

富兰克林国海弹性市值混合型证券投资基金

[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4月22日

§ 1 重要提示及目录

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	2,765,880,940.07	46.42
其中:股票		2,765,880,940.07	46.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	货币市场工具	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	黄金投资	-	-
8	其他资产	8,299,093.74	0.14
9	合计	5,936,285,534.29	100.00

注:本基金未通过沪港通交易机制投资港股股。

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	
行业名称	
A 农、林、牧、渔业	30,013,400.00
B 采矿业	114,020.00
C 制造业	1,748,445,432.07
D 电力、煤气、及水生产、供应业	56,567,000.00
E 建筑业	36,234.00
F 批发零售业	180,179,090.02
G 交通运输、仓储和邮政业	23,659,360.00
H 餐饮业	-
I 住宿业	-
J 信息技术服务	239,030,132.17
K 研究与试验发展	92,080,424.13
L 地产	75,086,300.00
M 货币金融服务	166,189,219.08
N 科学研究、技术服务与地质勘查业	-
O 水利、环境和公共设施管理业	85,419,766.00
P 教育	-
Q 卫生和社会工作	88,177,050.00
R 文化、体育和娱乐业	81,001,200.43
S 保险业	-
T 合计	2,765,880,940.07

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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000868	鞍钢股份	6,378,145.00	1.02
2	002008	爱施德	13,291,390.00	2.23
3	300006	大华股份	9,270,166.00	1.57
4	600006	中国银行	5,722,401.00	0.94
5	002024	苏宁云商	9,999,960.00	1.66
6	002083	南玻A	10,161,349.00	1.74
7	002220	科大讯飞	2,082,569.00	0.34
8	300007	东方财富	2,941,220.00	0.49
9	002053	东华能源	7,610,171.00	1.22
10	000707	万向钱潮	2,100,811.00	0.35

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

本基金本期未持有债券。

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

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

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

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本基金不投资贵金属。

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五名期货及衍生品投资明细

5.10 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

5.11 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基金投资明细

5.12 本报告期内不存在债券回购融资融券交易情况说明

5.13 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	卖出回购金融资产	3,238,400.17
2	应收利息	-
3	应收股利	-
4	应收保费	917,820.09
5	应收申购款	4,242,832.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,399,063.74

5.11.1 报告期持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期未持有处于转股期的可转债。

5.11.1.1 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	公允价值(元)	净资产比例(%)
1	000868	鞍钢股份	92,994,490.00	1.04
2	002008	爱施德	2,941,220.00	0.03
3	300006	大华股份	7,610,171.00	0.02
4	600006	中国银行	10,161,349.00	0.02
5	002024	苏宁云商	9,999,960.00	0.02
6	002083	南玻A	10,161,349.00	0.02
7	002220	科大讯飞	2,082,569.00	0.02
8	300007	东方财富	2,941,220.00	0.02
9	002053	东华能源	7,610,171.00	0.02
10	000707	万向钱潮	2,100,811.00	0.02

5.11.1.2 报告期持有的处于转股期的可转债变动情况

单位:份

报告期初基金份额总额	报告期期间内基金申购量	报告期期间内基金赎回量	报告期末基金份额总额
1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00
1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00
1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00

5.11.1.3 报告期持有的处于转股期的可转债变动情况

单位:份

报告期初基金份额总额	报告期期间内基金申购量	报告期期间内基金赎回量	报告期末基金份额总额
1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00
1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00
1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00

5.11.1.4 报告期持有的处于转股期的可转债变动情况

单位:份

报告期初基金份额总额	报告期期间内基金申购量	报告期期间内基金赎回量	报告期末基金份额总额
1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00
1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00
1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00

5.11.1.5 报告期持有的处于转股期的可转债变动情况

单位:份

报告期初基金份额总额	报告期期间内基金申购量	报告期期间内基金赎回量	报告期末基金份额总额
1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00	1,034,220,700.00
1,034,220,			