

**富兰克林国海研究精选股票型证券投资基金2015年半年度报告摘要**

**2015年6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**

**送出日期：2015年8月28日**

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	国富研究精选股票
基金主代码	450011
交易代码	450011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月22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
报告期末基金份额总额	31,433,045.72份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对企业基本面全面、深入的研究，持续挖掘具有长期发展潜力和估值优势的上市公司，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金管理人采取积极的股票选择策略，旨在依托本公司的研究平台，综合采用基本面分析和深入调查研究相结合的研究方法，以"自下而上"的方式精选出具备可持续的竞争优势、杰出的成长潜质、出色的经营管理能力，同时有合理估值的上市公司，构建投资组合。</p> <p>2、行业配置策略</p> <p>本基金采取"自上而下"的方式进行行业配置，即根据宏观经济周期、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。</p> <p>3、资产配置策略</p> <p>本基金贯彻"自上而下"的资产配置策略，通过对宏观经济周期、国家经济政策、证券市场流动性和大类资</p>

	<p>产相对收益特征等因素的综合分析，在遵守大类资产投资比例限制的前提下进行积极的资产配置，对基金组合中股票、债券、短期金融工具的配置比例进行调整和优化，平衡投资组合的风险与收益。本基金在进行资产配置时，重点考察宏观经济状况、资金流动性、资产估值水平和市场因素这四个方面的。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	沪深300 指数收益率 × 80% + 中债国债总指数（全价）收益率 × 20%
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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国海富兰克林基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉
	联系电话	021-3855 5555
	电子邮箱	service@ftsfund.com
		王永民
		010-66594896
		fcid@bankofchina.com

客户服务电话	400-700-4518、9510-5680和 021-38789555	95566
传真	021-6888 3050	010-66594942

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2015年1月1日至2015年6月30日）
本期已实现收益	37,258,243.16
本期利润	32,293,999.43
加权平均基金份额本期利润	0.5414
本期加权平均净值利润率	26.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.9581
期末基金资产净值	61,550,252.39
期末基金份额净值	1.958

注：1. 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则—第1号《主要财务指标的计算及披露》。

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. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4. 上述基金业绩指标不包括持有人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要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-29.01%	4.85%	-5.94%	2.79%	-23.07%	2.06%
过去三个月	2.57%	3.92%	8.88%	2.09%	-6.31%	1.83%
过去六个月	32.30%	3.26%	21.60%	1.81%	10.70%	1.45%
过去一年	98.58%	2.48%	81.31%	1.47%	17.27%	1.01%
过去三年	98.58%	1.73%	63.31%	1.19%	35.27%	0.54%
自基金合同生效日起至今（2012年05月22日-2015年06月30日）	95.80%	1.70%	57.02%	1.18%	38.78%	0.52%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准=沪深300指数×80%+中债国债总指数（全价）×20%。

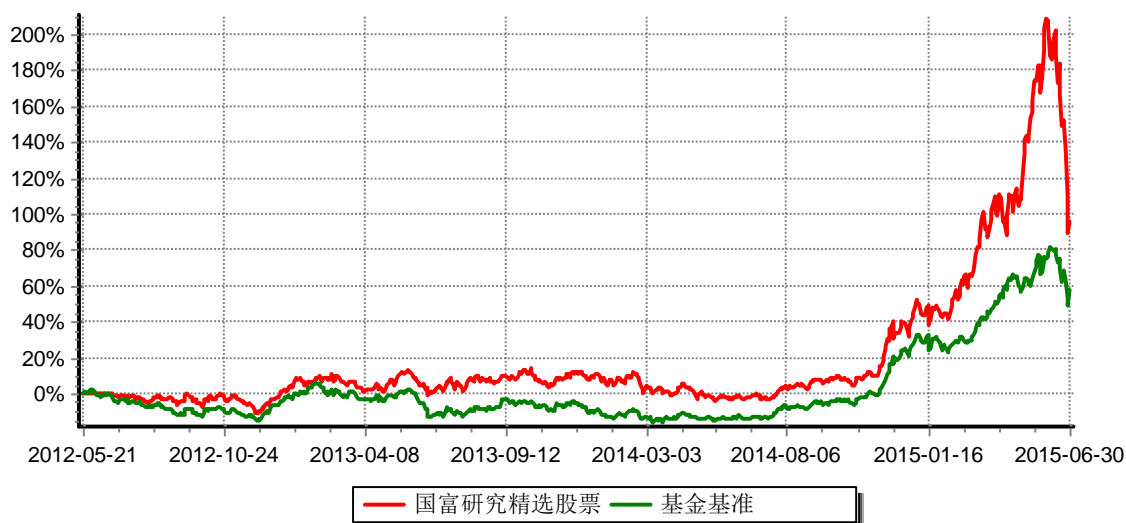
沪深300指数衡量股票投资部分的业绩，中债国债总指数（全价）衡量基金债券投资部分的业绩。两个指数均具有较强的代表性。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率（ $Benchmark_t$ ）按下列公式计算：

$$Benchmark_t = 80\% \times (\text{沪深300指数}_t / \text{沪深300指数}_{t-1-1}) + 20\% \times (\text{中债国债总指数（全价）}_t / \text{中债国债总指数（全价）}_{t-1-1})$$

其中， $t=1,2,3,\dots,T$ ， $T$ 表示时间截止日。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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2012年5月22日。本基金在建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国海富兰克林基金管理有限公司成立于2004年11月，由国海证券股份有限公司和富兰克林邓普顿投资集团全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建，目前公司注册资本2.2亿元人民币，国海证券股份有限公司持有51%的股份，邓普顿国际股份有限公司持有49%的股份。

国海证券股份有限公司是国内A股市场第16家上市券商，是拥有全业务牌照，营业网点遍布中国主要城市的全国性综合类证券公司。富兰克林邓普顿投资集团是世界知名基金管理公司，在全球市场上有超过65年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿投资集团享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系，借助国海证券股份有限公司的综合业务优势，力争成为国内一流的基金管理公司。

本公司具有丰富的管理基金经验。自2005年6月第一只基金成立开始，截至本报告期末，本公司已经成功管理了20只基金产品（包含A、C类混合基金，A、B、C类债券基金，A、B类货币市场基金）。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 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、国富潜力组合股票基金和国富研究精选股票基金基金经理	2012年5月22日	—	17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。截止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、国富潜力组合股票基金和国富研究精选股票基金基金经理。
何景风	公司行业研究主管，国富研究精选股票基金基金经理	2015年1月31日	—	6年	何景风先生，复旦大学管理学院技术经济及管理硕士。历任安永华明会计师事务所上海分所审计及企业咨询部审计员，国海富兰克林基金管理有限公司研究助理、助理研究员、研究员、高级研究员、国富弹性市值股票和国富深化价值股票基金经理助理。截止本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司行业研究主管，国富



					研究精选股票基金基金经理。
--	--	--	--	--	---------------

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《富兰克林国海研究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。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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。

报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

##### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年宏观经济总体呈现弱势企稳态势，但复苏前景仍不明朗，央行继续实行宽松的货币政策。市场方面，前5个月市场在互联网板块的带领下大幅上扬，市场活跃程度持续高涨，热点层出不穷，但6月中下旬后市场开始去杠杆，并触及一系列的连锁反应，市场开始大幅回调。纵观上半年，沪深300指数上涨26.58%，创业板指数上涨94.23%，中小板指数上涨69.06%，创业板和中小板市场表现总体优于主板市场；行业层面，计算机、轻工制造、纺织服装等行业表现较好，采掘、有色金属、金融等行业表现较弱。

上半年度，本基金一月份在金融、地产等行业配置较重，自二月份开始，本基金较

大幅度地调整了持仓结构，在互联网+、医药生物、新能源、新材料、文体教等新兴产业上保持了较重的仓位。二季度本基金整体维持了较高的股票仓位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年上半年，基金净值上涨32.30%，业绩基准上涨21.60%，基金跑赢业绩基准10.70个百分点。本基金仓位配置较多的成长股表现较好，是报告期基金业绩跑赢业绩基准的主要原因。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为宏观经济下行压力加大，通胀面临一定的变数但总体出现高通胀格局难现，货币政策预计持续保持宽松状态。市场经历大幅去杠杆后，上行高度受到一定的压制，市场有望由上半年的主体投资重新回归到价值发现的轨道。行业方面，我们认为周期性行业趋势性机会仍然偏小，“转型+创新”两大主线将在较长时间内主导市场。基于此，我们将继续深度挖掘在“新经济、新技术、新模式”领域下优质成长性公司的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会（简称“估值委员会”），并已制订了《公允估值管理办法》。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由董事长（本报告期内代为履行总经理职责）或其任命者负责，成员包括投研、风险控制、监察稽核、交易、基金核算方面的部门主管，相关人员均具有丰富的证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施分配的利润。

#### 4.8 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。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富兰克林国海研究精选证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海研究精选股票型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	13,999,972.80	5,084,301.48
结算备付金	1,502,161.36	1,577,033.88
存出保证金	90,465.59	24,333.99
交易性金融资产	54,590,028.17	77,802,506.96
其中：股票投资	54,590,028.17	77,802,506.96

基金投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	9,384,098.89	757,888.63
应收利息	3,885.25	723.73
应收股利	—	—
应收申购款	255,468.50	24,614.46
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	79,826,080.56	85,271,403.13
<b>负债和所有者权益</b>	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>负 债:</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	17,436,550.35	2,748,671.11
应付管理人报酬	205,577.47	58,297.01
应付托管费	34,262.93	9,716.16
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	362,054.98	238,544.14
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—

其他负债	237,382.44	365,288.80
负债合计	18,275,828.17	3,420,517.22
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	31,433,045.72	55,286,494.00
未分配利润	30,117,206.67	26,564,391.91
所有者权益合计	61,550,252.39	81,850,885.91
负债和所有者权益总计	79,826,080.56	85,271,403.13

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.958元，基金份额总额31,433,045.72份。

## 6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海研究精选股票型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期2015年1月1日 至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014 年6月30日
<b>一、收入</b>	34,817,255.94	-4,795,705.59
1.利息收入	34,966.79	18,777.26
其中：存款利息收入	34,966.79	18,723.96
债券利息收入	—	53.30
资产支持证券利息收 入	—	—
买入返售金融资产收 入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填 列）	39,411,431.75	45,790.97
其中：股票投资收益	39,201,931.98	-424,647.49
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	11,655.58
资产支持证券投资收 益	—	—

贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	209,499.77	458,782.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,964,243.73	-4,878,607.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	335,101.13	18,334.16
<b>减：二、费用</b>	<b>2,523,256.51</b>	<b>685,927.73</b>
1. 管理人报酬	893,846.10	341,701.58
2. 托管费	148,974.32	56,950.30
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	1,288,026.63	97,670.77
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	192,409.46	189,605.08
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>32,293,999.43</b>	<b>-5,481,633.32</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>32,293,999.43</b>	<b>-5,481,633.32</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海研究精选股票型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	55,286,494.00	26,564,391.91	81,850,885.91

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	32,293,999.43	32,293,999.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-23,853,448.28	-28,741,184.67	-52,594,632.95
其中：1.基金申购款	105,071,903.71	122,681,796.46	227,753,700.17
2.基金赎回款	-128,925,351.99	-151,422,981.13	-280,348,333.12
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	31,433,045.72	30,117,206.67	61,550,252.39
项 目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	48,153,692.32	5,324,522.05	53,478,214.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-5,481,633.32	-5,481,633.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-589,780.74	-507,639.88	-1,097,420.62
其中：1.基金申购款	15,452,737.88	384,136.99	15,836,874.87
2.基金赎回款	-16,042,518.62	-891,776.87	-16,934,295.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	47,563,911.58	-664,751.15	46,899,160.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

吴显玲（董事长，本报告期内  
代为履行总经理职责）

胡昕彦

黄宇虹

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海研究精选股票型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2011]第1949号《关于核准富兰克林国海研究精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海研究精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集752,280,792.42元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第166号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海研究精选股票型证券投资基金基金合同》于2012年5月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为752,413,354.31份。本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入132,561.89元。在本基金成立后,其中132,561.89元折算为132,561.89份基金份额,划入基金份额持有人账户。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海研究精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括:股票(包括中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、衍生工具(权证等)以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产净值的60%-95%;债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的5%-40%。其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证市值占基金资产净值的比例不超过3%。本基金的业绩比较基准为沪深300 指数收益率  $\times$  80% + 中债国债总指数(全价)收益率  $\times$  20%。

本财务报表由本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于2015年8月26日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他



相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海研究精选股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红

利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金管理人全资控股的子公司国海富兰克林资产管理（上海）有限公司以自有资金全额出资，成立国海富兰克林投资管理（上海）有限公司，并已在工商行政管理部门办理完成工商注册登记，取得营业执照。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
国海证券股份有限公司（“国海证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国海证券		—	1,697,392.96	2.64%

#### 6.4.8.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
	1,502.03	2.60%	939.39	4.77%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	893,846.10	341,701.58
其中：支付销售机构的客户维护费	290,413.26	159,987.76

注：支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	148,974.32	56,950.30

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

**6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

- 1.基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
- 2.本报告期和上年度可比期间（2014年1月1日至2014年6月30日）基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

- 1.本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
- 2.本报告期末和上年度末（2014年12月31日）除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	13,999,972.80	27,805.25	7,917,422.94	17,834.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.9 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌	停牌原因	期末	复牌	复牌	数量	期末	期末

代码	名称	日期		估值单价	日期	开盘单价		成本总额	估值总额
002416	爱施德	2015-05-05	重大事项停牌	20.99	2015-07-29	18.60	164,000	2,688,994.00	3,442,360.00
002586	围海股份	2015-05-04	资产重组	9.98		—	388,388	3,797,536.94	3,876,112.24
002589	瑞康医药	2015-05-21	重大事项停牌	93.86		—	34,300	3,077,518.00	3,219,398.00
002665	首航节能	2015-06-30	重大事项停牌	29.34	2015-07-01	30.00	174,206	3,846,515.23	5,111,204.04
300377	赢时胜	2015-05-20	重大事项停牌	145.52	2015-07-15	168.99	21,021	1,865,481.90	3,058,975.92

注：本基金截至2014年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为35,881,977.97元，属于第二层次的余额为18,708,050.20元，

无属于第三层次的余额(2015年12月31日：第一层次77,044,506.96元，第二层次758,000.00元，无第三层次)。于2015年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次(2015年12月31日：同)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月26日起改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值（附注6.4.5.2），并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	54,590,028.17	68.39
	其中：股票	54,590,028.17	68.39

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	15,502,134.16	19.42
7	其他各项资产	9,733,918.23	12.19
8	合计	79,826,080.56	100.00

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	9,425,302.83	15.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	3,876,112.24	6.30
F	批发和零售业	9,094,269.00	14.78
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	26,669,741.18	43.33
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	5,524,602.92	8.98
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	54,590,028.17	88.69

### 7.3 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：人民币元

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	002665	首航节能	174,206	5,111,204.04	8.30
2	300075	数字政通	124,858	4,705,898.02	7.65
3	300168	万达信息	91,289	4,484,115.68	7.29
4	600446	金证股份	33,478	4,133,193.88	6.72
5	002586	围海股份	388,388	3,876,112.24	6.30
6	300253	卫宁软件	74,400	3,868,800.00	6.29
7	002416	爱施德	164,000	3,442,360.00	5.59
8	002589	瑞康医药	34,300	3,219,398.00	5.23
9	300041	回天新材	85,887	3,089,355.39	5.02
10	300178	腾邦国际	85,492	3,087,116.12	5.02

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.ftsfund.com网站的半年度报告正文

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002642	荣之联	20,117,562.13	24.58
2	601166	兴业银行	14,848,068.86	18.14
3	600970	中材国际	11,179,696.24	13.66



4	300253	卫宁软件	11,133,356.41	13.60
5	002462	嘉事堂	10,908,053.07	13.33
6	002665	首航节能	10,155,750.14	12.41
7	600446	金证股份	9,751,581.02	11.91
8	601688	华泰证券	9,337,639.00	11.41
9	002589	瑞康医药	8,965,895.04	10.95
10	300212	易华录	8,821,880.50	10.78
11	300168	万达信息	8,437,536.00	10.31
12	300178	腾邦国际	8,045,778.96	9.83
13	300244	迪安诊断	7,880,641.56	9.63
14	300075	数字政通	7,877,392.24	9.62
15	300041	回天新材	7,837,228.37	9.58
16	300347	泰格医药	7,486,715.50	9.15
17	002063	远光软件	7,459,928.52	9.11
18	002142	宁波银行	6,299,870.00	7.70
19	002363	隆基机械	6,221,412.98	7.60
20	002396	星网锐捷	6,080,641.44	7.43
21	300287	飞利信	6,044,727.00	7.39
22	601169	北京银行	5,394,834.00	6.59
23	300054	鼎龙股份	4,932,282.03	6.03
24	002586	围海股份	4,820,772.00	5.89
25	300010	立思辰	4,759,131.00	5.81
26	601628	中国人寿	4,570,067.00	5.58
27	300399	京天利	4,566,450.70	5.58
28	300050	世纪鼎利	4,508,252.00	5.51
29	000661	长春高新	4,344,644.97	5.31
30	600358	国旅联合	4,223,273.17	5.16
31	600687	刚泰控股	4,213,096.72	5.15
32	600376	首开股份	4,188,360.43	5.12
33	300171	东富龙	3,962,392.53	4.84

34	601377	兴业证券	3,882,335.00	4.74
35	300096	易联众	3,605,040.03	4.40
36	300003	乐普医疗	3,341,224.00	4.08
37	002332	仙琚制药	3,317,709.28	4.05
38	600282	南钢股份	3,299,558.00	4.03
39	300325	德威新材	3,268,259.00	3.99
40	300006	莱美药业	3,265,484.35	3.99
41	600845	宝信软件	3,249,398.91	3.97
42	300335	迪森股份	3,229,855.00	3.95
43	000975	银泰资源	3,177,730.00	3.88
44	600513	联环药业	3,044,508.00	3.72
45	600219	南山铝业	3,041,268.86	3.72
46	601328	交通银行	2,991,950.00	3.66
47	000078	海王生物	2,977,021.00	3.64
48	002727	一心堂	2,958,221.01	3.61
49	000902	新洋丰	2,936,863.12	3.59
50	300101	振芯科技	2,764,154.75	3.38
51	000961	中南建设	2,754,234.80	3.36
52	002416	爱施德	2,688,994.00	3.29
53	000528	柳工	2,688,725.64	3.28
54	600661	新南洋	2,662,639.00	3.25
55	002666	德联集团	2,654,288.00	3.24
56	300231	银信科技	2,589,359.00	3.16
57	002488	金固股份	2,588,777.00	3.16
58	300059	东方财富	2,549,398.00	3.11
59	000831	五矿稀土	2,521,623.00	3.08
60	300377	赢时胜	2,475,950.00	3.02
61	002081	金螳螂	2,399,003.76	2.93
62	300155	安居宝	2,239,850.00	2.74
63	000024	招商地产	2,136,835.00	2.61

64	601800	中国交建	2,041,874.00	2.49
65	300113	顺网科技	2,033,875.00	2.48
66	002551	尚荣医疗	1,811,226.28	2.21
67	300151	昌红科技	1,796,744.00	2.20
68	300086	康芝药业	1,662,158.00	2.03

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002642	荣之联	22,836,109.74	27.90
2	601166	兴业银行	19,446,112.29	23.76
3	601688	华泰证券	12,283,999.11	15.01
4	600970	中材国际	11,588,174.04	14.16
5	300212	易华录	10,615,870.84	12.97
6	002462	嘉事堂	10,550,339.00	12.89
7	600446	金证股份	10,194,595.44	12.46
8	601169	北京银行	9,594,478.40	11.72
9	002665	首航节能	9,091,243.69	11.11
10	000024	招商地产	8,176,678.05	9.99
11	300075	数字政通	8,097,733.24	9.89
12	601328	交通银行	7,389,444.00	9.03
13	002589	瑞康医药	7,031,825.86	8.59
14	002363	隆基机械	6,760,525.40	8.26
15	300253	卫宁软件	6,611,968.68	8.08
16	300287	飞利信	6,352,327.80	7.76
17	300178	腾邦国际	6,290,611.31	7.69
18	002063	远光软件	6,256,548.13	7.64
19	300347	泰格医药	6,234,556.44	7.62
20	002142	宁波银行	6,083,438.35	7.43

21	300101	振芯科技	6,016,873.12	7.35
22	300041	回天新材	5,922,211.47	7.24
23	300054	鼎龙股份	5,858,373.80	7.16
24	300244	迪安诊断	5,773,959.10	7.05
25	002396	星网锐捷	5,754,469.42	7.03
26	300050	世纪鼎利	4,954,914.00	6.05
27	002332	仙琚制药	4,743,117.62	5.79
28	600000	浦发银行	4,708,836.00	5.75
29	601628	中国人寿	4,693,876.54	5.73
30	300335	迪森股份	4,625,441.01	5.65
31	000661	长春高新	4,346,902.77	5.31
32	600687	刚泰控股	4,289,571.53	5.24
33	600036	招商银行	4,282,659.20	5.23
34	601788	光大证券	4,233,481.00	5.17
35	601818	光大银行	4,182,400.00	5.11
36	600376	首开股份	4,172,972.18	5.10
37	600661	新南洋	3,895,226.68	4.76
38	600358	国旅联合	3,871,542.92	4.73
39	300096	易联众	3,859,611.95	4.72
40	300325	德威新材	3,814,016.00	4.66
41	601377	兴业证券	3,710,175.80	4.53
42	300003	乐普医疗	3,686,267.01	4.50
43	300006	莱美药业	3,635,710.50	4.44
44	300010	立思辰	3,611,651.16	4.41
45	002488	金固股份	3,542,554.75	4.33
46	601668	中国建筑	3,483,104.00	4.26
47	600513	联环药业	3,441,264.14	4.20
48	002666	德联集团	3,397,017.00	4.15
49	601998	中信银行	3,390,789.00	4.14
50	600219	南山铝业	3,284,980.00	4.01

51	002727	一心堂	3,202,211.58	3.91
52	600199	金种子酒	3,187,212.87	3.89
53	600282	南钢股份	3,176,748.73	3.88
54	600845	宝信软件	3,172,041.42	3.88
55	300168	万达信息	3,099,923.57	3.79
56	300399	京天利	3,039,864.88	3.71
57	000975	银泰资源	3,018,345.56	3.69
58	000078	海王生物	2,996,523.00	3.66
59	002563	森马服饰	2,885,646.52	3.53
60	300171	东富龙	2,880,367.45	3.52
61	600048	保利地产	2,779,061.10	3.40
62	000961	中南建设	2,735,069.78	3.34
63	002081	金螳螂	2,688,912.48	3.29
64	300059	东方财富	2,682,226.40	3.28
65	000858	五粮液	2,668,682.00	3.26
66	300151	昌红科技	2,646,151.12	3.23
67	600702	沱牌舍得	2,609,973.06	3.19
68	000528	柳工	2,603,115.00	3.18
69	300155	安居宝	2,443,790.24	2.99
70	000831	五矿稀土	2,366,591.00	2.89
71	300231	银信科技	2,332,368.08	2.85
72	600559	老白干酒	2,267,616.05	2.77
73	002553	南方轴承	2,232,280.14	2.73
74	000902	新洋丰	2,192,805.00	2.68
75	601800	中国交建	2,025,555.30	2.47
76	300113	顺网科技	1,939,515.25	2.37
77	600999	招商证券	1,890,403.00	2.31
78	300307	慈星股份	1,865,977.36	2.28
79	000728	国元证券	1,765,575.00	2.16
80	601601	中国太保	1,674,498.34	2.05

81	300291	华录百纳	1,672,339.76	2.04
82	600713	南京医药	1,654,880.00	2.02

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	389,202,345.11
卖出股票的收入（成交）总额	446,652,512.15

注：买入股票成本总额及卖出股票收入总额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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贵金属投资明细

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

#### 7.9 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。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

### 7.11 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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	90,465.59
2	应收证券清算款	9,384,098.89
3	应收股利	—
4	应收利息	3,885.25
5	应收申购款	255,468.50
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	9,733,918.23

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明

			公允价值		
1	002416	爱施德	3,442,360.00	5.59	重大事项停牌
2	002586	围海股份	3,876,112.24	6.30	资产重组
3	002589	瑞康医药	3,219,398.00	5.23	重大事项停牌
4	002665	首航节能	5,111,204.04	8.30	重大事项停牌

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
4,310	7,293.05	197,704.46	0.63%	31,235,341.26	99.37%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基 金	51,326.84	0.163289%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年5月22日)基金份额总额	752,413,354.31
本报告期期初基金份额总额	55,286,494.00



本报告期基金总申购份额	105,071,903.71
减：本报告期基金总赎回份额	128,925,351.99
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	31,433,045.72

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### （一）基金管理人重大人事变动

经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第十次会议审议通过，毕国强先生不再担任公司总经理，由公司董事长吴显玲女士代为履行总经理职责。相关公告已于2015年4月18日在《中国证券报》和公司网站披露。

经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第八次会议审议通过，自2015年1月31日起，何景风先生担任本基金的基金经理，与徐荔蓉先生共同管理本基金。相关公告已于2015年1月31日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露。

#### （二）基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自成立以来对其进行审计的均是普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

(一) 基金管理人及高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形:

本报告期内, 基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

(二) 基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	235,103,222.38	28.13%	208,043.01	27.86%	—
中银国际	1	232,359,808.57	27.8%	205,615.72	27.54%	—
广发证券	1	115,128,478.58	13.77%	104,812.62	14.04%	—
齐鲁证券	1	99,727,042.83	11.93%	90,792.01	12.16%	—
东方证券	2	91,856,468.78	10.99%	81,283.66	10.89%	—
光大证券	1	54,279,577.12	6.49%	49,416.15	6.62%	—
民生证券	1	4,961,683	0.59%	4,517.11	0.6%	—
华创证券	1	2,438,576	0.29%	2,157.91	0.29%	—
国海证券	2	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
瑞银证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—

中信建投	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—
银河证券	1	—	—	—	—	—
中信证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
东海证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	—

注：1. 专用交易单元的选择标准和程序

#### 1) 选择代理基金证券买卖的证券经营机构的标准

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，并租用其交易单元作为基金的专用交易单元。选择的标准是：

资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

财务状况良好，经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚；

内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

#### 2) 租用基金专用交易单元的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构，考察结果经公司领导审批后，我司与被选中的证券经营机构签订《券商交易单元租用协议》和《研究服务协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。

之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系，每季度对签约证券经营机构的服务进行一次综合评价：

A 提供的研究报告质量和数量；

B 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；

C 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；

D 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；

E 其他可评价的量化标准。

经过评价，对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。

交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

#### 2、报告期内证券公司基金专用交易单元的租用与变更情况

报告期内，根据上述基金专用交易单元选择标准和程序，本基金逐步租用证券公司的交易单元合计27个：其中国海证券、中金公司、申万宏源证券、中信建投证券、东方证券和海通证券各2个，光大证券、长江证券、中信证券、银河证券、中银国际证券、齐鲁证券、招商证券、华泰证券、国信证券、瑞银证券、广发证券、东海证券、兴业证券、华创证券和民生证券各1个。

国海富兰克林基金管理有限公司

二〇一五年八月二十八日