110,000.00	2.68
13	300027	华谊兄弟	1,400,000	22,134,000.00	2.57
14	600858	银座股份	1,000,000	19,620,000.00	2.28
15	600859	王府井	600,000	19,266,000.00	2.23
16	600597	光明乳业	1,987,139	17,784,894.05	2.06
17	600585	海螺水泥	999,910	15,648,591.50	1.81
18	600563	法拉电子	928,994	14,873,193.94	1.72
19	000410	沈阳机床	2,029,890	13,965,643.20	1.62
20	601996	丰林集团	1,255,364	11,197,846.88	1.30
21	002022	科华生物	1,000,435	10,254,458.75	1.19
22	600348	阳泉煤业	599,970	9,107,544.60	1.06
23	002563	森马服饰	239,242	9,076,841.48	1.05
24	000012	南玻 A	1,000,000	9,060,000.00	1.05
25	000061	农产品	700,000	7,805,000.00	0.91
26	600425	青松建化	551,034	6,529,752.90	0.76
27	002334	英威腾	188,138	4,746,721.74	0.55

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	601699	潞安环能	124,851,051.20	9.08
2	002024	苏宁电器	112,580,988.62	8.18
3	600312	平高电气	86,111,347.99	6.26
4	600582	天地科技	71,058,833.69	5.17
5	600858	银座股份	55,438,764.68	4.03
6	600875	东方电气	50,500,655.22	3.67
7	002073	软控股份	49,113,125.82	3.57
8	600585	海螺水泥	47,664,835.07	3.47
9	600048	保利地产	43,627,387.78	3.17
10	600089	特变电工	43,542,914.52	3.17
11	600030	中信证券	42,915,847.11	3.12
12	600697	欧亚集团	41,456,737.08	3.01
13	600688	S 上石化	40,587,517.99	2.95
14	002140	东华科技	40,140,733.41	2.92
15	600276	恒瑞医药	37,331,230.61	2.71
16	600395	盘江股份	36,537,700.09	2.66
17	601318	中国平安	36,311,121.87	2.64
18	000597	东北制药	35,016,178.91	2.55
19	000933	神火股份	34,129,271.34	2.48
20	601939	建设银行	32,301,011.86	2.35
21	600016	民生银行	32,218,921.11	2.34
22	600801	华新水泥	31,040,698.04	2.26
23	002022	科华生物	30,115,815.76	2.19
24	300090	盛运股份	30,042,989.77	2.18
25	600718	东软集团	29,823,664.91	2.17
26	600970	中材国际	29,531,632.16	2.15
27	000012	南 玻 A	27,851,020.30	2.02
28	600123	兰花科创	27,678,047.64	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	601699	潞安环能	97,902,233.37	7.12
2	600312	平高电气	81,619,823.85	5.93
3	002024	苏宁电器	80,462,466.58	5.85
4	600801	华新水泥	73,519,566.39	5.34
5	000060	中金岭南	68,048,400.54	4.95
6	601101	昊华能源	61,473,643.99	4.47
7	300070	碧水源	61,152,721.17	4.45

8	600585	海螺水泥	60,477,254.16	4.40
9	000061	农产品	59,895,488.55	4.35
10	000826	桑德环境	56,585,283.16	4.11
11	600690	青岛海尔	55,972,032.16	4.07
12	600519	贵州茅台	54,277,661.86	3.95
13	600362	江西铜业	52,432,113.36	3.81
14	000983	西山煤电	51,633,691.37	3.75
15	600276	恒瑞医药	49,981,056.14	3.63
16	002073	软控股份	47,456,285.40	3.45
17	002140	东华科技	45,440,083.10	3.30
18	600089	特变电工	43,172,923.18	3.14
19	600030	中信证券	42,762,496.48	3.11
20	300027	华谊兄弟	40,713,004.80	2.96
21	600048	保利地产	39,613,575.89	2.88
22	601318	中国平安	36,888,480.91	2.68
23	600016	民生银行	35,437,891.70	2.58
24	600395	盘江股份	35,292,165.42	2.57
25	000597	东北制药	34,911,383.29	2.54
26	000933	神火股份	33,448,681.49	2.43
27	601939	建设银行	32,645,962.23	2.37
28	600425	青松建化	31,392,788.33	2.28
29	600858	银座股份	30,058,795.45	2.19

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,998,740,571.27
卖出股票的收入（成交）总额	2,162,817,262.68

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,378,303.00	0.62
2	央行票据	48,319,000.00	5.60
3	金融债券	61,269,000.00	7.10
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	106,681,743.66	12.37
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	83,075,535.40	9.63
8	其他	-	-
9	合计	304,723,582.06	35.34

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	826,540	83,075,535.40	9.63
2	1101094	11 央票 94	400,000	38,656,000.00	4.48
3	110417	11 农发 17	300,000	30,906,000.00	3.58
4	110317	11 进出 17	300,000	30,363,000.00	3.52
5	122065	11 上港 01	241,570	25,246,480.70	2.93

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	848,780.49
2	应收证券清算款	4,230,632.71
3	应收股利	-

4	应收利息	3,205,581.33
5	应收申购款	5,824,939.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,109,934.47

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	83,075,535.40	9.63

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
48,085	37,565.17	605,419,561.41	33.52%	1,200,901,502.49	66.48%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	0.00	0%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2005年6月1日)基金份额总额	671,658,080.51
本报告期期初基金份额总额	2,009,434,056.93
本报告期基金总申购份额	531,897,051.60
减：本报告期基金总赎回份额	735,010,044.63

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,806,321,063.90

§ 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二届董事会第二十八次会议审议通过，金哲非女士不再担任公司总经理，由副总经理李雄厚先生代为履行总经理职务。相关公告已于 2011 年 5 月 4 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露。

2、经国海富兰克林基金管理有限公司第三届董事会第二次会议决议审议通过，由李雄厚先生担任公司总经理。相关公告已于 2011 年 9 月 30 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露。

(二) 基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 100000.00 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未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

(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，本基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东海证券	1	1,570,698,641.64	37.93%	1,335,089.69	38.60%	-
国泰君安	1	1,082,594,488.96	26.14%	879,615.25	25.43%	-
国金证券	2	681,213,910.32	16.45%	571,991.65	16.54%	-
国海证券	2	549,020,789.05	13.26%	453,586.58	13.11%	-
海通证券	1	162,547,418.00	3.93%	138,163.51	3.99%	-
申银万国	1	94,807,089.98	2.29%	80,585.58	2.33%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
广发证券	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
- 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) 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租用与变更情况

报告期内，根据上述基金专用报告期内，根据上述基金专用交易单元选择标准和程序，本基金逐步租用证券公司的交易单元合计 11 个：国海证券、国金证券各 2 个、中金公司、广发证券、申银万国证券、国泰君安证券、海通证券、中信金通证券和东海证券各 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东海证券	286,223,962.87	45.07%	217,800,000.00	40.24%	-	-
国泰君安	11,849,798.84	1.87%	-	-	-	-
国金证券	178,155,720.79	28.05%	283,400,000.00	52.37%	-	-
国海证券	82,980,295.05	13.07%	10,000,000.00	1.85%	-	-
海通证券	67,889,156.55	10.69%	-	-	-	-

申银万国	8,004,234.04	1.26%	30,000,000.00	5.54%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富兰克林国海中国收益证券投资基金更新招募说明书（2011 年 1 号）	在基金管理人公司网站披露	2011-1-13
2	富兰克林国海中国收益型证券投资基金更新招募说明书摘要（2011 年 1 号）	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-1-13
3	富兰克林国海中国收益证券投资基金 2010 年第 4 季度报告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-1-24
4	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加海通证券股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-2-18
5	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金通过交通银行股份有限公司开办定期定额投资业务以及相关定期定额费率优惠活动的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-2-19
6	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金通过广发华福证券有限责任公司开办定期定额投资业务的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-3-7
7	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金通过中国光大银行股份有限公司开通旗下开放式基金基金转换业务的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-3-7
8	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金通过天相投资顾问有限公司开办定期定额投资业务的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-3-8
9	澄清公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-3-10
10	富兰克林国海中国收益证券投资基金分红	在中国证券报、上海	2011-3-22

	公告	证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	
11	富兰克林国海中国收益证券投资基金 2010 年年度报告（正文）	在基金管理人公司网站披露	2011-3-26
12	富兰克林国海中国收益证券投资基金 2010 年年度报告（摘要）	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-3-26
13	关于与通联支付网络服务有限公司合作开通中国光大银行借记卡、平安银行借记卡、中国工商银行借记卡基金网上交易支付并实施申购费率优惠的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-3-28
14	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加华夏银行股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-4-1
15	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加华夏银行股份有限公司网上交易基金费率优惠活动的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-4-1
16	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金认购 2011 年内蒙古霍林河煤业集团有限责任公司公司债券的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-4-18
17	富兰克林国海中国收益证券投资基金 2011 年第 1 季度报告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-4-23
18	国海富兰克林基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-5-4
19	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金通过中信证券股份有限公司开通旗下开放式基金基金转换及定期定额投资业务的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-5-30
20	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中信银行股份有限公司网上交易基金申购费率优惠活动的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-6-29
21	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网上交易基金申购费率优惠活动的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管	2011-6-30

		理人公司网站披露	
22	富兰克林国海中国收益证券投资基金更新招募说明书（2011 年 2 号）	在基金管理人公司网站披露	2011-7-14
23	富兰克林国海中国收益证券投资基金更新招募说明书摘要（2011 年 2 号）	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-7-14
24	关于与通联支付合作开通浦东发展银行借记卡支付并实施申购费率优惠的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-7-16
25	富兰克林国海中国收益证券投资基金 2011 年第 2 季度报告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-7-19
26	国海富兰克林基金管理有限公司关于公司股东更名的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-8-16
27	富兰克林国海中国收益证券投资基金 2011 年半年度报告（正文）	在基金管理人公司网站披露	2011-8-29
28	富兰克林国海中国收益证券投资基金 2011 年半年度报告（摘要）	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-8-29
29	国海富兰克林基金管理有限公司办公地址变更公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-9-28
30	国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-9-30
31	富兰克林国海中国收益证券投资基金 2011 年第 3 季度报告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-10-28
32	关于增加长江证券股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-12-19
33	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金通过长江证券股份有限公司开通旗下开放式基金基金转换业务、定期定额投资业	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管	2011-12-19

	务及相关申购费率优惠活动的公告	理人公司网站披露	
34	关于增加中信万通证券有限责任公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-12-28
35	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金通过中信万通证券有限责任公司开通开放式基金基金转换及定期定额投资业务的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-12-28
36	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-12-30
37	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上交易基金申购费率优惠活动的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-12-30
38	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加华夏银行股份有限公司基金定期定额投资、网上申购业务以及相关费率优惠活动的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-12-30

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海中国收益证券投资基金设立的文件
- 2、《富兰克林国海中国收益证券投资基金基金合同》
- 3、《富兰克林国海中国收益证券投资基金招募说明书》
- 4、《富兰克林国海中国收益证券投资基金托管协议》
- 5、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站：www.ftsfund.com

12.3 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、登陆基金管理人网站 www.ftsfund.com 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

二〇一二年三月二十九日