

富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金

2015年第3季度报告

2015年9月30日

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：2015年10月26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2015年10月22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7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国富潜力组合混合
基金主代码	450003
交易代码	450003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月22日
报告期末基金份额总额	1,263,081,951.80份
投资目标	注重基金资产长期增值，投资未来收益具有成长性和资产价值低估的上市公司股票，为投资者赚取长期稳定的资本增值。
投资策略	<p>资产配置策略：</p> <p>本基金采用“自下而上”的组合构建方法，从上市公司的具体发展前景和未来的盈利分析，到行业的发展趋势，再到宏观经济形势，确定大类资产的配置。</p> <p>在运用了“自下而上”策略之后，根据市场环境的变化、市场出现的各种套利机会和未来的发展趋势判断，确定本基金资产配置最终的选择标准。</p> <p>股票选择策略：</p> <p>本基金将运用定性和定量方法，通过对上市公司的财务分析和增长潜力分析，挑选出其中股价下跌风险最低且上涨空间最大的股票构建具体的股票组合。</p>

	债券投资策略： 本基金的债券投资为股票投资由于市场条件所限，不易实施预定投资策略时，使部分资产保值增值的防守性措施。
业绩比较基准	85%×MSCI中国A股指数+ 10%×中债国债总指数（全价）+ 5%×同业存款息率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高风险收益特征的基金品种。
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：根据2014年8月8日起施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于不同基金类别所适用投资比例的规定，自2015年8月8日起，富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金的基金类别变更为混合型基金，基金合同部分条款相应修订。本次变更基金类别并修订基金合同的事项不损害基金份额持有人的利益，亦不涉及基金合同当事人权利义务变化，无需召开基金份额持有人大会。变更修订事项已报中国证监会备案并公告，符合相关法律法规及基金合同的规定。

§ 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（2015年7月1日-2015年9月30日）
1. 本期已实现收益	-297,828,064.68
2. 本期利润	-547,046,591.82
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.4274
4. 期末基金资产净值	1,539,017,214.44
5. 期末基金份额净值	1.2185

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	①-③	②-④

				④		
过去三个月	-25.28%	3.52%	-25.06%	2.89%	-0.22%	0.63%

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

富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2007年3月22日-2015年9月30日)



注：本基金的基金合同生效日为2007年3月22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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐荔蓉	公司副总经理、投资总监、研究分析部总经理，国富中国收益混合基金、	2014年2月21日	—	18年	徐荔蓉先生，CFA，CPA（非执业），律师（非执业），中央财经大学经济学硕士。历任中国技术进出口总公司金融部副总经理、融通基金管理有限公司基金经理、申万巴黎基金管理有限公司（现“申万菱信基金管理有限公司”）基金经理、

	国富潜力组合混合基金和国富研究精选混合基金基金经理				国海富兰克林基金管理有限公司高级顾问、资产管理部总经理兼投资经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理、投资总监、研究分析部总经理，国富中国收益混合基金、国富潜力组合混合基金和国富研究精选混合基金基金经理。
--	---------------------------	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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《富兰克林国海潜力组合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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度, 股票市场在6月份大幅度下跌后继续震荡下行, 市场人气极度缺乏, 个股活跃度降至冰点, 总体看当季成长股表现疲弱, 蓝筹股相对较为稳定, 市场大幅调整。本基金在7月份逢高降低了股票仓位, 并在季度末随着市场逐步出现企稳迹象和投资者

情绪逐渐陷入极度悲观时逐步提高了股票仓位，同时组合结构保持了相对的平衡，对成长股和蓝筹类股票均进行了增持。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金三季度业绩略落后于业绩基准0.22%，主要是组合中保持了相当比例的成长股，在下跌过程中对净值有所拖累，基金相对较低的股票仓位对组合有一定正面贡献。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 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	1,324,799,126.93	85.62
	其中：股票	1,324,799,126.93	85.62
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	111,026,000.00	7.18
	其中：债券	111,026,000.00	7.18
	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	104,737,709.42	6.77
8	其他资产	6,780,210.31	0.44
9	合计	1,547,343,046.66	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	635,829,055.74	41.31
D	电力、热力、燃气及水生产和	21,440,000.00	1.39
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	30,420,000.00	1.98
G	交通运输、仓储和邮政业	37,259,684.10	2.42
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服	212,528,432.38	13.81
J	金融业	252,012,553.70	16.37
K	房地产业	37,756,855.89	2.45
L	租赁和商务服务业	18,139,000.00	1.18
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	24,433,545.12	1.59
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	54,980,000.00	3.57
S	综合	—	—
	合计	1,324,799,126.93	86.08

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	002563	森马服饰	8,000,000	80,560,000.00	5.23
2	601211	国泰君安	3,899,922	72,538,549.20	4.71
3	600588	用友网络	2,599,921	62,788,092.15	4.08
4	002405	四维图新	2,300,071	57,846,785.65	3.76
5	600469	风神股份	4,281,414	55,230,240.60	3.59
6	300251	光线传媒	2,000,000	54,980,000.00	3.57
7	601688	华泰证券	3,948,775	54,966,948.00	3.57
8	601318	中国平安	1,800,000	53,748,000.00	3.49

9	002268	卫士通	1,103,640	53,063,011.20	3.45
10	002450	康得新	1,644,300	49,805,847.00	3.24

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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	111,026,000.00	7.21
	其中：政策性金融债	111,026,000.00	7.21
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	111,026,000.00	7.21

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	140305	14进出05	1,000,000	100,990,000.00	6.56
2	150301	15进出01	100,000	10,036,000.00	0.65

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

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 本基金本期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、处罚的证券如下：

华泰证券于2015年9月11日公告关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告。2013年7月29日，华泰证券威宁路营业部应客户上海朝兴置业有限公司（以下简称朝兴置业）的要求，与杭州恒生网络技术服务股份有限公司（以下简称恒生网络）共同测试HOMS系统接入华泰证券软件系统。系统连通后，在朝兴置业未使用的情况下，华泰证券并未切断其与HOMS系统的连接端口，也未对此专线设置相应监控。2014年10月至12月期间，华泰证券在对于自身交易系统没有采取预防措施的情况下，允许浙江核新同花顺网络信息股份有限公司（以下简称同花顺）工程人员在华泰证券机房安装了资产管理模块。对于上述外部接入的第三方交易终端软件，华泰证券未进行软件认证许可，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份情况缺乏了解。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项的规定，证监会拟决定：一、对华泰证券责令改正，给予警告，没收违法所得18,235,275.00元，并处以54,705,825.00元罚款；二、对胡智给予警告，并处以10万元罚款；三、对陈栋给予警告，并处以10万元罚款。

本基金对华泰证券投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件仅对华泰证券短期经营有一定影响，不改变公司长期投资价值。同时由于我们看好证券行业整体的发展前景，因此买入华泰证券。本基金管理人对该股的投资决策遵循公司的投资决策制度。

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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,033,075.08
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	3,535,000.99
5	应收申购款	212,134.24

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,780,210.31

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,364,329,337.10
报告期期间基金总申购份额	99,201,985.24
减：报告期期间基金总赎回份额	200,449,370.54
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	1,263,081,951.80

§ 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

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	7,371,175.82
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	7,371,175.82
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.58

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015年7月6日	7,371,175.82	9,999,000.00	—
合计			7,371,175.82	9,999,000.00	

注：以上申购的适用费率为固定费用，费用为1,000.00元。

§ 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潜力组合混合型证券投资基金设立的文件；

- 2、《富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海潜力组合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
二〇一五年十月二十六日