

富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金 2007 年年度报告摘要

2006年12月31日	6个月内	6个月至1年	1至5年	不计时	合计
资产					
银行存款	51,979,222.09	-	-	-	51,979,222.09
结算备付金	423,161.94	-	-	-	423,161.94
应收证券基金	-	-	500,000.00	-	500,000.00
交易性金融资产	99,900,000.00	1,989,349,794.24	2,089,249,794.24	-	4,077,539,588.48
应收证券清算款	5,260,932.24	5,260,932.24	5,260,932.24	-	15,782,796.72
应收利息	-	688,148.78	688,148.78	-	1,376,297.56
应收申购款	-	1,828,326.02	1,828,326.02	-	3,656,652.04
资产总计	52,402,384.03	99,900,000.00	1,997,625,201.16	2,149,927,583.21	4,650,835,168.40
负债					
应付赎回款	-	-	47,128,982.42	-	47,128,982.42
应付管理人报酬	-	-	2,793,941.74	-	2,793,941.74
应付托管费	-	-	463,656.96	-	463,656.96
应付销售费用	-	-	1,624,253.80	-	1,624,253.80
其他负债	-	-	941,202.52	-	941,202.52
负债总计	-	-	52,964,037.44	-	52,964,037.44
所有者权益合计	52,402,384.03	99,900,000.00	1,944,661,163.72	2,096,963,545.77	4,607,871,131.56

于 2007 年 12 月 31 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产的比例低于 20%,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2006 年:同)。

(3) 汇率风险
本基金的所有资产及负债均以人民币计价,因此无汇率风险。

26 首次执行新准则
如附注 2 所述,本财务报表为本基金首次按照企业会计准则编制的财务报表,2006 年度和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的比较数字已按照《企业会计准则第 38 号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整,并已按照本财务报表的披露方式进行了重分类。

按照企业会计准则制度列报的 2006 年 6 月 14 日(基金合同生效日),2006 年 12 月 31 日和 2007 年 6 月 30 日的所有者权益,以及 2006 年度和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的净损益调整按企业会计准则列报的所有者权益及损益的调节过程列示如下:

	2006年6月14日 (基金合同生效日) 所有者权益	2006年12月31日 所有者权益	2007年6月30日 所有者权益
按原会计准则列报的金额	2,912,981,452.28	306,660,923.23	2,096,963,547.77
金融资产公允价值变动的调整数	0.00	662,283,767.97	0.00
重新计量金融资产内溢利的调整数	2,912,981,452.28	969,452,691.20	2,096,963,547.77
	2007年1月1日 所有者权益	2007年1月1日 所有者权益	2007年6月30日 所有者权益
按原会计准则列报的金额	2,096,963,547.77	1,458,428,856.37	5,711,043,516.56
金融资产公允价值变动的调整数	0.00	1,028,629,677.61	0.00
重新计量金融资产内溢利的调整数	2,096,963,547.77	5,711,043,516.56	5,711,043,516.56

27 资产负债表日后事项
本基金资产负债表日后事项需要披露

七、投资组合报告
(一)本报告期末基金资产组合情况

项目	市值(人民币元)	占基金资产净值比例
股票	8,651,490,199.81	89.46%
债券	344,700,000.00	3.57%
权证	0.00	0.00%
货币资金	564,518,096.87	5.84%
应收证券清算款	109,823,639.17	1.13%
其他资产	9,670,581,935.83	100.00%

(二)本报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值(人民币元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	1,478,844,330.25	15.40%
C 制造业	2,783,563,166.94	28.97%
CO 食品、饮料	296,675,189.61	2.61%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	1,275,456,526.69	13.28%
C5 电子	17,269,899.54	0.74%
C6 金属、非金属	785,939,940.53	8.18%
C7 机械、设备、仪表	342,222,927.17	3.56%
C8 医药、生物制品	57,998,686.44	0.60%
C9 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气、水和热的生产和供应	687,922,844.73	7.16%
E 建筑业	74,965,817.28	0.78%
F 交通运输、仓储业	88,921,893.54	0.93%
G 信息技术业	581,846,619.65	6.06%
H 批发和零售贸易	665,383,529.24	6.93%
I 金融、保险业	1,737,588,839.99	18.10%
J 房地产业	447,557,548.76	4.66%
K 传播与文化产业	104,895,569.43	1.09%
L 教育与文化业	0.00	0.00%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	8,651,490,199.81	90.08%

(三)本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

股票代码	股票名称	数量(股)	市值(人民币元)	市值占净值比例
000092	盐湖钾肥	9,028,775	702,927,357.00	7.22%
600039	中信证券	5,921,220	528,587,399.48	5.53%
600094	大商股份	10,719,083	523,948,874.80	5.40%
600718	东阿阿胶	10,476,059	488,289,109.99	5.09%
000002	万科 A	15,516,639	447,557,548.76	4.66%
600036	招商银行	11,213,000	444,371,190.00	4.63%
600282	中信银行	17,886,733	412,057,154.19	4.29%
600009	长江电力	20,669,215	403,293,219.35	4.20%
600583	海油工程	7,232,752	376,681,724.16	3.92%
600660	福耀玻璃	9,165,139	328,661,884.54	3.42%
600448	招商局	6,063,629	324,525,424.08	3.38%
000083	西山煤电	5,092,106	323,195,967.82	3.37%
600000	浦发银行	4,868,493	323,653,628.88	3.41%
600596	新安股份	2,922,093	196,831,403.09	2.05%
600426	鲁信房产	7,400,858	196,122,737.00	2.04%
600016	民生银行	12,567,917	186,256,529.94	1.94%
600019	宝钢股份	10,673,262	186,141,689.28	1.94%
600352	浙江东箭	10,320,404	179,575,029.60	1.87%
600183	华泰证券	3,082,399	170,410,080.58	1.77%
601198	工商银行	20,918,245	170,065,331.85	1.76%
601939	上海银行	15,701,000	154,654,850.00	1.61%
600011	华能国际	9,807,584	145,446,470.72	1.51%
600361	华联超市	4,346,486	141,434,654.44	1.47%
600089	广州控股	10,371,323	139,183,154.66	1.45%
600004	白云机场	3,542,808	138,476,965.87	1.43%
000095	双汇发展	2,102,419	124,021,688.31	1.29%
600220	华闻传媒	4,712,345	119,599,516.10	1.25%
000087	新华传媒	6,449,359	107,897,776.07	1.12%
600350	山东墨龙	10,500,057	104,895,569.43	1.09%
600012	浦发银行	9,944,457	88,921,893.54	0.93%
600009	长江电力	3,542,808	67,314,965.87	0.71%
002028	大族激光	2,231,495	71,269,896.50	0.74%
002048	宁波海运	5,127,843	65,715,754.50	0.68%
000063	华联超市	1,000,000	63,690,000.00	0.66%
600049	厦门国贸	2,222,788	62,559,597.96	0.64%
600039	中信证券	3,082,399	60,010,080.58	0.63%
000063	华联超市	2,838,162	46,280,117.00	0.49%
601088	中国神华	6,665,600	42,384,060.00	0.44%
000012	浦发银行	1,524,030	32,440,539.00	0.34%
000066	长城控股	2,442,153	29,867,549.66	0.31%
600021	华海药业	436,858	11,218,513.44	0.12%

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动
1. 累计买入价值前十名股票的股票明细

股票代码	股票名称	累计买入金额(人民币元)	占期初净值比例%
600019	宝钢股份	523,724,560.11	24.98%
600028	中国石化	500,965,790.56	23.89%
600002	万科 A	494,604,412.18	23.59%
600030	中信证券	451,145,309.69	21.31%
600036	招商银行	419,574,722.32	20.06%
600718	东阿阿胶	414,224,929.32	19.72%
600036	招商银行	324,528,422.27	15.48%
600583	海油工程	313,638,633.53	14.90%
600000	浦发银行	296,488,523.27	14.14%
000092	盐湖钾肥	283,177,964.79	13.50%
600348	华阳国际	276,322,807.69	13.18%
600068	华闻传媒	246,160,391.34	11.74%
600000	浦发银行	201,988,367.74	9.59%
600000	浦发银行	195,243,725.94	9.31%
000083	西山煤电	187,884,112.32	8.90%
600089	广州控股	180,861,629.97	8.62%
600045	广生股份	179,143,829.91	8.34%
601198	工商银行	161,235,570.22	7.60%
600095	双汇发展	157,796,746.66	7.52%
600079	山西汾酒	150,829,293.66	7.19%

2. 累计卖出价值前十名股票的股票明细

股票代码	股票名称	累计卖出金额(人民币元)	占期初净值比例%
600019	宝钢股份	301,597,923.63	13.40%
600028	中国石化	696,360,571.39	33.31%
600002	万科 A	467,883,186.16	22.31%
000002	万科 A	434,231,262.93	20.71%
000088	鞍钢股份	332,917,333.32	15.88%
600036	招商银行	327,585,210.24	15.62%
600036	招商银行	297,429,697.88	14.07%
600348	华阳国际	295,551,529.84	13.38%
000083	西山煤电	256,587,875.77	12.24%
600065	中航电子	242,822,607.11	11.58%
600795	华电国际	234,212,224.22	11.17%
600094	大商股份	216,712,954.34	10.33%
600019	宝钢股份	178,669,786.12	8.13%
600016	民生银行	145,657,532.17	6.59%
600030	中信证券	137,709,117.00	6.28%
000063	华联超市	126,358,549.29	6.02%
600269	粤传媒	118,260,417.83	5.62%
600069	浦发银行	108,341,628.31	5.27%
000025	广汇能源	106,863,025.28	5.10%
600009	长江电力	103,239,110.97	4.92%

(五) 报告期内累计买入金额及卖出金额的股票或债券
报告期内买入股票成本总额及卖出股票的收入总额

人民币元	人民币元
8,632,025,661.84	7,067,096,030.34

(六) 按债券品种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值(人民币元)	市值占基金资产净值比例
央行票据	340,051,000.00	2.33%
国债	199,200,000.00	1.37%
可转债	3,627,938.90	0.02%
债券投资组合合计	542,842,938.90	3.72%

(七) 按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

债券名称	市值(人民币元)	市值占净值比
07央行 17	199,200,000.00	1.37%
央行票据 25	194,800,000.00	1.33%
央行票据 02	180,000,000.00	1.06%
中债国债	3,627,938.90	0.02%

(八) 投资组合报告附注
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受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

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。

3. 本基金其他资产的构成:

其他资产	金额(人民币元)
交易保证金	1,966,167.87
应收证券清算款	499,130.44
应收利息	10,928,212.88
应收申购款	27,948,196.92
合计	44,361,687.91

4. 报告期末本基金未持有资产支持证券。

5. 报告期末本基金未持有权证。

6. 报告期末本基金未主动投资股权分置改革中发行的权证。

7. 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

八、基金持有人持有户数、持有人结构

期末基金总份额(份)	基金份额持有人户数(户)	户均持有份额(份)	个人持有份额(份)	个人持有比例(%)	机构投资者持有份额(份)	机构投资者持有比例(%)	我员工持有份额(份)	我员工持有比例(%)
8,239,437,381.69	303,650	27,134.65	8,186,316,017.07	99.36%	53,121,364.62	0.64%	2533	0.000007%

九、基金管理公司从业人员投资股票情况披露

期末基金总份额(份)	基金管理人持有基金份额(份)	持有比例(%)
8,239,437,381.69	303,650	0.37%

(五) 按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值(人民币元)	市值占基金资产净值比例
央行票据	145,600,000.00	1.52%
国债	199,200,000.00	2.07%