富兰克林国海恒瑞债券型证券投资基金

【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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商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。

本报告期自2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富恒瑞债券
基金主代码	002361
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月4日
报告期末基金份额总额	783,670,698.02份
投资目标	通过积极主动的资产管理和严格的风险控制,在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下,力求为投资者提供稳定增长的投资收益。
投资策略	(一)债券的投资策略 本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素,并结合各种债券类资产在特定经济形势下的估值水平,预期收益和预期风险特征,在符合本基金相关投资比例的前提下,决定组合的久期水平、期限结构和类属配置,并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的投资收益。 (二)股票投资策略 本基金将采用"自下而上"精选个股策略,对受益于国家/地区产业政策及经济发展方向的相关上市公司进行深入挖掘,精选具有核心竞争优势和持续成长能力的优质上市公司。 (三)资产支持证券投资策略 本基金将持续研究和密切跟踪国内资产支持证券品种的发展,对普通的和创新性的资产支持证券品种进行深入分析,在法律法规允许的前提下制定相应的投资策略。在具体投资过程中,重点关注基础资产的类型、发行条款、提前偿还率和市场流动性等因素,综合运用定性基本面分析和定量分析对资产支持证券的价值进行评估,谨慎投资。 (四)国债期货投资策略 本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。 基金管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。 (五)权证投资策略 本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上,本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判,估算权证合理价值,同时还充分考虑个券的流动性,谨慎进行投资。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金是债券型基金,属于证券投资基金中的较低预期风险和较低预期收益品种,其预期风险与预期收益水平低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	国富恒瑞债券A / 国富恒瑞债券C
下属分级基金的交易代码	002361 / 002362
报告期末下属分级基金的份额总额	773,351,767.02份 / 10,318,931.00份

§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10月1日 - 2016年12月31日)	
	国富恒瑞债券A	国富恒瑞债券C
1. 本期已实现收益	11,003,847.94	763,400.46
2. 本期利润	-1,104,074.32	-184,054.87
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0015	-0.0040
4. 期末基金资产净值	820,480,488.34	10,905,917.70
5. 期末基金份额净值	1.061	1.057

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

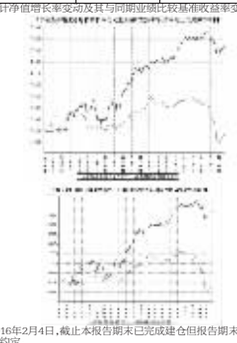
国富恒瑞债券A

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	0.47%	0.14%	-1.90%	0.17%	2.37%	-0.03%

国富恒瑞债券C

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	0.48%	0.14%	-1.90%	0.17%	2.38%	-0.03%

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



注:本基金的基金合同生效日为2016年2月4日,截止本报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。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、QDII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	2016年2月4日	-	13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潜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、QDII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

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

A股市场四季度冲高回落,经济在供给侧改革政策的推动下,PMI持续走高,不断回升的经济数据使市场风险偏好有所回升。12月中旬美国按预期加息,债券市场行情下挫,导致12月市场走弱。四季度沪深300指数上涨1.75%,创业板指数下跌8.74%。板块方面,周期和防御性板块占优,表现最优的为传统蓝筹股。

本基金奉行价值投资的理念,坚持自下而上的选股策略,深度挖掘在"新经济、新技术、新模式"领域下优质公司的投资机会。四季度本基金按照精选个股的思路操作本产品,精选个股,以成长股为主,保持中性仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2016年四季度,基金净值下跌7.33%,业绩基准上涨1.12%,基金跑输业绩基准8.45个百分点。本基金持有成长股较多是四季度基金业绩跑输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

本报告期内,本基金存在连续二十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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	98,187,857.30	11.79
	其中:股票	98,187,857.30	11.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	666,942,280.21	80.05
	其中:债券	666,942,280.21	80.05
	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	28,500,162.75	3.42
	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	15,593,397.39	1.87
8	其他资产	23,889,849.78	2.87
9	合计	833,113,547.43	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	88,488,857.30	10.64
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	4,818,000.00	0.58
K	房地产业	4,881,000.00	0.59
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	98,187,857.30	11.81

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	1,777,827	26,205,169.98	3.15
2	300156	神雾环保	649,400	16,241,494.00	1.95
3	002553	南方轴承	1,274,812	15,680,187.60	1.89
4	600305	恒顺醋业	792,196	9,282,849.28	1.11
5	603308	应流股份	300,000	6,576,000.00	0.79
6	002890	美亚光电	300,864	6,386,282.24	0.77
7	000711	京蓝科技	150,000	4,881,000.00	0.59
8	300367	东方网力	243,050	4,870,722.00	0.59
9	600030	中信证券	300,000	4,818,000.00	0.58
10	603008	喜临门	177,134	3,241,552.20	0.39

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	7,367,500.00	0.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,984,000.00	4.81
	其中:政策性金融债	39,984,000.00	4.81
4	企业债券	171,728,117.01	20.66
5	企业短期融资券	280,199,000.00	33.70
6	中期票据	161,171,500.00	19.39
7	可转债(可交换债)	6,492,163.20	0.78
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	666,942,280.21	80.22

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	041655018	16伊泰集CP001	300,000	30,276,000.00	3.64
2	136056	15玉皇01	300,000	30,084,000.00	3.62
3	160201	16国开01	300,000	29,994,000.00	3.61
4	011606004	16电网SCP004	300,000	29,916,000.00	3.60
5	011698663	16广国SCP002	300,000	29,805,000.00	3.58

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

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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,无投资对象在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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	121,324.40
2	应收证券清算款	10,006,168.06
3	应收股利	-
4	应收利息	13,751,959.78
5	应收申购款	10,397.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,889,849.78

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110035	白云转债	2,491,200.00	0.30
2	113010	江南转债	313,500.00	0.04
3	127003	海印转债	180,401.40	0.02

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	603308	应流股份	6,576,000.00	0.79	重大资产重组停牌
2	000711	京蓝科技	4,881,000.00	0.59	重大资产重组停牌
3	300367	东方网力	4,870,722.00	0.59	重大资产重组停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国富恒瑞债券A	国富恒瑞债券C
报告期期初基金份额总额	407,338,580.08	43,471,465.01
报告期期间基金总申购份额	522,048,852.43	25,240,300.43
减:报告期期间基金总赎回份额	156,035,665.49	58,392,834.44
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	773,351,767.02	10,318,931.00

§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

单位:份

项目	国富恒瑞债券A	国富恒瑞债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	28,652,340.02	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期末管理人持有的本基金份额	28,652,340.02	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	3.70	-

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恒瑞债券型证券投资基金设立的文件;
2、《富兰克林国海恒瑞债券型证券投资基金基金合同》;
3、《富兰克林国海恒瑞债券型证券投资基金招募说明书》;
4、《富兰克林国海恒瑞债券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
2017年1月20日

富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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。

本报告期自2016年10月1日起至12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	27,724,756.14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,以获得稳定收益。 (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 本基金利用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标的股票,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10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	-2,578,473.17
2.本期利润	-2,566,146.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0543
4.期末基金资产净值	24,897,397.16
5.期末基金份额净值	0.898

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。

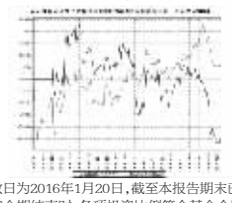
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-7.33%	1.04%	1.12%	0.61%	-8.45%	0.43%

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



注:本基金的基金合同生效日为2016年1月20日,截至本报告期末已完成建仓,但报告期末距建仓结束不满一年。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		
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	-	13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 报告期内基金投资策略和运作分析

A股市场四季度冲高回落,经济在供给侧改革政策的推动下,PMI持续走高,不断回升的经济数据使市场风险偏好有所回升。12月中旬美国按预期加息,债券市场行情下挫,导致12月市场走弱。四季度沪深300指数上涨1.75%,创业板指数下跌8.74%。板块方面,周期和防御性板块占优,表现最优的为传统蓝筹股。

本基金奉行价值投资的理念,坚持自下而上的选股策略,深度挖掘在"新经济、新技术、新模式"领域下优质公司的投资机会。四季度本基金按照精选个股的思路操作本产品,精选个股,以成长股为主,保持中性仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2016年四季度,基金净值下跌7.33%,业绩基准上涨1.12%,基金跑输业绩基准8.45个百分点。本基金持有成长股较多是四季度基金业绩跑输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

本报告期内,本基金存在连续二十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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	23,475,477.01	73.75
	其中:股票	23,475,477.01	73.75
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	5,155,286.29	16.20
8	其他资产	3,199,404.33	10.05
9	合计	31,830,167.63	100.00

注:本基金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	8,247,055.72	33.12
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	8,093,571.58	32.51
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,129,138.00	4.54
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	829,575.84	3.33
S	综合	-	-
	合计	18,299,341.14	73.50

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
材料	-	-
电信服务	-	-
信息技术	2,026,284.31	8.14
非必需消费品	1,756,920.59	7.06
必需消费品	-	-
能源	-	-
保健	-	-
金融	1,392,930.97	5.59
工业	-	-
公用事业	-	-
合计	5,176,135.87	20.79

注:以上分类采用GICS行业分类标准。

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	300088	长信科技	231,277	3,388,208.05	13.61
2	000338	潍柴动力	8,500	1,392,930.97	5.59
3	300059	东方财富	82,149	1,390,782.57	5.59
4	000175	吉利汽车	192,249	1,274,287.72	5.12
5	300322	硕贝德	63,834	1,179,652.32	4.74
6	600687	刚泰控股	73,523	1,165,339.55	4.68
7	000711	京蓝科技	34,700	1,129,138.00	4.54
8	000700	模塑科技	6,100	1,035,100.14	4.16
9	300212	易华录	32,001	977,310.54	3.93
10	300098	高新兴	68,800	965,264.00	3.88

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

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,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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	25,484.14
2	应收证券清算款	3,172,064.05
3	应收股利	-
4	应收利息	762.70
5	应收申购款	1,093.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,199,404.33

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

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	300088	长信科技	3,388,208.05	13.61	重大资产重组停牌
2	600687	刚泰控股	1,165,339.55	4.68	重大资产重组停牌
3	000711	京蓝科技	1,129,138.00	4.54	重大资产重组停牌
4	300212	易华录	977,310.54	3.93	重大资产重组停牌
5	300098	高新兴	965,264.00	3.88	重大资产重组停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	53,018,383.04
报告期期间基金总申购份额	642,069.78
减:报告期期间基金总赎回份额	25,935,696.68
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	27,724,756.14

§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
2017年1月20日

富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金

【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。

本报告期自2016年10月1日起至12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9月3日
报告期末基金份额总额	158,390,048.09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,同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