富兰克林国海沪港深成长精选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:中国工商银行股份有限公司
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。
基金托管人中国工商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20日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富沪港深成长精选股票
基金主代码	001605
交易代码	001605
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月20日
报告期末基金份额总额	24,923,896.58份
投资目标	本基金主要投资于具有持续成长潜力和核心竞争优势的上市公司的股票,在有效控制风险的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据各类证券风险收益特征的相对变化,适度地调整确定基金资产在股票、债券及现金等大类资产的分配比例。 (一)行业配置策略 本基金根据宏观经济周期、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。 (二)股票投资策略 对于境内和香港市场的股票,本基金通过自下而上的个股精选策略,从行业发展前景、成长速度、成长质量、成长驱动因素这四个维度对企业的可持续成长能力进行评估。 (三)债券投资策略 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。 (四)资产支持证券投资策略 本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况,在严格控制投资风险的基础上进行投资,以获稳定收益。 (五)股指期货投资策略 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。 (六)中小企业私募债券投资策略 本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较,对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析,选择具有优势的品种进行投资,并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。
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。本基金将投资港股通的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

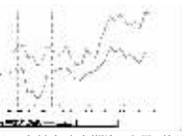
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月20日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	776,665.87
2.本期利润	2,532,120.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0196
4.期末基金资产净值	26,782,040.86
5.期末基金份额净值	1.075

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
自基金合同生效日起至今(2016年01月20日-2016年03月31日)	7.50%	1.33%	0.09%	1.72%	7.41%	-0.39%

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
富兰克林国海沪港深成长精选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
(2016年1月20日-2016年3月31日)



注:本基金基金合同生效日为2016年1月20日,本基金建仓期为6个月,截至报告期末基金尚未完成建仓。图示日期为2016年1月20日至2016年3月31日。

§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		
卫学海	国富深化价值混合基金、国富沪港深成长精选股票基金及国富成长动力混合基金的基金经理	2016年1月20日	-	12年	卫学海先生,复旦大学工程硕士。历任中国人保资产管理有限公司高级投资经理、长城证券有限责任公司高级投资经理、光大证券资产管理有限公司投资经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富深化价值混合基金、国富沪港深成长精选股票基金及国富成长动力混合基金的基金经理。

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《富兰克林国海沪港深成长精选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
2016年第一季度A股市场探底回升。受到熔断机制触发、人民币汇率下跌和投资者获利回吐的影响,A股市场在前两个月大幅下跌。进入3月后,人民币汇率企稳,宏观经济触底回升,市场随即进入反弹期。行业层面,消费品、周期品和金融板块跌幅较小,TMT板块下跌较多,白酒、贵金属等少数子行业取得了绝对正收益。
本基金在一季度的持仓结构未发生大的变化,依然坚持精选成长股思路,持有了成长明确、估值合理的传媒和社会服务业行业,对主题性的持仓,特别是计算机和互联网进行了较大幅度减持,少量参与了周期品行业的交易,但未获得明显的超额收益。整体来看,2016年的市场以获取绝对收益为首要任务,对持仓个股的成长性和估值要求需要更加严格。
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1.043元,本报告期基金份额净值下跌16.29%,同期业绩比较基准下跌11.47%,本基金落后业绩比较基准4.82%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
截至本报告期末,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

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	18,148,110.60	66.33
	其中:股票	18,148,110.60	66.33
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	8,561,546.03	31.29
8	其他资产	649,874.17	2.38
9	合计	27,359,530.80	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	4,424,657.30	16.52
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	11,576,886.50	43.23
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	2,146,566.80	8.01
S	综合	-	-
	合计	18,148,110.60	67.76

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	300496	中科创达	12,536	2,419,197.28	9.03
2	600887	刚泰控股	133,125	2,396,250.00	8.95
3	300059	东方财富	53,985	2,391,535.50	8.93
4	300133	华策影视	80,698	2,146,566.80	8.01
5	300017	网宿科技	33,561	1,960,298.01	7.32
6	300431	暴风科技	12,700	1,186,688.00	4.43
7	300287	飞利信	81,615	1,093,641.00	4.08
8	600718	东软集团	55,967	1,048,261.91	3.91
9	300271	华宇软件	43,496	926,464.80	3.46
10	000055	方大集团	50,700	713,349.00	2.66

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
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,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。
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	3,592.76
2	应收证券清算款	574,319.82
3	应收股利	-
4	应收利息	2,594.01
5	应收申购款	69,367.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	649,874.17

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	300287	飞利信	1,093,641.00	4.08	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	259,399,120.47
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	623,011.01
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	235,098,234.90
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	24,923,896.58

注:本基金合同生效日2016年1月20日

§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沪港深成长精选股票型证券投资基金设立的文件;
2、《富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金基金合同》;
3、《富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金招募说明书》;
4、《富兰克林国海沪港深成长精选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

富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金

【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:中国农业银行股份有限公司
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。
基金托管人中国农业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	国富沪深300指数增强
基金主代码	450008
交易代码	450008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年09月03日
报告期末基金份额总额	172,356,793.33份
投资目标	本基金采用指数增强投资策略。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,即时结合主动投资方法,在严格控制跟踪偏离风险的基础上,力争获得超越业绩比较基准标的投资收益,追求基金资产的长期增值。在正常市场情况下,本基金对业绩比较基准的年跟踪误差不超过8%。
投资策略	资产配置策略: 本基金以追求基金资产长期增长的稳定收益为宗旨,在股票市场上进行指数化被动投资的基础上,基金管理人在债券(剔除为主)、股票、现金等各类资产之间仅进行适度的主动配置。通过运用深入的基本面分析及先进的数量技术,控制与目标指数的跟踪误差,追求适度超越目标指数的收益。 股票投资策略: 本基金以指数化投资为主,以最小化跟踪误差为组合的投资控制目标,本基金所跟踪的目标指数为沪深300 指数。 本产品在指数化投资的基础上辅以有限度的增强操作(优化调整)及一级市场股票投资。具体而言,基金将基本依照目标指数的成份股构成权重,并借助数量化投资分析技术构造和调整指数化投资组合。在投资组合建立后,基金定期对比检验组合与比较基准的偏离程度,适时对投资组合进行调整,使指数优化组合与目标指数的跟踪误差控制在规定的范围内。在正常市场情况下,本基金对业绩比较基准的年跟踪误差不超过8%。此外,本基金将利用所持有股票市值参与一级市场股票投资,以在不增加额外风险的前提下提高收益水平,争取获得超过指数的回报。 债券投资策略: 本基金将在对宏观经济和资本市场进行研究的基础上,对利率结构、市场利率走势进行分析和预测,综合考虑中债国债指数各成份券种及金融债的收益率水平、流动性的好坏等因素,进行优化选择构建本基金的债券投资组合。 本基金以富兰克林邓普顿投资集团固定收益类资产投资研究平台及本基金管理人的投资研究平台为依托,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、财政政策研究及收益率曲线分析,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。
业绩比较基准	95% × 沪深300指数 + 5% × 银行同业存款利率
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金,属于较高风险、较高预期收益的证券投资基金。
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

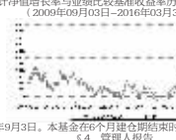
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年01月01日-2016年03月31日)
1.本期已实现收益	-13,875,403.25
2.本期利润	-33,104,711.27
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1918
4.期末基金资产净值	206,887,398.80
5.期末基金份额净值	1.200

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	-13.92%	2.52%	-13.02%	2.31%	-0.90%	0.21%

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
富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年09月03日-2016年03月31日)



注:本基金的基金合同生效日为2009年9月3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		
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	2013年03月21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Bizwach 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《富兰克林国海沪深300指数增强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
2016年一季度,A股市场开局不利,整体经历了大幅下跌,其中沪深300指数下跌了13.75%。实体经济方面,一季度,PM1指数触底反弹,三月份达50.2,较二月份的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,由于美国加息节奏较十较缓,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,本基金继续保持均衡的组合配置以控制主动投资风险,并运用量化选股策略力图实现指数增强。
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1.200元。本报告期,份额净值下跌13.92%,同期业绩比较基准下跌13.02%,基金表现落后业绩基准0.90%,期间基金年化跟踪误差为4.87%。
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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	194,803,208.42	93.49
	其中:股票	194,803,208.42	93.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	69,752.34	0.03
	其中:债券	69,752.34	0.03
	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	13,436,217.62	6.45
8	其他资产	69,584.25	0.03
9	合计	208,378,762.63	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
5.2.1.1 报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合

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	4,512,369.58	2.18
C	制造业	47,362,953.39	22.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,169,715.51	3.94
E	建筑业	6,522,616.59	3.15
F	批发和零售业	3,091,159.32	1.49
G	交通运输、仓储和邮政业	4,873,289.00	2.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,327,287.14	3.06
J	金融业	67,300,545.46	32.53
K	房地产业	10,550,109.99	5.10
L	租赁和商务服务业	2,326,638.25	1.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,781,030.70	0.86
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	3,606,733.60	1.74
S	综合	1,394,603.20	0.67
	合计	167,809,031.73	81.11

5.2.1.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

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	227,322.75	0.11
B	采矿业	507,021.25	0.25
C	制造业	15,628,585.30	7.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	689,184.00	0.33
E	建筑业	202,247.55	0.10
F	批发和零售业	1,995,838.00	0.96
G	交通运输、仓储和邮政业	432,012.00	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,518,770.84	1.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,824,338.00	1.37
L	租赁和商务服务业	882,098.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	38,387.00	0.02
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	1,048,372.00	0.51
S	综合	-	-
	合计	26,994,176.69	13.05

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
注: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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	491,329	7,630,339.37	3.69
2	000001	平安银行	541,937	5,766,209.68	2.79
3	601818	光大银行	1,510,600	5,664,750.00	2.74
4	600015	华夏银行	517,882	5,261,681.12	2.54
5	601601	中国太保	178,708	4,687,510.84	2.27
6	000002	万 科A	239,250	4,500,292.50	2.18
7	601939	建设银行	772,700	3,747,595.00	1.81
8	601328	交通银行	626,873	3,491,682.61	1.69
9	600030	中信证券	194,733	3,466,247.40	1.68
10	601788	光大证券	181,400	3,464,740.00	1.67

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002166	莱茵生物	62,100	804,195.00	0.39
2	600199	金种子酒	82,500	691,350.00	0.33
3	002099	海翔药业	55,000	565,400.00	0.27
4	000078	海王生物	34,000	557,600.00	0.27
5	600664	哈药股份	52,700	541,229.00	0.26

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(元)	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	69,752.34	0.03
10	其他	-	-
9	合计	69,752.34	0.03

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110032	三一转债	260	29,182.40	0.01
2	110033	国贸转债	200	22,648.00	0.01
3	123001	蓝标转债	158	17,921.94	0.01

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
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16日起,中信证券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,请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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	44,059.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,960.30
5	应收申购款	22,564.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,584.25

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	4,500,292.50	2.18	重大资产重组

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

报告期期初基金份额总额	172,150,203.46
报告期期间基金总申购份额	7,834,689.15
减:报告期期间基金总赎回份额	7,628,099.28
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	172,356,793.33

§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沪深300指数增强型证券投资基金设立的文件;
2,《富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》;
3,《富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》;
4,《富兰克林国海沪深300指数增强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

富兰克林国海健康优质生活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