

富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金

[2017]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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员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。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

2017年1季度，基金净值上涨3.63%，业绩基准上涨3.61%，跑赢业绩基准0.07个百分点，家电、白酒板块对业绩贡献较大。

4.7 报告期内基金持有数或基金份额净值预警说明

无。

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	94,029,340.02	89.09
其中:股票		94,029,340.02	89.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
其中:债券		-	-
4	贵金属投资	-	-
5	现金类投资	-	-
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	7,167,093.64	6.79
其他资产	3,506,290.00	3.22	
合计	106,405,690.65	100.00	

注:本基金管理人通过沪港通交易机制投资港股。

5.2 基金产品概况

本基金为混合型基金,其风险收益特征介于股票型基金与债券型基金之间,在合理控制风险的前提下,力求实现基金资产的长期增值。

5.3 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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -3,024,007.03

2.本期利润 3,806,079.40

3.加权平均基金份额本期利润 0.0471

4.期末基金资产净值 103,770,286.37

5.期末基金份额净值 1.161

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),计算费用后实际可供分配的利润低于零时除外。
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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 3.09% 0.36% 3.19% 0.44% -0.04% 0.02%

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2009年3月25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

杜飞 国富成长动力混合型基金基金经理兼研究总监 2015年7月17日 ~ 6年 杜飞先生,上海财经大学经济学硕士,历任国泰君安证券有限公司研究所研究员,国泰君安证券有限公司研究员,国海富兰克林基金管理有限公司高级研究员,基金经理助理,基金经理,基金经理兼研究总监,现任国海富兰克林基金管理有限公司基金经理兼研究总监,基金经理兼研究总监。

卫学海 国富稳健成长混合型基金基金经理 2015年6月26日 2017年2月26日 13年 卫学海先生,复旦大学工商管理硕士,历任中国平安保险有限公司投资部研究员,国寿安保基金管理有限公司研究员,国寿安保基金管理有限公司基金经理,现任国寿安保基金管理有限公司基金经理兼研究总监。

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,兼任基金经理的“任职日期”为基金经理同效日。
2. 表中“从事年限”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年限的总和。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵循守信情况的说明

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及《富兰克林国海成长动力混合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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资运作符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

报告期内,公司在公平交易报告发布公平性、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,按照规定制度要求对异常交易进行控制和审批。

4.4 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交易较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.5 报告期内基金投资运作情况

4.5.1 报告期内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换债券。

4.5.1.1 报告期内前十名债券中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.2 报告期内按行业分类的债券投资情况

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.3 报告期内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。

4.5.1.4 报告期内未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有处于转股期间的可转换债券。

4.5.1.5 报告期内前十名债券中存在流动性受限情况的说明

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.6 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.7 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.8 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.9 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.10 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.11 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.12 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.13 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.14 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.15 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.16 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.17 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.18 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.19 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.20 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.21 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.22 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.23 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.24 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.25 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.26 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.27 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.28 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.29 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.30 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.31 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.32 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.33 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.34 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.35 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.36 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.37 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.38 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.39 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.40 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

4.5.1.41 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细