# 富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金

## 【2015】第四季度报告

基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20日

§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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月15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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 国富大中华精选混合(QDII) |
| 基金主代码 | 000934 |
| 交易代码 | 000934 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年2月3日 |
| 报告期末基金份额总额 | 66,149,014.36份 |
| 投资目标 | 本基金通过积极进行资产配置和组合管理,投资于大中华地区证券市场和海外证券市场发行的大中华企业,以力争获取基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | (一)资产配置策略<br>本基金将根据宏观大势进行资产配置调整,通过对全球宏观经济状况、区域经济发展情况、证券市场走势、政策法规影响、市场情绪等综合分析,调整基金在股票、债券等资产类别上的投资比例,以降低投资风险,提高收益。<br>(二)区域配置策略<br>本基金主要投资于大中华地区。本基金通过对国家或区域的经济发展趋势、财政政策、货币政策、就业状况及市场估值水平变化等方面进行深入研究和比较分析的基础上,确定投资区域的权重。<br>(三)股票投资策略<br>本基金将采用"自下而上"的选股策略,通过对企业基本面的分析和研究,挖掘基本面良好、具有较强竞争力和持续成长能力的上市公司作为投资方向。主要评估因素包括:<br>1、公司竞争优势评估——在行业中处于领先地位,或者在生产、技术、市场等一个或多个方面具有行业内领先地位的上市公司。<br>2、盈利能力评估——结合公司所处行业的特点和发展趋势、公司背景、从财务结构、资产质量、业务增长、利润水平、现金流特征等方面考察公司的盈利能力,专注于具有行业领先优势、资产质量良好、盈利能力较强、盈利增长具有可持续性的上市公司。<br>3、成长能力评估——选择具有持续、稳定的盈利增长历史,且预期盈利能力将保持稳定增长的公司。<br>4、公司治理结构评估——清晰、合理的公司治理是公司不断良性发展的基础。从股权结构的合理性、信息披露的质量、激励机制的有效性、关联交易的公允性、公司的管理层和股东的利益是否协调和平衡、公司是否具有清晰的发展战略等方面,对公司治理水平进行综合评估。<br>5、估值评估——企业的估值水平在一定程度上反应了其未来成长性以及当前投资的安全性。估值合理将是本基金选股的一个重要条件。本基金通过评估公司相对市场和行业的相对投资价值,选择目前估值水平明显较低或估值合理的上市公司。<br>(四)新股申购策略<br>本基金基于对首次发行股票(IPO)及增发新股的上市公司的基本面研究、估值分析,判断新股的投资价值、参与新股申购的预期收益和风险,从而制定相应的申购策略。<br>(五)债券投资策略<br>本基金通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究,结合新券发行情况,综合分析市场利率和信用利差的变动趋势,采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略,把握债券市场投资机会,构建债券组合。<br>(六)金融衍生品投资策略<br>基金管理人在确保与基金投资目标相一致的前提下,可本着谨慎和风险可控的原则,适度投资于经中国证监会允许的各类金融衍生产品,如期权、期货、权证、远期合约、掉期等。本基金投资于衍生工具主要是为了避险和增值、管理汇率风险,以便能够更好地实现基金的投资目标。本基金投资于各类金融衍生工具的全部敞口不高于基金资产净值的100%。 |
| 业绩比较基准 | MSCI金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)X 60%+同期人民币一年期定期存款利率(税后)X 40% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金,其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中等风险收益特征的基金品种。 |
| 基金管理人 | 国海富兰克林基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 境外资产托管人 | 英文名称:The Bank of New York Mellon Corporation<br>中文名称:纽约梅隆银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

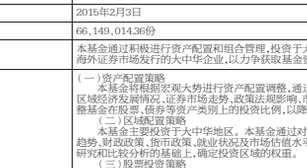
金额单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2015年10月1日-2015年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -9,170,739.96 |
| 2.本期利润 | 8,268,976.15 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1093 |
| 4.期末基金资产净值 | 58,474,416.87 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.884 |

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),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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 | 13.33% | 1.32% | 2.40% | 0.60% | 10.93% | 0.72% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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
富兰克林国海大中华精选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
(2015年2月3日-2015年12月31日)



注:本基金的基金合同生效日为2015年2月3日。截至报告期末本基金合同生效未满一年。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(或基金经理小组)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 | | |
| 曾宇 | 国富亚洲机会股票(QDII)基金及国富大中华精选混合(QDII)基金的基金经理 | 2015年2月3日 | | 12年 | 曾宇先生,法国籍,CFA,巴黎高等商学院研究生硕士。历任汇丰集团信汇资产管理公司基金经理助理、交易员,Financi è re de l'Echiquier基金经理助理、股票分析师。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富亚洲机会股票(QDII)基金及国富大中华精选混合(QDII)基金的基金经理。 |
| 徐成 | 国富亚洲机会股票(QDII)基金及国富大中华精选混合(QDII)基金的基金经理 | 2015年12月24日 | | 9年 | 徐成先生,CFA,朴茨茅斯大学(英国)金融决策分析硕士。历任永丰金证券(亚洲)有限公司上海办事处研究员、新加坡东京海上国际资产管理有限公司上海办事处研究员、高级研究员、首席代表。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富亚洲机会股票(QDII)基金及国富大中华精选混合(QDII)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《富兰克林国海大中华精选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 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,公司在研究报告发布公平性、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》,严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
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 报告期内基金的投资策略和运作分析
大中华市场在三季度下跌之后,四季度出现反弹。香港市场在国内A股市场企稳的情况下,小幅反弹近4%,台湾市场则上涨1%。美联储四季度宣布加息25个基点,基本符合市场预期。货币方面,人民币对美元在四季度出现贬值,幅度达2.06%。 本季度,国基大中华基金保持较高的港股配置,以及较高的持股集中度,中小市值股票持仓较高。
4.5 报告期内基金的业绩表现
本基金净值在四季度上涨13.33%,大幅优于业绩比较基准(MSCI亚洲(除日本)净总收益指数,以美元计价)。基金业绩表现领先比较基准的主要原因是地区国别配置以及选股效应。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 49,070,332.77 | 78.28 |
| | 其中:普通股 | 48,096,690.76 | 76.73 |
| | 存托凭证 | 973,642.01 | 1.55 |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 1,954,373.18 | 3.12 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中:远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 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 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 7,775,513.25 | 12.40 |
| 8 | 其他资产 | 3,885,154.11 | 6.20 |
| 9 | 合计 | 62,685,373.31 | 100.00 |

注:本基金未通过沪港通交易机制投资港股。
5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

金额单位:人民币元

| 国家(地区) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 香港 | 48,096,690.76 | 82.25 |
| 美国 | 973,642.01 | 1.67 |
| 合计 | 49,070,332.77 | 83.92 |

注:以上国家(地区)均按照股票及存托凭证上市交易地点进行统计。
5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位:人民币元

| 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 材料 | 789,155.92 | 1.35 |
| 电信服务 | - | - |
| 信息技术 | 10,876,654.79 | 18.60 |
| 非必需消费品 | 4,321,913.55 | 7.39 |
| 必需消费品 | 442,347.84 | 0.76 |
| 能源 | 603,804.80 | 1.03 |
| 保健 | 3,220,242.01 | 5.51 |
| 金融 | 20,535,772.27 | 35.12 |
| 工业 | 4,713,626.75 | 8.06 |
| 公用事业 | 3,566,814.84 | 6.10 |
| 合计 | 49,070,332.77 | 83.92 |

注:以上分类采用GICS行业分类标准。
5.4 报告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及存托凭证投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | CIFI Holdings (Group) Co. Ltd | 旭辉控股集团 | BBG003MHHV68 | 香港联合交易所 | 香港 | 2,868,000 | 4,156,762.76 | 7.11 |
| 2 | Value Partners Group Limited | 惠理集团 | BBG000TW8473 | 香港联合交易所 | 香港 | 506,000 | 3,840,685.12 | 6.57 |
| 3 | China CITIC Bank Corp Ltd | 中信银行 | BBG000J7DX33 | 香港联合交易所 | 香港 | 560,000 | 2,355,167.14 | 4.03 |
| 4 | China Railway Construction Corp Ltd | 中国铁建 | BBG000QNN9H7 | 香港联合交易所 | 香港 | 269,000 | 2,165,736.70 | 3.70 |
| 5 | Sunac China Holdings Ltd | 融创中国 | BBG000PZ8SG7 | 香港联合交易所 | 香港 | 426,000 | 2,141,365.68 | 3.66 |
| 6 | EGL Holdings Co Ltd | 东瀛控股 | BBG007K5DD07 | 香港联合交易所 | 香港 | 918,000 | 1,984,231.66 | 3.39 |
| 7 | Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd | 香港交易所 | BBG000BGW354 | 香港联合交易所 | 香港 | 11,600 | 1,929,072.23 | 3.30 |
| 8 | China Traditional Chinese Medicine Co. ltd | 中国中药 | BBG000BDKMV3 | 香港联合交易所 | 香港 | 408,000 | 1,791,106.62 | 3.06 |
| 9 | China Construction Bank Corp | 建设银行 | BBG000NW2218 | 香港联合交易所 | 香港 | 396,000 | 1,757,201.66 | 3.01 |
| 10 | Tencent Holdings Ltd | 腾讯控股 | BBG000BJ35N5 | 香港联合交易所 | 香港 | 13,300 | 1,699,227.29 | 2.91 |

注:1.本基金对以上证券代码采用原券商BBG-ID。
2.上述表格"所属国家(地区)"均按照股票及存托凭证上市交易地点统计。
5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 报告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
本基金本报告期末未持有债券。
5.7 报告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。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有金融衍生品。
5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | HANG SENG H-SHARE INDEX ETF | ETF | 开放式基金 | Hang Seng Investment Management Ltd | 1,954,373.18 | 3.34 |

5.10 投资组合报告附注
5.10.1 本基金本期投资的前十名证券中,无股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。
5.10.2 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。
5.10.3 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 | 200,562.54 |
| 3 | 应收股利 | 26,138.74 |
| 4 | 应收利息 | 735.35 |
| 5 | 应收申购款 | 2,075.09 |
| 6 | 其他应收款 | 3,655,642.39 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,885,154.11 |

5.10.4 报告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的可转换债券。
5.10.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 83,158,464.85 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 860,213.84 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 17,869,664.33 |
| 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 | 66,149,014.36 |

本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本公司管理的该基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会批准富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金设立的文件;
2、《富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金基金合同》;
3、《富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金托管协议》;
5、中国证监会要求的其他文件。
8.2 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。
8.3 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
二〇一六年一月二十日

# 富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金

## 【2015】第四季度报告

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:2016年1月20日

§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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月15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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 国富健康优质生活股票 |
| 基金主代码 | 000761 |
| 交易代码 | 000761 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年9月23日 |
| 报告期末基金份额总额 | 23,080,989.51份 |
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于有利于提升民众健康水平和能够满足人们优质生活需求的上市公司,在严格控制投资风险的基础上,力争获取基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将重点关注有利于提升民众健康水平和能够提供优质生活产品和服务的行业和个股。<br>1、行业配置策略<br>(1)本基金的股票资产采用"核心-卫星"策略进行行业配置。本基金的核心行业配置资产将主要投资于与提升居民健康和生活品质主题直接相关的行业,投资比例不低于非现金基金资产的80%。<br>随着经济增长方式的转变和产业结构的升级,居民的需求也会发生变化,从而导致满足居民健康和优质生活需求的行业范围发生变化。本基金将通过对居民需求变化和行业发展趋势的研究,适时调整健康优质生活主题所覆盖的行业范围。<br>(2)本基金在具体进行行业配置时,根据宏观经济周期、国家产业政策、行业景气度和行业竞争格局等因素进行深入分析,结合行业盈利趋势预测、行业整体估值水平和市场特征等,进行综合的行业投资价值评估。<br>2、个股精选策略<br>本基金将采用"自下而上"精选个股策略,紧密围绕健康优质生活的投资主题,从主题、行业地位、公司发展战略、核心竞争力、公司治理结构和管理层分析、估值水平等方面进行综合评价,精选优质股票构建投资组合。<br>3、债券投资策略<br>本基金通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究,结合新券发行情况,综合分析市场利率和信用利差的变动趋势,采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略,把握债券市场投资机会,以获取稳健的投资收益。<br>4、股指期货投资策略<br>本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。<br>基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。<br>5、权证投资策略<br>本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,结合权证定价模型确定其合理估值水平,谨慎地进行投资,在控制下跌风险、实现保值的前提下,追求较为稳定的增值收益。 |
| 业绩比较基准 | 85% × 沪深300指数收益率 + 15% × 中债国债总指数收益率(全价) |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型基金,属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种,其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |
| 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

3.1 主要财务指标

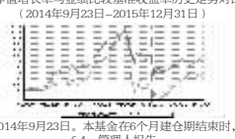
单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2015年10月1日-2015年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 835,182.22 |
| 2.本期利润 | 7,105,717.37 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.3225 |
| 4.期末基金资产净值 | 28,768,946.24 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.246 |

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),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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 | 33.55% | 2.04% | 14.33% | 1.42% | 19.22% | 0.62% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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
富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年9月23日-2015年12月31日)



注:本基金的基金合同生效日为2014年9月23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(或基金经理小组)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 | | |
| 王晓宁 | 公司研究分析部副总经理,国富策略回报混合基金及国富健康优质生活股票基金的基金经理 | 2014年9月23日 | - | 12年 | 王晓宁先生,中央财经大学学士学位。历任万家基金管理有限公司研究员、研究总监助理、基金经理助理,国海富兰克林基金管理有限公司行业研究主管、国富潜力组合混合基金、国富成长动力混合基金及国富策略回报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分析部副总经理,国富策略回报混合基金及国富健康优质生活股票基金的基金经理。 |

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《富兰克林国海健康优质生活股票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 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,公司在研究报告发布公平性、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》,严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
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 报告期内基金的投资策略和运作分析
四季度A股市场单边上涨,在投资者负面情绪平复后,市场在低利率环境下走出了恢复性行情。前期遭受重创的中小盘类股票大幅反弹,创业板涨幅达到30.3%。蓝筹股前期表现较为沉寂,进入12月后在保险公司举牌效应的带动下,领涨市场。
本基金在市场下跌过程中大幅度增持了估值合理的成长股,阶段性持有了银行和白酒等防御性行业。四季度的持仓基本保持了前期的结构,减持了策略性持有的防御性行业,加仓了成长股,在市场反弹中获得了超额收益。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至报告期末,本基金份额净值为1.246元,本报告期净值增长率为33.55%,同期业绩比较基准增长率为14.33%,本基金领先业绩比较基准19.22%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本报告期内,自2015年10月1日到2015年12月31日,本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 24,549,447.56 | 83.03 |
| | 其中:股票 | 24,549,447.56 | 83.03 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,706,644.66 | 15.92 |
| 8 | 其他资产 | 310,823.39 | 1.05 |
| 9 | 合计 | 29,566,915.61 | 100.00 |

注:本基金未通过沪港通交易机制投资港股。
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 12,796,189.56 | 44.48 |
| 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 | 1,040,512.00 | 3.62 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 924,924.00 | 3.22 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,324,043.00 | 8.08 |
| J | 金融业 | 2,835,311.00 | 9.86 |
| K | 房地产业 | 2,978,692.00 | 10.35 |
| L | 租赁和商务服务业 | 604,401.00 | 2.10 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 496,780.00 | 1.73 |
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 548,595.00 | 1.91 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 24,549,447.56 | 85.33 |

5.3 报告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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002630 | 华西能源 | 140,600 | 2,076,662.00 | 7.22 |
| 2 | 002450 | 康得新 | 42,089 | 1,603,590.90 | 5.57 |
| 3 | 300119 | 瑞普生物 | 58,434 | 1,174,523.40 | 4.08 |
| 4 | 000070 | 特发信息 | 36,544 | 1,172,696.96 | 4.08 |
| 5 | 000920 | 南方汇通 | 47,900 | 1,151,037.00 | 4.00 |
| 6 | 002236 | 大华股份 | 28,200 | 1,040,580.00 | 3.62 |
| 7 | 600271 | 航天信息 | 14,200 | 1,014,732.00 | 3.53 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 51,400 | 994,590.00 | 3.46 |
| 9 | 002113 | 天润控股 | 24,450 | 970,665.00 | 3.37 |
| 10 | 600896 | 中海海盛 | 57,200 | 924,924.00 | 3.22 |

5.4 报告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。
5.5 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债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 报告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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.10 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。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金未曾投资的前十名证券中,报告期内发行主体被监管部门立案调查,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、处罚的情况说明如下:
中信证券于2015年1月19日公告显示,中信证券存在为到期融资融券合约展期的问题(根据相关规定,融资融券合约期限最长为6个月),公司被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。对此,公司已采取以下整改措施:
1、暂停新开立融资融券客户信用账户3个月。
2、自2015年1月16日起,公司将不允许新增任何新的合约逾期,距合约到期两周前将反复提醒客户及时了结合约,对于到期未了结的合约将强制平仓。
3、在监管规定的时间内,清理完成旧的逾期合约。
4、将融资融券业务客户开户条件由客户资产满人民币30万元提高到客户资产满人民币50万元。
中信证券于2015年11月26日公告显示,中信证券收到中国证监会调查通知书(稽查总队调查通字153121号)。因中信证券涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定,中国证监会决定对中信证券进行立案调查。本次调查重点针对中信证券在融资融券业务开展过程中,涉嫌违反《证券公司监督管理条例》第八十四条"未按照规定与客户签订业务合同"的规定。
本基金对中信证券投资决策说明:本公司的投研团队经过充分研究,认为上述事件仅对中信证券短期经营有一定影响,不改变长期投资价值。同时由于我们看好证券行业整体的发展前景,行业杠杆度的提升带来盈利能力的上升,因此买入中信证券。本基金管理人对该股的投资决策遵循公司的投资决策制度。
5.11.2 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。
5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 42,736.58 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 720.01 |
| 5 | 应收申购款 | 267,366.80 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 310,823.39 |

5.11.4 报告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。
5.11.5 报告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 | 600271 | 航天信息 | 1,014,732.00 | 3.53 | 重大资产重组停牌 |

§6 开放式基金份额变动

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 22,535,654.59 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 13,757,601.00 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 13,212,266.08 |
| 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 | 23,080,989.51 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本公司管理的该基金的情况。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本公司管理的该基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会批准富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金设立的文件;
2、《富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金基金合同》;
3、《富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金招募说明书》;
4、《富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金托管协议》;
5、中国证监会要求的其他文件。
8.2 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。
8.3 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
二〇一六年一月二十日

# 富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金

## 【2015】第四季度报告

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:2016年01月20日

§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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月15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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 国富中证100指数增强分级 |
| 场内简称 | 国富100 |
| 基金主代码 | 164508 |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年03月26日 |
| 报告期末基金份额总额 | 125,768,789.97份 |
| 投资目标 | 本基金为股票指数增强型基金。通过量化风险管理方法,控制基金投资组合与标的指数构成的偏差,同时采取适当的增强策略,在严格控制跟踪误差风险的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资收益,追求基金资产的长期增值。在正常市场情况下,本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%。 |
| 投资策略 | 本基金基于被动复制的指数化投资方法,在严格控制跟踪误差风险的基础上,适度运用资产配置调整、行业配置调整、指数成分股权重优化等主动增强策略,力争获得超越业绩比较基准