

# 富兰克林国海健康优质生活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法律责任。  
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。  
本报告期内无重大诉讼、仲裁事项。  
本报告自2016年10月11日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称	国海健康优质生活股票
基金代码	000971
基金简称	000971
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年10月23日
报告期末基金份额总额	17,091,082.29份
投资目标	本基金通过投资于有利于提升居民健康水平和能够促进人民生活水平提高的优质生活类上市公司，在严格控制投资风险的基础上，力争为基金份额持有人实现长期增值。

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期 2016年10月1日至2016年12月31日
1.本期投资收益率	43.13%
2.本期利润	-229.7726元
3.本期基金份额净值增长率	-0.022%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差距	10.264749%
5.本期基金份额持有人户数	1,069

§4 投资组合报告

4.1 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	16,038,330.00	81.96
2	基金投资	16,038,330.00	81.96
3	固定收益投资	-	-
4	其中：债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	3,246,297.76	17.51
9	合计	19,284,627.76	100.00

4.2 基金资产净值分析

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	-1.76%	0.88%	11.21%	0.61%	-12.97%	0.27%

4.3 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×65%+中国国债总收益率×35%。

4.4 基金管理人及基金托管人

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

4.5 基金管理人及基金托管人

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

4.6 基金管理人及基金托管人

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

4.7 基金管理人及基金托管人

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

4.8 基金管理人及基金托管人

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

4.9 基金管理人及基金托管人

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

4.10 基金管理人及基金托管人

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

4.11 基金管理人及基金托管人

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

4.12 基金管理人及基金托管人

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

4.13 基金管理人及基金托管人

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

4.14 基金管理人及基金托管人

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

4.15 基金管理人及基金托管人

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

4.16 基金管理人及基金托管人

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

4.17 基金管理人及基金托管人

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

4.18 基金管理人及基金托管人

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

4.19 基金管理人及基金托管人

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

4.20 基金管理人及基金托管人

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

4.21 基金管理人及基金托管人

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

4.22 基金管理人及基金托管人

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

4.23 基金管理人及基金托管人

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

4.24 基金管理人及基金托管人

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

4.25 基金管理人及基金托管人

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

4.26 基金管理人及基金托管人

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

4.27 基金管理人及基金托管人

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

4.28 基金管理人及基金托管人

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

4.29 基金管理人及基金托管人

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

4.30 基金管理人及基金托管人

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

4.31 基金管理人及基金托管人

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

4.6 报告期末基金持有人人数或基金资产净值情况说明  
报告期末，本基金已达标的小工作日基金资产净值低于五千万元。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。  
§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	16,038,330.00	81.96
2	基金投资	16,038,330.00	81.96
3	固定收益投资	-	-
4	其中：债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	3,246,297.76	17.51
9	合计	19,284,627.76	100.00

5.2 基金资产净值分析

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	-1.76%	0.88%	11.21%	0.61%	-12.97%	0.27%

5.3 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×65%+中国国债总收益率×35%。

5.4 基金管理人及基金托管人

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

5.5 基金管理人及基金托管人

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

5.6 基金管理人及基金托管人

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

5.7 基金管理人及基金托管人

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

5.8 基金管理人及基金托管人

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

5.9 基金管理人及基金托管人

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

5.10 基金管理人及基金托管人

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

5.11 基金管理人及基金托管人

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

5.12 基金管理人及基金托管人

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

5.13 基金管理人及基金托管人

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

5.14 基金管理人及基金托管人

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

5.15 基金管理人及基金托管人

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

5.16 基金管理人及基金托管人

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

5.17 基金管理人及基金托管人

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

5.18 基金管理人及基金托管人

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

5.19 基金管理人及基金托管人

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

5.20 基金管理人及基金托管人

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

5.21 基金管理人及基金托管人

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

5.22 基金管理人及基金托管人

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

5.23 基金管理人及基金托管人

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

5.24 基金管理人及基金托管人

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

5.25 基金管理人及基金托管人

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

5.26 基金管理人及基金托管人

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

5.27 基金管理人及基金托管人

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

5.28 基金管理人及基金托管人

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

5.29 基金管理人及基金托管人

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

5.30 基金管理人及基金托管人

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

5.31 基金管理人及基金托管人

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

5.32 基金管理人及基金托管人

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

5.33 基金管理人及基金托管人

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

# 富兰克林国海焦点驱动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法律责任。  
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。  
本报告期内无重大诉讼、仲裁事项。  
本报告自2016年10月11日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称	国海焦点驱动灵活配置
基金代码 <td>000906</td>	000906
基金简称 <td>000906</td>	000906
基金运作方式 <td>契约型开放式</td>	契约型开放式
基金合同生效日 <td>2013年6月17日</td>	2013年6月17日
报告期末基金份额总额 <td>1,194,414,197.08份</td>	1,194,414,197.08份
投资目标 <td>本基金通过投资于具有良好成长性的优质上市公司股票，并适度参与固定收益类资产，在严格控制投资风险的基础上，力争为基金份额持有人实现长期增值。</td>	本基金通过投资于具有良好成长性的优质上市公司股票，并适度参与固定收益类资产，在严格控制投资风险的基础上，力争为基金份额持有人实现长期增值。

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期 2016年10月1日至2016年12月31日
1.本期投资收益率	22.90%
2.本期利润	1,597,222.66元
3.本期基金份额净值增长率	0.0014%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差距	1,579,116.1261%
5.本期基金份额持有人户数	1,122

§4 投资组合报告

4.1 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	16,038,330.00	81.96
2	基金投资	16,038,330.00	81.96
3	固定收益投资	-	-
4	其中：债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	3,246,297.76	17.51
9	合计	19,284,627.76	100.00

4.2 基金资产净值分析

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	-1.76%	0.88%	11.21%	0.61%	-12.97%	0.27%

4.3 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×65%+中国国债总收益率×35%。

4.4 基金管理人及基金托管人

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

4.5 基金管理人及基金托管人

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

4.6 基金管理人及基金托管人

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

4.7 基金管理人及基金托管人

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

4.8 基金管理人及基金托管人

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

4.9 基金管理人及基金托管人

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

4.10 基金管理人及基金托管人

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

4.11 基金管理人及基金托管人

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

4.12 基金管理人及基金托管人

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

4.13 基金管理人及基金托管人

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

4.14 基金管理人及基金托管人

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

4.15 基金管理人及基金托管人

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

4.16 基金管理人及基金托管人

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

4.17 基金管理人及基金托管人

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

4.18 基金管理人及基金托管人

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

4.19 基金管理人及基金托管人

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

4.20 基金管理人及基金托管人

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

4.21 基金管理人及基金托管人

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

4.22 基金管理人及基金托管人

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

4.23 基金管理人及基金托管人

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

4.24 基金管理人及基金托管人

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

4.25 基金管理人及基金托管人

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

4.26 基金管理人及基金托管人

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

4.27 基金管理人及基金托管人

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

4.28 基金管理人及基金托管人

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

4.29 基金管理人及基金托管人

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

4.30 基金管理人及基金托管人

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

4.31 基金管理人及基金托管人

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

注：本基金通过沪深300指数编制投资组合。  
§2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,431,822.03	0.48
B	制造业	229,311,063.52	14.23
C	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
D	建筑业	19,592.23	0.00
E	交通运输业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	信息传输、软件和信息技术服务业	6,431,822.03	0.41
H	金融业	20,084,269.69	1.48
I	住宿和餐饮业	4,581,632.00	0.29
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	教育、体育、娱乐和休闲业	-	-
O	卫生健康业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	合计	263,502,275.52	16.67

§2.2 报告期末按行业分类的沪深300指数股票投资组合

本基金通过沪深300指数编制投资组合。

序号	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000006 万科A	7,512,013	84,491,477.62	6.36
2	000025 特变电工	2,791,106	34,331,003.80	2.62
3	200156 豫园股份	1,149,881	28,760,524.47	2.17
4	000629 攀钢钒钛	949,169	20,766,722.18	1.59
5	000006 中国平安	1,231,279	14,881,223.00	1.09
6	600883 博瑞转债	796,625	12,369,730.00	0.91
7	602019 悦达起亚	160,000	10,969,000.00	0.81
8	600000 浦发银行	8,195,000	8,195,000.00	0.60
9	600030 中信证券	580,000	8,036,000.00	0.60
10	601288 农业银行	1,181,287	6,196,428.88	0.45

§2.3 报告期末按行业分类的沪深300指数股票投资组合

本基金通过沪深300指数编制投资组合。

序号	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000006 万科A	7,512,013	84,491,477.62	6.36
2	000025 特变电工	2,791,106	34,331,003.80	2.62
3	200156 豫园股份	1,149,881	28,760,524.47	2.17
4	000629 攀钢钒钛	949,169	20,766,722.18	1.59
5	000006 中国平安	1,231,279	14,881,223.00	1.09
6	600883 博瑞转债	796,625	12,369,730.00	0.91
7	602019 悦达起亚	160,000	10,969,000.00	0.81
8	600000 浦发银行	8,195,000	8,195,000.00	0.60
9	600030 中信证券	580,000	8,036,000.00	0.60
10	601288 农业银行	1,181,287	6,196,428.88	0.45

§2.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金通过沪深300指数编制投资组合。

2	央行票据	-	-
3	金融债券	220,112,000.00	13.93
	其中:政策性金融债	220,112,000.00	13.93
4	企业债券	179,125,047.27	11.34
5	企业短期融资券	250,981,000.00	15.98
6	中期票据	253,160,000.00	16.02