富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金

【2016】第一季度报告

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4月22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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月19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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富中小盘股票
基金主代码	450009
交易代码	450009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月23日
报告期末基金份额总额	186,574,713.01份
投资目标	本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票,力求在有效控制风险的前提下,获得基金资产的长期稳定增值。
投资策略	大类资产配置: 本基金通过分析宏观经济状况、资产估值水平和市场特征等因素,仅在上述资产配置范围内适度调整股票、债券、货币市场工具和其他法律法规允许的金融工具的投资比例。 股票选择策略: 本基金在资产配置范围相对固定的情况下,主要采用精选个股和行业优化的投资策略,挖掘并投资于具有良好治理结构、成长性好、估值合理及具有巨大发展潜力的中小市值上市公司。本基金的股票投资策略主要包括市值筛选策略、精选个股策略和行业优化策略。 债券投资策略: 本基金的债券投资为股票投资不易实施预定投资策略时的防守性措施。债券投资策略主要包括利率预期策略、久期管理策略、类属资产配置策略、个券选择策略等。 权证的投资策略 本基金不直接从二级市场买入权证,可持有股票派发或可分离交易债券所分离的权证。
业绩比较基准	中证700指数收益率×90%+银行同业存款利率×10%
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,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-26,704,345.72
2.本期利润	-52,808,253.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2611
4.期末基金资产净值	337,089,413.76
5.期末基金份额净值	1.807

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。

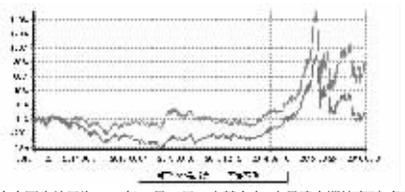
3.2 基金净值表现

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	-11.07%	3.03%	-16.63%	2.81%	5.56%	0.22%

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

富兰克林国海中小盘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
(2010年11月23日-2016年3月31日)



注:本基金的基金合同生效日为2010年11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		
赵晓东	公司权益投资总监、ODII投资总监、职工监事,国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金、国富弹性市值混合基金及国富恒瑞债券基金的基金经理	2010年11月23日	-	12年	赵晓东先生,香港大学MBA。历任淄博矿业集团项目经理,浙江证券分析员,上海交大高新技术股份有限公司高级投资经理,国海证券有限责任公司行业研究员,国海富兰克林基金管理有限公司研究员、高级研究员、国富弹性市值混合基金及国富趋力组合混合基金的基金经理助理,国富沪深300指数增强基金的基金经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司权益投资总监、ODII投资总监、职工监事,国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金、国富弹性市值混合基金及国富恒瑞债券基金的基金经理。

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《富兰克林国海中小盘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

一季度,市场出现了较大幅度的下跌,创业板、中小板和蓝筹股都出现了较大的调整。一季度,中证700指数下跌18.56%,沪深300指数下跌13.75%,创业板指数下跌17.53%,中小市值公司跌幅略大于大盘蓝筹公司。市场调整的主要原因,一是人民币相对美元在一月份出现了一定幅度的贬值,恐慌情绪导致市场抛售加大;二是投资者对全年的经济增长存有忧虑;三是熔断机制的实施,造成市场流动性变差,导致市场的参与者短期撤离市场;随着政府一系列改革和稳增长措施公布,市场经过一月份调整后,逐渐企稳。在宏观经济方面,投资在一季度出现了一定的反弹,尤其是房地产的销售和投资都出现短期的拐点;消费维持平稳的增长、物价的短期反弹改变了市场通缩预期;出口上由于基数原因,出现了一定的下降,但下降幅度依然可以接受。资金方面,央行继续延续了较为宽松的货币政策,资本市场的流动性相当宽裕。

一季度,本基金从长期投资的角度出发,依然积极配置了低估值增长的食品饮料、环保和新兴技术行业的公司,组合的风格配置更加均衡;在操作上,根据市场的风格变化和政府政策的变化预期,在煤炭等产能过剩行业进行短期的配置,获得一些相对收益;根据对行业和个股的研究和判断,提升了部分中小转型公司的配置,在配置上依然比较均衡。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日,本基金份额净值为1.807元,本报告期份额净值下跌11.07%,同期业绩基准下跌16.63%;领先业绩基准5.56%。由于本基金行业配置中有较多的食品饮料和业绩较好的成长股,其跌幅小于中证700指数,这是本基金业绩领先业绩基准的主要原因。

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	290,811,137.51	85.85
	其中:股票	290,811,137.51	85.85
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	46,994,618.52	13.87
8	其他资产	932,775.39	0.28
9	合计	338,738,531.42	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	4,837,098.00	1.43
B	采矿业	114,020.85	0.03
C	制造业	215,484,859.67	63.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,234.48	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,190,936.80	3.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,946,514.76	9.48
J	金融业	-	-
K	房地产业	7,215,360.96	2.14
L	租赁和商务服务业	4,960,962.00	1.47
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	2,926,000.00	0.87
S	综合	13,099,149.99	3.89
	合计	290,811,137.51	86.27

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

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	002308	威创股份	1,460,550	25,457,386.50	7.55
2	300165	天瑞仪器	1,067,773	19,753,800.50	5.86
3	000858	五粮液	689,904	19,393,201.44	5.75
4	600305	恒顺醋业	932,047	19,190,847.73	5.69
5	000920	南方汇通	956,600	17,668,402.00	5.24
6	002230	科大讯飞	500,029	16,210,940.18	4.81
7	002553	南方轴承	1,283,100	14,691,495.00	4.36
8	300367	东方网力	455,225	13,898,019.25	4.12
9	600777	新潮实业	841,307	13,099,149.99	3.89
10	300160	秀强股份	299,954	12,988,008.20	3.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金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
根据基金合同,本基金不投资股指期货。

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 本基金本期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),中信证券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,中信证券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19日起,中信证券将不允许新增任何新的合约逾期,断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29日公告显示,2015年11月26日,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,不改变中信证券长期投资价值,同时由于本基金看好证券行业整体的发展前景向好,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	218,471.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,804.90
5	应收申购款	705,498.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	932,775.39

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
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	208,878,380.07
报告期期间基金总申购份额	23,782,827.61
减:报告期期间基金总赎回份额	46,086,494.67
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	186,574,713.01

§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中小盘股票型证券投资基金设立的文件;
2、《富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金基金合同》;
3、《富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金招募说明书》;
4、《富兰克林国海中小盘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
二〇一六年四月二十二日

富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金

【2016】第一季度报告

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04月22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4月19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2016年1月1日起至3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	122,192,431.49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	1.资产配置策略 本基金采取指数增强策略,为控制基金的跟踪误差风险,本基金的资产配置将保持与业绩比较基准基本一致,只在股票、债券(主要是国债)、现金等各大类资产间进行小幅度的主动调整,追求适度超越业绩比较基准的收益目标。 2.股票投资策略 为严格控制跟踪误差风险,本基金的股票投资以被动复制跟踪标的指数为主,辅以适度的增强策略。 3.债券投资策略 本基金债券投资的主要目的是在保证基金资产流动性的前提下,提高基金资产的投资收益。本基金主要投资于信用等级高、流动性好的政府债券、金融债、企业债等。 本基金在进行债券组合管理中,将基于对国内外宏观经济形势、国家财政货币政策动向、市场资金流动性等方面的分析,对利率、信用利差变化的趋势进行判断,综合考察债券的投资价值和流动性等因素,构建和调整债券投资组合。 4.股指期货投资策略 本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则参与股指期货交易,以提高投资管理效率,降低跟踪误差风险。
业绩比较基准	中证100指数
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 在本基金分级运作期内,从本基金所分离出来的两类基金份额来看,由于基金收益分配的安排,国富中证100 A分额将表现出低风险、收益相对稳定的特征;国富中证100 B分额则表现出高风险、收益相对较高的特征。
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

下属分级基金的基金简称	国富中证100指数增强分级A	国富中证100指数增强分级B	国富中证100指数增强分级
下属分级基金的场内简称	国富100A	国富100B	国富100
下属分级基金的交易代码	150135	150136	164508
报告期末下属分级基金的份额总额	22,156,626.00份	22,156,627.00份	77,881,178.48份
下属分级基金的风险收益特征	国富中证100A分额将表现出低风险、收益相对稳定的特征。	国富中证100B分额则表现出高风险、收益相对较高的特征。	本基金为股票指数增强型基金,属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

§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(2016年01月01日-2016年03月31日)
1.本期已实现收益	-3,362,732.50
2.本期利润	-13,102,403.54
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1037
4.期末基金资产净值	92,835,141.13
5.期末基金份额净值	0.760

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。

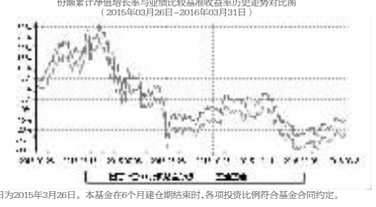
3.2 基金净值表现

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	-11.47%	2.18%	-10.63%	2.05%	-0.84%	0.13%

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

富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金
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03月26日-2016年03月31日)



注:本基金的基金合同生效日为2015年3月26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。

3.3 其他指标

单位:人民币元

其他指标	报告期(2016年01月01日-2016年03月31日)
中证100A与中证100B基金份额配比	1:1
期末中证100A份额参考净值	1.012
期末中证100A份额累计参考净值	1.058
期末中证100B份额参考净值	0.508
期末中证100B份额累计参考净值	0.508
中证100A的预计年收益率	5.00%

§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		
张志强	公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、职工监事、国富沪深300指数增强基金及国富中证100指数增强分级基金的基金经理	2015年03月26日	-	13年	张志强先生,CFA,纽约州立大学(布法罗)计算机科学硕士,中国科学技术大学数学专业硕士。历任美国Enreach Technology Inc.软件工程师、海通证券股份有限公司研究所高级研究员、友邦华泰基金管理有限公司高级数量分析师、国海富兰克林基金管理有限公司首席数量分析师、风险控制部总经理、业务发展部总经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、职工监事、国富沪深300指数增强基金及国富中证100指数增强分级基金的基金经理。

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《富兰克林国海中证100指数增强型分级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
报告期内,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
2016年一季度,A股市场开局不利,整体经历了大幅下跌,其中中证100指数下跌了11.23%。实体经济方面,一季度,PMI指数触底反弹,三月份达50.2,较二月份49.0显著回升,除了季节性因素外,也得益于房地产市场回暖、信贷高速增长和大宗商品价格反弹;但这些积极因素的持续性有待进一步观察。流动性方面,由于美国加息节奏预计较缓,国内的货币政策空间和市场流动性将保持较为宽松的状态。一季度,除了食品饮料、银行等行业外,其它行业股票跌幅均超过10%,中小市值股票跌幅较大。
一季度,本基金保持均衡的组合配置以控制主动投资风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2016年03月31日,本基金份额净值为0.760元。本报告期,份额净值下跌11.47%,同期业绩比较基准下跌10.63%,基金表现落后业绩基准0.84%,期间基金年化跟踪误差为2.35%。

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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	87,450,385.82	93.49
	其中:股票	87,450,385.82	93.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	46,018.40	0.05
	其中:债券	46,018.40	0.05
	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	6,007,799.14	6.42
8	其他资产	32,487.82	0.03
9	合计	93,536,671.18	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

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	采矿业	2,739,118.00	2.95
C	制造业	23,513,300.61	25.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,300,150.68	3.55
E	建筑业	3,761,020.75	4.05
F	批发和零售业	844,849.70	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	2,069,376.00	2.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,579,088.00	2.78
J	金融业	44,351,820.44	47.77
K	房地产业	3,708,678.64	3.99
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	394,663.00	0.43
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	160,600.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	87,422,665.82	94.17

5.2.2 报告期末(积极投资)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	采矿业	-	-
C	制造业	27,700.00	0.03
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	27,700.00	0.03

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	180,700	5,748,067.00	6.19
2	600016	民生银行	505,800	4,607,838.00	4.96
3	601166	兴业银行	226,900	3,523,757.00	3.80
4	600000	浦发银行	163,000	2,922,590.00	3.15
5	600036	招商银行	180,270	2,900,544.30	3.12
6	000002	万 科A	127,400	2,396,394.00	2.58
7	601328	交通银行	411,500	2,292,065.00	2.47
8	600030	中信证券	124,101	2,208,997.80	2.38
9	601288	农业银行	668,100	2,137,920.00	2.30
10	600519	贵州茅台	8,375	2,073,985.00	2.23

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	603027	千禾味业	1,000	27,700.00	0.03

5.4 报告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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	46,018.40	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	46,018.40	0.05

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

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	110032	三一转债	410	46,018.40	0.05

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 本基金本期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),中信证券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,中信证券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19日起,中信证券将不允许新增任何新的合约逾期,断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29日公告显示,2015年11月26日,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,不改变中信证券长期投资价值,同时由于本基金看好证券行业整体的发展前景向好,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	31,311.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,076.03
5	应收申购款	90.818
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,487.82

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

5.11.5.1 期末指数投资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(%)	流通受限部分的原因
1	000002	万 科A	2,396,394.00	2.58	重大资产重组停牌

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末积极投资前五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

项目	国富中证100指数增强分级A	国富中证100指数增强分级B	国富中证100指数增强分级
本报告期期初基金份额总额	24,574,125.00	24,574,126.00	76,620,538.97
报告期期间基金总申购份额	-	-	1,126,303.01
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	8,296,102.02
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-2,418,499.00	-2,418,499.00	8,430,438.52
本报告期期末基金份额总额	22,155,626.00	22,155,627.00	77,881,178.48

注:拆分变动份额为本基金二级份额之间的配对转换及定期折算份额。

§7 基金管理人运用固有