

富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金

2015 年第 2 季度报告

公告日期：2015-07-21

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

重要提示

基金产品概况

基金基本情况

主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标

基金净值表现

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

自基金合同生效以来基金累计份额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

其他指标

管理人报告

基金经理（或基金经理小组）简介

报告期内本基金运作遵规守信情况说明

公平交易专项说明

公平交易专项说明

公平交易制度和控制方法

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

异常交易行为的专项说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的业绩表现

报告期内基金投资策略和运作分析

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

报告期末按行业分类的股票投资组合

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

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本期国债期货投资评价

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

其他资产构成

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

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 2015 年 7 月 17 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 2015 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

基金基本情况

项目 数值

基金简称 国富健康优质生活股票

场内简称 -基金主代码 000761

前端交易代码 000761

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2014-09-23

报告期末基金份额总额 20,093,011.79

投资目标 本基金主要通过投资于有利于提升民众健康水平和能够满足人们优质生活需求的上市公司，在严格控制投资风险的基础上，力争获取基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金将重点关注有利于提升民众健康水平和能够提供优质生活产品和服务的行业和个股。

1、行业配置策略

(1) 本基金的股票资产采用“核心-卫星”策略进行行业配置。本基金的核心行业配置

资产将主要投资于与提升居民健康和生活品质主题直接相关的行业，投资比例不低于非现金基金资产的 80%。

随着经济增长方式的转变和产业结构的升级，居民的需求也会发生变化，从而导致满足居民健康和优质生活需求的行业范围发生变化。本基金将通过对居民需求变化和行业发展趋势的研究，适时调整健康优质生活主题所覆盖的行业范围。

(2) 本基金在具体进行行业配置时，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。

2、个股精选策略

本基金将采用“自下而上”精选个股策略，紧密围绕健康优质生活的投资主题，从主题、行业地位、公司发展战略、核心竞争力、公司治理结构和管理层分析、估值水平等方面进行综合评价，精选优质股票构建投资组合。

3、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。

4、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。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

5、权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型确定其合理估值水平，谨慎地进行投资，在控制下跌风险、实现保值的前提下，追求较为稳定的增值收益。

业绩比较基准 $85\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 15\% \times \text{中债国债总指数收$
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。

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

基金保证人 -

主要财务指标

单位：人民币元

项目 2015-04-01 至 2015-06-30(元)

本期已实现收益 24,409,382.58

本期利润 6,811,414.83

加权平均基金份额本期利润 0.1307

期末基金资产净值 26,061,022.15

期末基金份额净值 1.297

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。

基金净值表现

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 -9.55% 3.94% 9.28% 2.22% -18.83% 1.72%

自基金合同生效以来基金累计份额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：本基金基金合同生效日为 2014 年 9 月 23 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。

其他指标

单位：元

序号 其他指标 报告期（2015-04-01 至 2015-06-30）

序号 其他指标 报告期（2015-06-30）

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

王晓宁 公司研究分析部副总经理，国富策略回报混合基金、国富健康优质生活股票基金基金经理 2014-09-23 - 11 年 王晓宁先生，中央财经大学学士学位。历任万

家基金管理有限公司研究员、研究总监助理、基金经理助理，国海富兰克林基金管理有限公司行业研究主管，国富潜力组合股票基金、国富成长动力股票基金和国富策略回报混合基金的基金经理助理。截止本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部副总经理，国富策略回报混合基金、国富健康优质生活股票基金基金经理。

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

等相关金融领域的工作年限的总和。

报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实守信、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。

公平交易专项说明

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。

公平交易制度和控制方法

-

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-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。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.297 元，本报告期净值增长率为-9.55%，同期业绩

比较基准增长率为 9.28%，本基金落后业绩比较基准 18.83%。本报告期内，由于巨额

赎回等不利影响，大盘超预期下跌过程中受到较大拖累，基金净值回撤幅度较大。

报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年二季度 A 股市场先扬后抑，并在 6 月 15 日后出现大幅度下跌。市场风格出

现明

显转变，以互联网为代表的新兴成长行业在持续上涨 2 个季度后，以剧烈的下跌完成了

价值回归的过程，而金融、地产等传统蓝筹行业表现较为平稳，在季末的市场回调中体现出较强的抗跌性。市场展开调整的时点符合预期，但调整的方式出乎意料，杠杆的大范围运用致使下跌过程中个股连续踩踏，最终导致流动性缺失。

本基金在二季度延续了一季度的投资思路，继续持有互联网、体育、军工等行业，并在季末增持了部分蓝筹和国企改革行业，以起到防御的作用。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

-

报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

报告期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益类投资 24,680,186.82 85.47

其中：股票 24,680,186.82 85.47

2	固定收益投资	-	-其中：债券	-	-资产支持证券	-	-3	贵金属投资	-	-4	
	金融衍生品投资	-	-5	买入返售金融资产	-	-其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-6	银行存款和结算备付金合计	1,052,250.68	3.64
7	其他资产	3,143,474.43	10.89								
8	合计	28,875,911.93	100								

报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

序号	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	11,895,727.12	45.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -E 建筑业	2,534,804	9.73
F	批发和零售业	3,642,092.84	13.98
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	4,971,927.34	19.08
J	金融业 - -K 房地产业 - -L 租赁和商务服务业	1,635,635.52	6.28
M	科学研究和技术服务业 - -N 水利、环境和公共设施管理业 - -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	24,680,186.82	94.7

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：元

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	000090	天健集团	104,528	2,534,804	9.73
2	300004	南风股份	36,435	2,477,580	9.51
3	002462	嘉事堂	44,108	2,342,134.8	8.99
4	600446	金证股份	17,888	2,208,452.48	8.47
5	300041	回天新材	49,549	1,782,277.53	6.84
6	600358	国旅联合	95,988	1,635,635.52	6.28
7	300228	富瑞特装	19,600	1,563,296	6
8	300059	东方财富	23,066	1,455,233.94	5.58
9	600038	中直股份	22,700	1,406,265	5.4
10	002318	久立特材	26,800	1,403,784	5.39

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：元

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 - -2 央行票据 - -3 金融债券 - -其中：政策性金融债 - -4 企业债券 - -5 企业短期融资券 - -6 中期票据 - -7 可转债 - -8 其他 - -		
9	合计 - -注：本基金本报告期末未持有债券。		

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：元

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（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

金额单位：元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	-------	-------	-------	---------	--------------

注：根据基金合同，本基金不投资贵金属。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

金额单位：元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
公允价值变动总额合计(元) -股指期货投资本期收益(元) -股指期货投资本期公允价值变动(元) -本基金本报告期末未持有股指期货。					

本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元) -国债期货投资本期收益(元) -国债期货投资本期公允价值变动(元) -本期国债期货投资评价					

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

单位：元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

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。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

其他资产构成

单位：元

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	149,731.31
---	-------	------------

2	应收证券清算款	2,695,517.34
---	---------	--------------

3 应收股利 -4 应收利息 2,182.64
5 应收申购款 296,043.14
6 其他应收款 -7 待摊费用 -8 其他 -9 合计 3,143,474.43

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位：元

序号 债券代码 债券名称 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有处于转股期间的可转债。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

单位：

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 300228 富瑞特装 1,563,296 6 进行非公开发行股票事项

投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

开放式基金份额变动（仅适用于开放式基金）

单位：份

项目 数值

报告期期初基金份额总额 64,447,447.16

报告期期间基金总申购份额 8,684,195.33

报告期期间总赎回份额 53,038,630.7

报告期期间基金拆分变动份额 -报告期期末基金份额总额 20,093,011.79

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

项目 份额总额(份)

报告期期初管理人持有的本基金份额 -报告期期间买入/申购总份额 -报告期期间卖出/赎回总份额 -报告期期末管理人持有的本基金份额 -报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) -基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位：份

序号 交易方式 交易日期 交易份额（份） 交易金额（元） 适用费率

合计 -注：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。

影响投资者决策的其他重要信息

-

备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海健康优质生活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。

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.cm。

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.cm 查阅。