

# 富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金

2009 年半年度报告（摘要）

2009 年 6 月 30 日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇〇九年八月二十八日

## 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。本半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 2009 年 8 月 24 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	国富强化收益债券	
交易代码	450005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年10月24日	
报告期末基金份额总额	273,801,342.04份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	国富强化收益债券A	国富强化收益债券C
下属两级基金的交易代码	450005	450006
报告期末下属两级基金的份额总额	261,435,466.54	12,365,875.50

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过主动的资产管理，在严格控制风险、保证资产充分流动性的基础上，力求为投资者创造持续稳定的投资回报。
投资策略	<p>1、固定收益类品种投资策略： 本基金将采取积极主动的投资策略，以中长期利率趋势分析为主，结合经济周期、宏观经济运行中的价格指数、资金供求分析、货币政策、财政政策研判及收益率曲线分析，在保证流动性和风险可控的前提下，实施积极的债券投资组合管理。</p> <p>2、动态收益增强策略： 本基金根据债券市场的动态变化，采取多种灵活的策略，获取超额收益。</p> <p>3、股票投资策略： 本基金主要采用“自下而上”的投资策略，将定量的股票筛选和定性的公司深度研究</p>

	<p>相结合，精选具有稳定的现金分红能力和持续的盈利增长预期，且估值合理的优质上市公司股票。</p> <p>4、可转债投资策略： 可转债的选择结合其债性和股性特征，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券，获取稳健的投资回报。</p>
业绩比较基准	中债总指数（全价）
风险收益特征	本基金属债券型证券投资基金，属于证券投资基金中的低风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于混合型基金，高于货币市场基金。

### 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	胡定超	宁敏
	联系电话	021-3855 5555	010-66594977
	电子邮箱	service@ftsfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4007004518、95105680 和 021-38789555	95566
传真		021-6888 0981	010-66594942

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的 管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人处

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期（2009年1月1日 - 2009年6月30日）	
	国富强化收益债券 A	国富强化收益债券 C
本期已实现收益	10,067,665.44	1,476,745.71
本期利润	877,275.50	431,185.76
加权平均基金份额本期利润	0.0024	0.0080
本期基金份额净值增长率	0.89%	0.81%
3.1.2 期末数据和指标	2009年6月30日	
	国富强化收益债券 A	国富强化收益债券 C
期末可供分配基金份额利润	0.0268	0.0260
期末基金资产净值	269,707,630.29	12,746,732.48
期末基金份额净值	1.0316	1.0308

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

###### 1. 国富强化收益债券 A

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
过去一个月	-0.33%	0.06%	-0.69%	0.06%	0.36%	0.00%
过去三个月	0.35%	0.08%	-0.24%	0.06%	0.59%	0.02%
过去六个月	0.89%	0.16%	0.63%	0.07%	0.26%	0.09%

自基金合同生效起至今	4.16%	0.14%	3.57%	0.09%	0.59%	0.05%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

## 2. 国富强化收益债券 C

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
过去一个月	-0.33%	0.06%	-0.69%	0.06%	0.36%	0.00%
过去三个月	0.32%	0.08%	-0.24%	0.06%	0.56%	0.02%
过去六个月	0.81%	0.13%	0.63%	0.07%	0.18%	0.06%
自基金合同生效起至今	0.93%	0.13%	1.14%	0.07%	-0.21%	0.06%

### 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

富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金

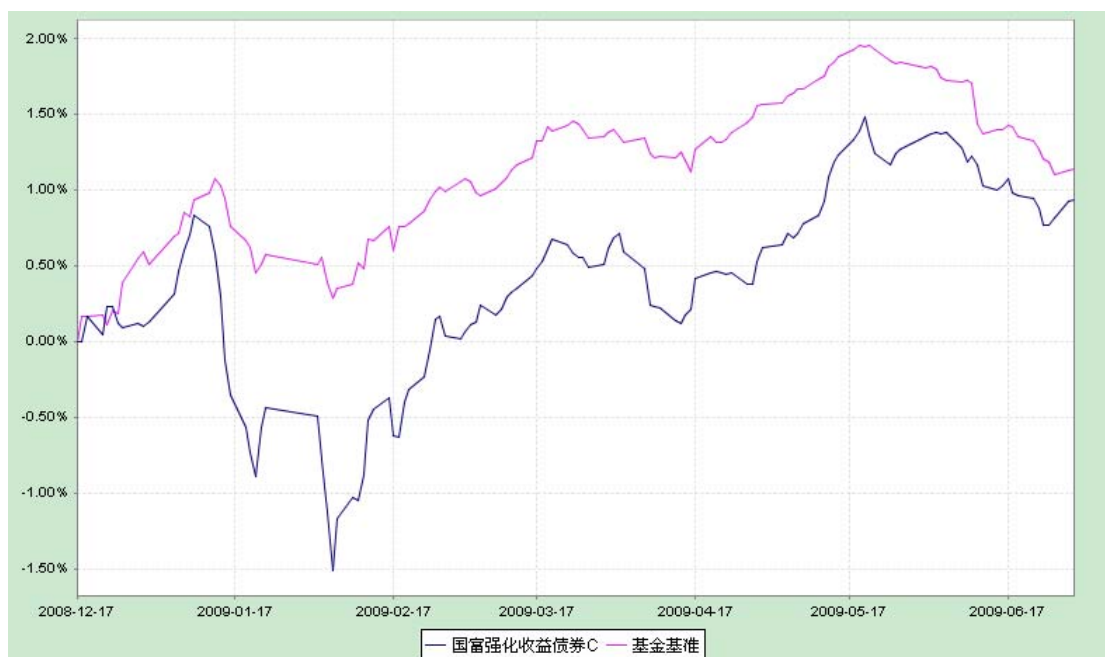
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2008 年 10 月 24 日至 2009 年 6 月 30 日）

#### 1、国富强化收益债券 A



## 2、国富强化收益债券 C



注：1、本基金合同于 2008 年 10 月 24 日生效，截至报告日本基金合同生效未  
 满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 3 个月内为建仓期，截至建仓  
 期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（二）投资范围“对固定收  
 益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中现金或到期日在一年以内的政  
 府债券不低于基金资产净值的 5%”，“本基金投资于固定收益类资产以外的其  
 它资产（包括股票、权证等）的比例不超过基金资产的 20%”。

3、本基金于 2008 年 12 月 18 日推出 C 类收费模式。

## 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，由国海证券有限责任公司和富兰克林邓普顿基金集团全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建，注册资本为人民币壹亿元。2005 年底，经中国证监会批准，股东出资在现有股东之间进行了转让，转让后国海证券有限责任公司出资比例为 51%，邓普顿国际股份有限公司为 49%，公司注册资本保持不变。2006 年 8 月，经公司股东会 2006 年第二次临时会议决议，公司的注册资本由人民币壹亿元增加至人民币壹亿伍仟万元。该项增资扩股申请已于 2006 年 11 月获中国证监会批准，增资后双方股东出资比例保持不变，相关工商注册变更手续已于 2007 年 1 月初办理完毕并公告。2007 年 12 月，经国海富兰克林基金管理有限公司股东会审议通过，国海富兰克林基金管理有限公司的注册资本由人民币壹亿伍仟万元增加为人民币贰亿贰仟万元，增资后原股东持股比例保持不变，已经中国证券监督管理委员会批准，相关工商注册变更登记手续已完成。

我公司具有丰富的管理基金经验，从 2005 年 6 年第一只基金成立到现在，已经成功管理了 6 只基金产品（包含 A、C 类债券基金）。6 只基金业绩优秀，丰富优秀的基金管理能力也获得多方权威机构好评。

1. 据国金证券基金研究中心 2008 年 9 月 19 日公布的《2008 年第二期基金公司评价报告》显示：国海富兰克林基金公司投资管理能力和经营能力获得五星级评价，结合基本实力、投资管理能力和经营能力三方面的综合实力获得四星级评价。

2. 据银河基金研究中心 2009 年 1 月 1 日公布的“2008 年基金公司管理能力排名报告”显示：在参与综合管理能力评价的 46 家公司中，国海富兰克林基金 2008 年权益类产品管理能力排名位于第 5，2007-2008 连续两年权益类产品管理能力排名始终居于前 10。

3. 证券时报 2009 年 1 月 14 日公布：我公司荣获“2008 年度资产配置明星基金公司奖”。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘怡敏	本基金基金经理	2008-10-24	-	5 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。现任富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金基金经理。

#### 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《富兰克林国海强化收益债券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，公司共管理了六只基金，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和富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金，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，其余四只基金为股票型基金，公司尚未开展企业年金、社保基金资产管理及特定客户资产管理业务。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说明

2009 年上半年，在经济复苏和通货膨胀预期的影响下，国内债券市场全面下跌。以美国为首的世界经济体系在金融动荡后初步企稳，流动性和通胀预期影响下大宗商品价格大幅上涨，美国国债收益率大幅度上扬。国内由政府主导的四万亿投资加快了经济复苏的进程，截止到 6 月，固定资产投资增长率已经上升到 33.6%，6 月房地产开发投资增长率也从年初的 5%增加到了 15.3%。尽管外需复苏的迹象仍比较弱，但是内需复苏快于预期，前两季度 GDP 增长率达到 7.1%

2009 年一季度债券市场出现了深幅和快速下跌。针对这一情况，本基金果断的降低久期，减少了市场下跌中的损失。投资时钟模型在经济处于谷底期建议减少利率产品的持有，增加信用债券及权益类资产的配置。本基金在一季度增持了信用产品及可转换债券，取得了较好的投资回报。

第二季度债市出现一定的反弹，强债基金在反弹中继续降低了久期。第二季度有针对性的增持部分信用利差较高的信用债，减持了部分估值偏高的可转换债券，并适度增加股票资产的投资。

整体来看，国富强化收益债券 A 基金 2009 年一至六月投资收益为 0.89%，同期业绩比较基准收益率为 0.63%，基金战胜比较基准 26 个基点。国富强化收

益债券 C 基金 2009 年一至六月投资回报为 0.81%，战胜比较基准 0.18 个基点。正确的选时、执行短久期策略及板块配置策略是本基金战胜比较基准的主要因素。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

以美国为首的世界经济体系在金融动荡后初步企稳，第二季度大宗商品价格继续上涨，原油期货价格突破 70 美元，美国国债收益率大幅度上扬。由于通缩风险的降低和潜在的通胀抬头，美联储近期开始微幅回笼货币，这一举措对美元形成支撑，进而对全球通胀预期产生一定的抑制。

在政府支出的扶持下，中国经济显示出良好弹性。第二季度经济指标开始触底回升，表现在发电量、工业增加值等方面。PMI 指数持续 4 个月超过 50，显示经济增长摆脱衰退阴影的迹象。本轮经济反弹主要是在投资增长的带动下开展的，初期主要是政府部门主导的基础建设投资为主，进入二季度后，房地产开发投资跟进，增长幅度从年初的 5% 上升到 15.3%。可以认为，前期的财政、货币双宽松的政策对刺激中国经济起到了一定的作用。受此影响，第二季度债券市场继续走弱，投资时钟偏向权益类商品和具有通胀属性的大宗商品。但应该看到，目前外需仍然偏弱。

今年一至二季度债券市场收益率大幅度上升。二季度 IPO 开闸的消息成为债市调整的导火索。IPO 开闸影响了市场无风险收益率的定位，并对信用债市持有收益率产生比价效应。由于交易所信用债的投资主体特征，在 IPO 引发的信用债调整中，交易所的信用利差上升幅度大大超过银行间市场。

近期一年期央票的重新启动带来较强紧缩预期，债券市场收益率水平整体上升，尤其是收益率曲线短端上升幅度较大，修正了前期过于陡峭的收益率曲线。短期来看，受到公开市场操作以及大盘股 IPO 的影响，债券市场的风险没有完全释放。但是目前全球经济二次探底的风险还未完全消除，物价还处在去通货紧缩的过程中，货币政策全面收紧的风险较低。第三季度基准利率保持不变的情况下，收益率曲线继续大幅度上移的风险较小。第三季度对债市的利好因素应该是新增信贷额可能会显著下降。但是宏观经济指标的继续向好可能会抵消一部分资金面的利好因素。

考虑风险溢价后，目前的信用利差比较有吸引力，本基金将从中长期投资角度关注信用债券的投资。由于宏观经济向好，投资对象将向资质处于中间水平的信用债券过渡。未来一到二个季度，在流动性支撑和业绩预期改善的支撑下，股市可能继续走好。本基金将在在考虑流动性及估值合理的基础上适度增加权益类资产配置。新股 IPO 开闸将带来新的投资机会，包括可转换债券的品种将更为丰富。目前二级市场可转换债券估值较高，新券发行可能提高可转债板块的吸引力，本基金将重点关注此类债券的投资机会。

#### 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”），并修订了《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投资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，可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

本基金于 2009 年 3 月 25 日宣告分红，向截至 2009 年 3 月 26 日止在本基金注册登记人国海富兰克林基金管理有限公司登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额 0.10 元派发现金红利。该分红的发放日为 2009 年 3 月 30 日，共发放红利 4,392,338.63 元，其中以现金形式发放 3,967,432.92 元，以红利再投资形式发放 424,905.71 元。根据相关法律法规和基金合同要求，所实现的收益将继续根据市场情况进行分红。

## 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”）在对富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金（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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据核对无误。（注：财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内。）

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金

报告截止日：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	18,020,183.49	9,988,819.30
结算备付金		28,116.47	10,236,344.87
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	266,512,502.87	719,004,670.19
其中: 股票投资		7,680,200.00	-
债券投资		258,832,302.87	719,004,670.19
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,362,560.96	-
应收利息	6.4.7.5	3,854,565.95	4,435,556.30
应收股利		-	-
应收申购款		693,391.83	42,740,490.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		292,471,321.57	786,405,880.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 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		-	-
应付赎回款		9,519,569.56	6,920,693.55
应付管理人报酬		155,589.87	325,221.80
应付托管费		51,863.29	108,407.25
应付销售服务费		4,594.32	12,678.03
应付交易费用	6.4.7.7	11,251.19	13,761.70
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	274,090.57	162,240.35
负债合计		10,016,958.80	7,543,002.68
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	273,801,342.04	754,322,578.46
未分配利润	6.4.7.10	8,653,020.73	24,540,299.80

所有者权益合计		282,454,362.77	778,862,878.26
负债和所有者权益总计		292,471,321.57	786,405,880.94

注：1. 报告截止日 2009 年 6 月 30 日，

国富强债 A 类基金份额净值 1.0316 元，基金份额总额 261,435,466.54 份。

国富强债 C 类基金份额净值 1.0308 元，基金份额总额 12,365,875.50 份。

国富强债 A 类基金和国富强债 C 类基金的合计份额总额 273,801,342.04 份。

2. 后附会计报表附注为本会计报表的组成部分

## 6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>3,393,857.90</b>
1.利息收入		6,388,229.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	136,375.68
债券利息收入		6,251,280.30
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		573.63
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,032,464.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-87,146.00
债券投资收益	6.4.7.13	7,119,610.46
资产支持证券投资		-
收益		
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-10,235,949.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”	6.4.7.17	209,113.72

号填列)		
二、费用（以“-”号填列)		<b>-2,085,396.64</b>
1. 管理人报酬		-1,307,321.37
2. 托管费		-435,773.86
3. 销售服务费		-86,167.94
4. 交易费用	6. 4. 7. 18	-24,224.91
5. 利息支出		-49,648.04
其中：卖出回购金融资产支出		-49,648.04
6. 其他费用	6. 4. 7. 19	-182,260.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		<b>1,308,461.26</b>
所得税费用（以“-”号填列)		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		1,308,461.26

注：1、本基金合同生效日为 2008 年 10 月 24 日，上表中无上年度可比期间数据。

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 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)	754,322,578.46	24,540,299.80	778,862,878.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,308,461.26	1,308,461.26
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)	-480,521,236.42	-12,803,401.70	-493,324,638.12
其中：1. 基金申购款	332,079,273.98	11,296,262.66	343,375,536.64
2. 基金赎回款（以“-”号填列)	-812,600,510.40	-24,099,664.36	-836,700,174.76

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)	-	-4,392,338.63	-4,392,338.63
五、期末所有者权益(基金净值)	273,801,342.04	8,653,020.73	282,454,362.77

注：本基金合同生效日为 2008 年 10 月 24 日，上表中无上年度可比期间数据。

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金(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[2008]第 1049 号《关于核准富兰克林国海强化收益债券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《富兰克林国海强化收益债券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人民币 1,074,710,139.32 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(2008)第 155 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金基金合同》于 2008 年 10 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,074,835,078.73 份基金份额，其中认购资金利息折合 124,939.41 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《富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金基金合同》和《关于富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金基金合同修改的公告》并报中国证监会备案，自 2008 年 12 月 18 日起，本基金根据费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的，称为 A 类；不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海强化收益债券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国内依法公开发行、上市的债券、股票、权证及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；本基金投资于固定收益类资产以外的其它资产（包括股票、权证等）的比例不超过基金资产的 20%。本基金的业绩比较基准为：中债总指数（全价）。

#### **6.4.2 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”）、中国证监会基金部通知[2009]4 号关于发布《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〉（试行）》等问题的通知、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》、《富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金本期间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 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及本期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **6.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

#### (i) 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和债券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。以公允价值计量且其变动计入当期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。

#### (ii) 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。

#### 6.4.4.4 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；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，应当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。

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，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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(i) 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。

(ii) 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。

(iii) 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### **6.4.4.8 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。

#### **6.4.4.9 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。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

#### **6.4.4.11 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息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息日从所有者权益转出。

#### **6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

无。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

无。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

无。

#### **6.4.6 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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 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。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日之前按照 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起至 2008 年 9 月 18 日止按 0.1% 的税率缴纳。自 2008 年 9 月 19 日起基金卖出股票按 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。

#### 6.4.7 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、基金代销机构
国海证券有限责任公司(“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：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。

#### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

报告期内本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国银行	基金托管人、基金代销机构
国海证券	基金管理人的股东、基金代销机构

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国海证券	10,413,212.20	100.00%

#### 6.4.8.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国海证券	177,616,591.83	100.00%

#### 6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国海证券	5,000,000.00	100.00%

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30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	8,851.19	100.00%	8,851.19	100.00%

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、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年 6月30日
当期应支付的管理费	1,307,321.37
其中：当期已支付	1,151,731.50
期末未支付	155,589.87

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 0.6%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 X 0.6% / 当年天数。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年 6月30日
当期应支付的托管费	435,773.86
其中：当期已支付	383,910.57
期末未支付	51,863.29

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 0.20%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 X 0.20% / 当年天数。

##### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2009年1月1日-2009年6月30日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
中国银行	79,465.50	3,905.75	83,371.25
国海证券	15.28	2.12	17.40
合计	79,480.78	3,907.87	83,388.65

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.3%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国海富兰克林基金管理有限公司，再由国海富兰克林基金管理有限公司计算并支付给各基金销售

机构。其计算公式为：日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金份额对应的资产净值 × 0.3% / 当年天数。

### 6.4.8.3 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 2009年1月1日 - 2009年6月30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 银行	103,545,414.7 9	380,164,042.4 7	0.00	0.00	0.00	0.00

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 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 2009年1月1日 - 2009年6月30日	
	国富强化收益债券 A	国富强化收益债券 C
期初持有的基金份额	-	-
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总 份额	29,181,906.61	-
期间因拆分增加的 份额	-	-
期间赎回/卖出总 份额	-	-
期末持有的基金 份额	29,181,906.61	-
期末持有的基金 份额占基金总份 额比例	11.16%	-

注：上年度可比期间（2008年1月1日至2008年6月30日）本基金尚未成立，本基金于2008年10月24日基金合同生效。

#### 6.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2009 年 6 月 30 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
无	0	0	0	0

注：本报告期末和上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 6.4.8.5 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 2009年1月1日 - 2009年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	18,020,183.49	115,474.33

#### 6.4.8.6 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

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日	
				基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国海证券有 限责任公司	122983	09 南钢联债	公募	200,000.00	20,000,000.00
国海证券有 限责任公司	122982	09 长春城开 债	公募	200,000.00	20,000,000.00
国海证券有 限责任公司	122972	09绵阳投控 债	公募	100,000.00	10,000,000.00

注：1. 本基金向主承销商南京证券认购了“09 南钢联债”，国海证券为该债券分销商之一。

2. 本基金向主承销商国信证券认购了“09 长春城开债”，国海证券为该债券副主承销商。

3. 本基金向主承销商国信证券认购了“09 绵阳投控债”，国海证券为该债券分销商之一。

#### 6.4.9 期末（2009 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末本基金未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

报告期末本基金未持有暂时停牌股票。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

报告期末本基金没有正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末，本基金没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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	7,680,200.00	2.63
	其中：股票	7,680,200.00	2.63
2	固定收益投资	258,832,302.87	88.50
	其中：债券	258,832,302.87	88.50
	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	18,048,299.96	6.17
6	其他资产	7,910,518.74	2.70
7	合计	292,471,321.57	100.00

## 7.2 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（%）
1	农、林、牧、渔业	-	-
2	采掘业	-	-
3	制造业	7,680,200.00	2.72
4	食品、饮料	-	-
5	纺织、服装、皮毛	-	-
6	木材、家具	-	-
7	造纸、印刷	-	-
8	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
9	电子	-	-
10	金属、非金属	-	-
11	机械、设备、仪表	-	-
12	医药、生物制品	7,680,200.00	2.72
13	其他制造业	-	-
14	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
15	建筑业	-	-
16	交通运输、仓储业	-	-
17	信息技术业	-	-
18	批发和零售贸易	-	-
19	金融、保险业	-	-
20	房地产业	-	-
21	社会服务业	-	-
22	传播与文化产业	-	-
23	综合类	-	-
24	合计	7,680,200.00	2.72

## 7.3 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	600276	恒瑞医药	220,000	7,680,200.00	2.72

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	600276	恒瑞医药	7,700,358.20	0.99
2	600019	宝钢股份	1,400,000.00	0.18

##### 7.4.2 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	600019	宝钢股份	1,312,854.00	0.17

##### 7.4.3 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	9,100,358.20
卖出股票的收入（成交）总额	1,312,854.00

#### 7.5 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	26,520,939.00	9.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,910,000.00	35.73
	其中：政策性金融债	100,910,000.00	35.73
4	企业债券	125,059,056.57	44.28
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	6,342,307.30	2.25
7	其他	-	-
8	合计	258,832,302.87	91.64

#### 7.6 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	080219	08 国开 19	600,000	60,750,000.00	21.51
2	080218	08 国开 18	400,000	40,160,000.00	14.22
3	009908	99 国债(8)	232,770	23,439,939.00	8.30
4	122982	09 长城开	200,000	20,414,000.00	7.23
5	122983	09 南钢联	173,010	17,790,618.30	6.30

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 7.8 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。

### 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

#### 7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	3,362,560.96
3	应收股利	-
4	应收利息	3,854,565.95
5	应收申购款	693,391.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,910,518.74

#### 7.9.4 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	110003	新钢转债	6,342,307.30	2.25

### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票

### 7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	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
国富 强化 收益 债券 A	2,129	122,797.31	189,053,805.59	72.31%	72,381,660.95	27.69%
国富 强化 收益 债券 C	144	85,874.14	96,413.42	0.78%	12,269,462.08	99.22%
合计	2,273	120,458.14	189,150,219.01	69.08%	84,651,123.03	30.92%

### 8.2 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	份额级别	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	国富强化收益债 券 A	96.40	0.00004%
	国富强化收益债 券 C	-	-
	合计	96.40	0.00004%

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国富强化收益债券 A	国富强化收益债券 C
基金合同生效日基金份额总额	1,074,835,078.73	
报告期期初基金份额总额	554,843,241.74	199,479,336.72
报告期期间基金总申购份额	278,700,873.41	53,378,400.57
报告期期间基金总赎回份额	572,108,648.61	240,491,861.79
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	261,435,466.54	12,365,875.50

## 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

本报告期内本基金管理人无重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自成立以来对其进行审计的均是普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内，基金管理人、托管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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国海证券	2	10,413,212.20	100.00%	177,616,591.83	100.00%

券商名称	回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金	
	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	佣金	占当期佣金总量的比例
国海证券	5,000,000.00	100.00%	-	-	8,851.19	100.00%

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) 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 2 个，均为国海证券。

国海富兰克林基金管理有限公司  
二〇〇九年八月二十八日