

## 富兰克林国海策略回报灵活配置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

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更加严格。

## 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

截至报告期末,本基金份额净值为1.25元,本报告期净值份额下跌16.45%,同期业绩比较基准增长率率为-7.72%,本基金落后业绩比较基准0.73%。

## 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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	44,645,7036	74.18
其中:股票			
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	权证投资	-	-
5	衍生品投资	-	-
6	其他投资	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,003,0266	24.00
8	其他资产	777,43405	1.27
9	合计	60,106,1361	100.00

注:本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

## 5.2 报告期未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	2,463,0700	4.16
C	制造业	82,760,1936	14.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	28,10600	0.02
F	批发和零售业	3,560,05626	0.24
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	31,824,65645	21.07
J	金融业	7,277,38208	12.06
K	房地产业	6,646,03000	1.02
L	租赁和商务服务业	3,071,22000	0.20
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	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
S	合计	137,631,21892	99.68

注:本基金管理人未通过沪港通交易机制投资港股。

## 5.3 主要财务指标和基金净值表现

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.本期实现收益		-7,136,696.06
2.本期利润		-11,764,798.49
3.加权平均基金份额本期利润		-0.2094
4.期末基金份额净值		60,106,1361
5.期末基金份额净值		12.06

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将低于所列数字。  
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

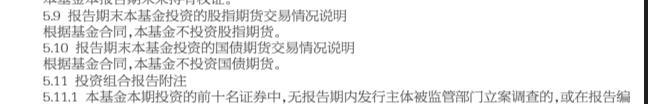
## 3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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的标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-16.06%	3.00%	-7.72%	1.46%	-8.27%	1.63%

## 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

富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注:本基金的基金合同生效日为2011年8月2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间		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王海宁	公司总经理助理、 合规风控部总经理、 风险管理部总经理、 基金经理	2013年7月20日	-	12年	

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,公司对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 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,公司对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 公平交易执行结果的说明

本基金未发现存在不公平的交易行为,没有利益输送的情况。

## 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。受到货币机制扰动、人民币汇率下跌和投资者获利回吐的影响,3月份后,人民币汇率企稳,宏观经济触底回升,市场逐步进入反弹行情。行业层面,消费品和原材料板块跌幅较小,而TMT板块下跌较多,白酒、贵金属等少数行业取得了绝对收益。

## 4.5 报告期内基金的绩效表现

## 4.5.1 报告期内基金的绩效评价

本基金在2016年一季度的表现符合预期,实现了正收益。

## 4.5.2 报告期内基金的业绩比较基准收益率的比较

富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注:本基金的基金合同生效日为2011年8月2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。

## 4.6 报告期内基金持有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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	44,645,7036	74.18
其中:股票			
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	权证投资	-	-
5	衍生品投资	-	-
6	其他投资	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,003,0266	24.00
8	其他资产	777,43405	1.27
9	合计	60,106,1361	100.00

注:本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

## 5.2 报告期未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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,172,05000	1.97
C	制造业	27,054,06000	46.42
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	1,790,71200	3.01
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	7,062,28000	11.87
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,348,10000	5.63
L	租赁和商务服务业	2,094,54000	4.81
M	科学研究、技术服务业	1,362,36000	2.32
O	居民服务、修理和其他服务业	64,000	0.01
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	44,645,7036	74.18

注:本基金管理人未通过沪港通交易机制投资港股。

## 5.3 主要财务指标和基金净值表现

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)





<tbl\_r cells="3"