

信息披露 Disclosure

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:2017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2017年1月18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。

本报告自2016年10月1日起至12月31止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	国海富兰克林策略回报灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	480100
交易代码	480100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年02月01日
报告期末基金总份额	46,196,689.49份

投资目标:本基金基于本报告期内市场环境,采取灵活的资产配置策略,合理控制风险,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金基于对宏观经济和资本市场中长期趋势的判断进行资产配置,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

§ 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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	44,372,168.37	72.96
2	其中:股票	44,372,168.37	72.96
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	买入返售金融资产	5,000,000.00	8.25
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和拆出资金合计	11,381,436.63	18.69
10	其他资产	791,720.04	0.13
11	合计	60,119,305.03	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	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	1,073,000.00	3.17
B	采矿业	-	-
C	制造业	33,881,022.37	97.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,483,000.00	9.89
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	2,532,546.00	6.49
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,381,000.00	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	-	-
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		44,372,168.37	96.12

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通交易股票投资组合

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	000001	深证成指	210,000	3,506,200.00	6.69
2	300010	通设股份	100,000	3,274,000.00	6.04
3	000001	深证成指	200,000	3,274,000.00	6.04
4	000006	万科A	200,000	2,903,000.00	5.24
5	000046	山东钢铁	300,000	2,279,000.00	4.03
6	300031	安源科技	94,900	2,001,540.00	3.39
7	000063	云南能投	100,000	1,919,000.00	3.26
8	000230	云铝股份	80,000	1,473,000.00	2.51
9	000012	招商银行	60,000	1,352,000.00	2.30
10	300049	途牛旅游	60,000	1,720,000.00	3.01

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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、处罚的情况如下:

广东威创视讯科技股份有限公司(以下简称“威创股份”)于2016年2月收到广东证监局对威创股份下发的《关于广东威创视讯科技股份有限公司采取出具警示函措施的决定》(2016年9月)和《关于江玉兰采取出具警示函措施的决定》(2016年6月)(以下简称“决定”)。威创股份于2016年9月至2016年12月期间,将募集资金、300万元用于质押获得银行贷款,该事项未履行决策程序和信息披露义务。上述行为违反了《证券法》第十五条、《上市公司信息披露管理办法》上市公司募集资金管理和使用的监管要求》第五条的有关规定,对威创股份及财务总监江玉兰予以警示。

威创股份已完成整改,并于2016年11月11日公开披露了上述情况,威创股份将认真吸取教训,切实加强对公司法律法规的学习,严格执行募集资金使用的分派决策程序,规范募集资金使用和管理,杜绝此类类似事件再次发生。

本基金对威创股份投资决策:本公司的投研团队经过充分研究,上述《决定》是广东证监局采取的行政监管措施,上述事件仅对威创股份短期经营有一定影响,不改变威创股份长期投资价值。同时由于本基金看好房地产行业的发展前景而购入,威创股份幼儿园市场集中度提升趋势明显以及幼儿园入园人数增加,人均收费提升预期较大,因此买入威创股份。本基金管理人对该股的投资决策遵循公司的投资决策流程。

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	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金		66,333.94
2	应收证券清算款		16,469.61
3	应收股利		-
4	应收利息		5,962.19
5	应收申购款		-
6	其他应收款		-
7	待摊费用		-
8	其他资产		-
9	合计		79,765.74

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的可转换债券。

5.11.5 报告期末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	流通受限的股票数量(股)	占基金资产净值比例(%)	流通受限原因
1	300232	瀚蓝环保	1,020,400.00	3.30	重大资产重组停牌

§ 6 开放式基金份额变动

项目	单位:份
报告期初基金份额总额	47,750,526.62
报告期基金总申购份额	1,066,460.28
报告期基金总赎回份额	1,091,500.10
报告期末基金份额总额	46,196,689.49

7.1 基金管理人持有本基金基金份额情况

项目	单位:份
报告期末基金管理人持有的本基金份额	3,890,272.37
报告期末基金管理人持有的本基金份额	3,890,272.37
报告期末基金管理人持有的本基金份额	3,890,272.37
报告期末基金管理人持有的本基金份额	3,890,272.37
报告期末基金管理人持有的本基金份额	3,890,272.37

7.2 基金管理人持有本基金基金份额情况

报告期末基金管理人持有本基金基金份额情况如下:

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会上网披露富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;
2. (富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同);
3. (富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书);
4. (富兰克林国海策略回报灵活配置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

基金管理人及基金托管人的住所并登载于基金管理人网站:www.ftfund.com。

8.3 查阅方式

1. 投资者在基金开放日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. 登载基金管理人网站www.ftfund.com查询。

国海富兰克林基金管理有限公司
2017年1月20日

富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金

2016 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:2017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2017年1月18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。

本报告自2016年10月1日起至12月31止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	国海富兰克林成长动力混合型证券投资基金
基金代码	480007
交易代码	480007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年3月26日
报告期末基金总份额	11,742,663.29份

投资目标:本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

本基金通过投资于具有良好成长性和持续成长能力的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,