

富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金
2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 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 2017 年 3 月 23 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
8.6 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.....	53
8.7 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.....	53

8.8	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	53
8.9	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	54
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
8.12	投资组合报告附注	54
§9	基金份额持有人信息	56
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
9.3	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的情况	56
§10	开放式基金份额变动	57
§11	重大事件揭示	58
11.1	基金份额持有人大会决议	58
11.2	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	58
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4	基金投资策略的改变	59
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	59
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8	其他重大事件	62
§12	备查文件目录	67
12.1	备查文件目录	67
12.2	存放地点	67
12.3	查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金
基金简称	国富研究精选混合
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	48,398,585.84 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</p>

	<p>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。

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	王永民
	联系电话	021-3855 5555	010-6659 4896
	电子邮箱	service@ftsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555	95566
传真		021-6888 3050	010-6659 4942
注册地址		广西南宁市西乡塘区总部路 1 号中国—东盟科技企业孵 化基地一期 C-6 栋二层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 9 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		吴显玲	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	国海富兰克林基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 9 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-3,489,937.32	36,417,895.11	9,068,510.10
本期利润	-14,033,431.82	28,100,019.54	16,599,087.91
加权平均基金份额本期利润	-0.2623	0.5519	0.3871
本期加权平均净值利润率	-19.93%	30.03%	36.50%
本期基金份额净值增长率	-23.71%	11.42%	33.21%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	12,477,851.85	26,335,969.83	23,200,677.79
期末可供分配基金份额利润	0.2578	0.6485	0.4196
期末基金资产净值	60,876,437.69	66,945,617.17	81,850,885.91
期末基金份额净值	1.258	1.649	1.480
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	25.80%	64.90%	48.00%

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一第 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

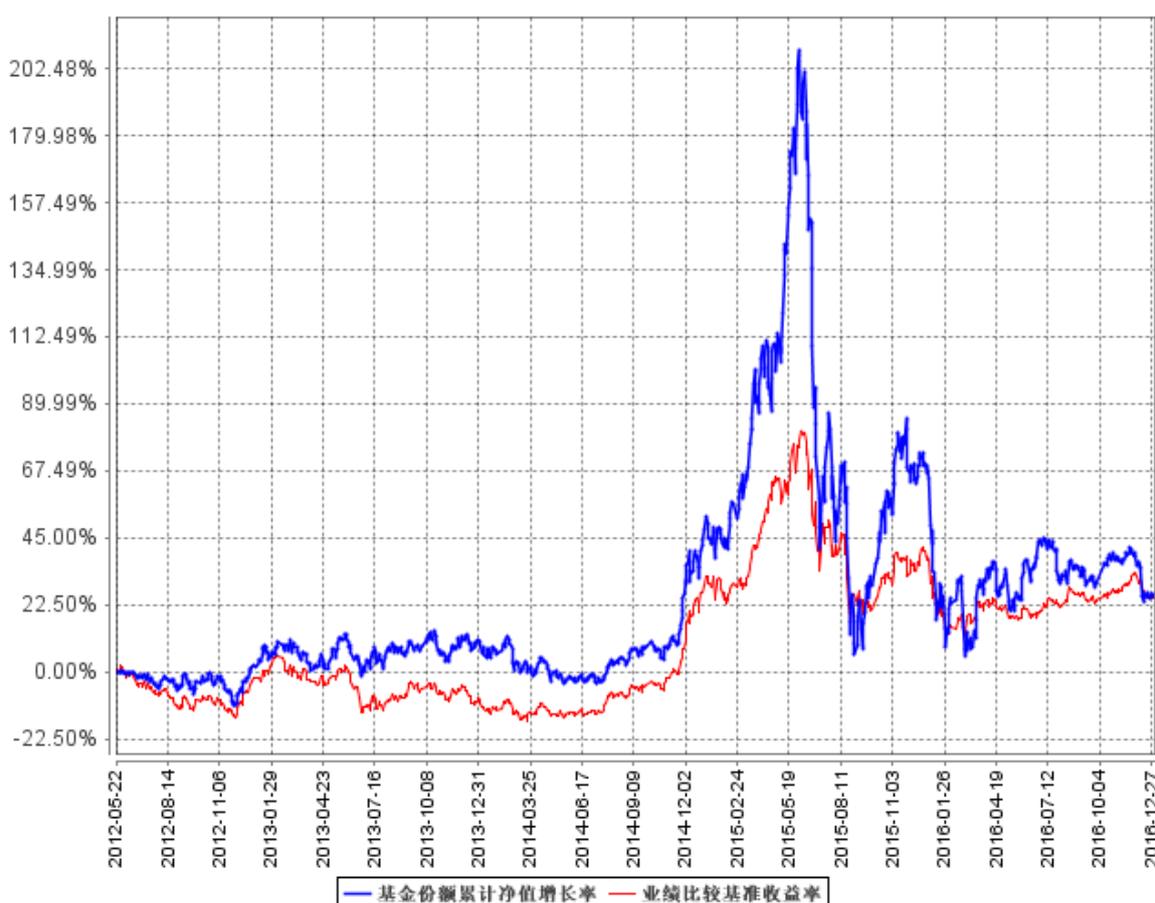
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-3.53%	1.31%	0.92%	0.58%	-4.45%	0.73%
过去六个月	-12.58%	1.31%	3.79%	0.61%	-16.37%	0.70%
过去一年	-23.71%	2.38%	-9.00%	1.12%	-14.71%	1.26%

过去三年	13.23%	2.64%	37.67%	1.43%	-24.44%	1.21%
自基金合同生效起至今	25.80%	2.23%	25.33%	1.31%	0.47%	0.92%

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

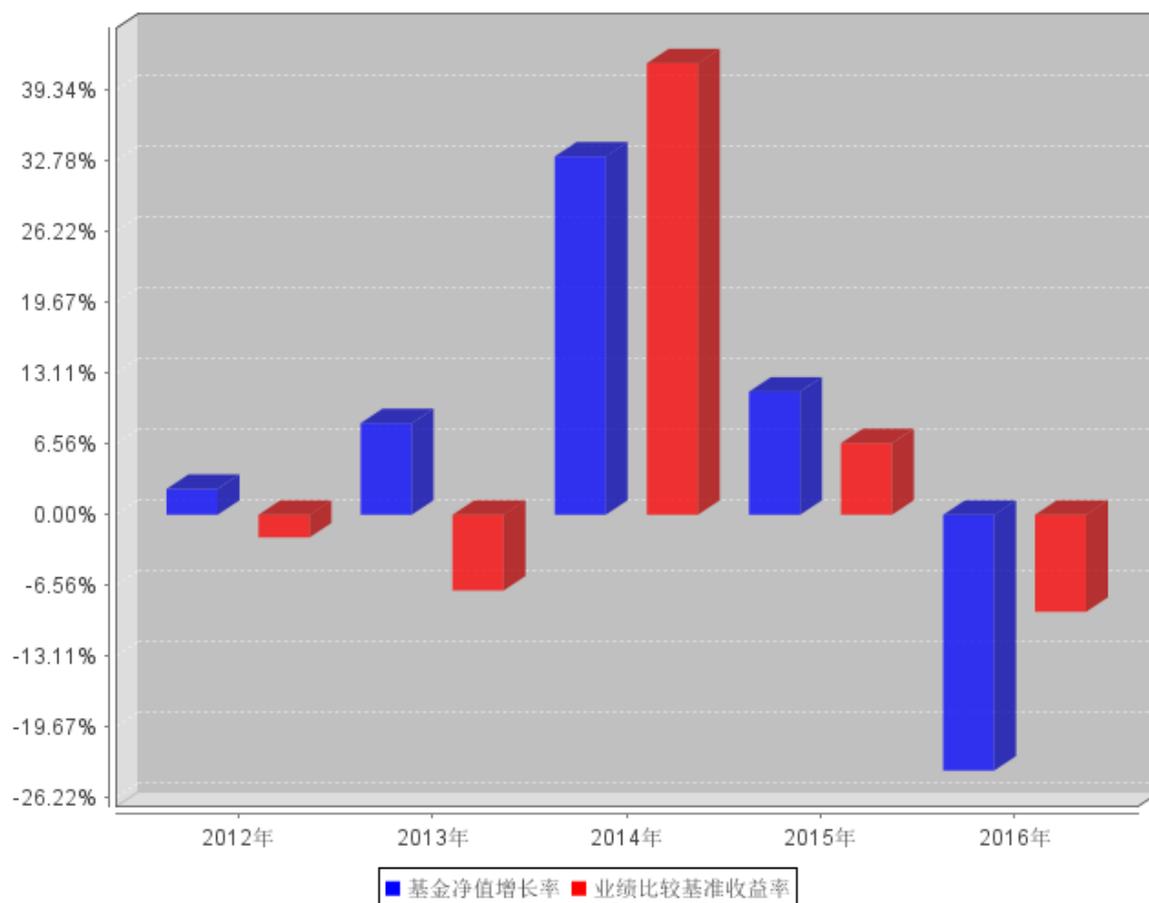
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2012 年 5 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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金成立于 2012 年 5 月 22 日，故 2012 年的业绩为成立日至年底的业绩而非全年的业绩。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发 放总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

§ 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 70 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 27 只基金产品（包含 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、管理层董事，国富中国收益混合基金、国富潜力组合混合基金及国富研究精选混合基金的基金经理	2012 年 5 月 22 日	-	19 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、管理层董事，国富中国收益混合基金、国富潜力组合混合基金及国富研究精选混合基金的基金经理。

何景风	公司行业研究主管及国富研究精选混合基金的基金经理	2015 年 1 月 31 日	-	7 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、国富弹性市值混合基金及国富深化价值混合基金的基金经理助理。截至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及国富研究精选混合基金的基金经理。
-----	--------------------------	-----------------	---	-----	---

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司建立了《公平交易管理制度》，确保公司旗下投资组合能够得到公平对待，避免各种投资组合之间的利益输送行为。我们主要从如下几个方面对公平交易进行控制：

1. 在研究信息共享方面，投资研究等部门通过定期的例会沟通机制，就相关议题进行讨论；公司建立了统一的研究平台，研究报告信息通过研究平台进行发布。
2. 建立投资对象备选库，股票及债券的入库需要由研究报告支持作为依据，并经过相关领导审批；建立研究报告的定期更新机制。
3. 在投资决策方面，公司在各类资产管理业务之间建立防火墙，确保业务隔离及人员隔离，同时各投资组合经理投资决策保持独立。

4. 公司对所有投资组合的交易指令实行集中交易，公司在交易系统中设置公平交易功能，按照时间优先、价格优先的原则执行各账户所有指令；公司建立和完善了对债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易分配制度，以确保相关投资组合能够得到公平对待。

5. 公司建立了《同日反向交易管理办法》，通过事前审批来对反向交易进行事前控制。公司每季度对不同时间窗下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。

6. 公司定期对公平交易执行情况进行监察稽核，并在监察稽核定期报告中做专项说明。公司也会在各投资组合的定期报告中，披露公平交易制度执行情况及异常交易行为专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内公司严格执行《公平交易管理制度》，明确了公平交易的原则和目标，制订了实现公平交易的具体措施，并在技术上按照公平交易原则实现了严格的交易公平分配。

报告期末，公司共管理了二十七只公募基金及十三只专户产品。统计所有投资组合分投资类别（股票、债券）过去连续 4 个季度内在不同时间窗口（T=1、T=3 和 T=5）存在同向交易价差的样本，并对差价率均值、交易价格占优比率、t 值、贡献率等指标进行分析，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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司按照《异常交易监控与报告制度》，系统划分了异常交易的类型、异常交易的界定标准、异常交易的识别程序，制订了异常交易的监控办法，并规范了异常交易的分析、报告制度。

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，公司不同投资组合之间未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，经公司检查和分析未发现异常情况。

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

2016 年中国宏观经济继续保持稳定态势，供给侧结构性改革取得积极进展，新经济继续保持较快发展，市场流动性全年保持稳健中性。2016 年 1 月份，市场在多重利空的作用下大幅下跌，3 至 6 月份市场企稳反弹，期间新能源、半导体等主题板块表现较好；进入下半年，市场风格出现明显转换，蓝筹股和周期股表现强于成长股。纵观全年，沪深 300 指数下跌 11.28%，创业板指数下

跌 27.71%，中小板指数下跌 22.89%，创业板和中小板市场表现总体显著弱于主板市场；行业层面，食品饮料、建筑建材、家电等行业表现较好，传媒、计算机、交通运输等行业表现较弱。

2016 年 1 月份本基金在计算机、传媒等行业配置较重，加之仓位较高，净值出现较大回撤；2016 年 3 月至 6 月，本基金逐步调整了持仓品种，加大了电子、新能源等行业的配置比例，这期间基金净值表现较好。进入下半年，市场风格转向蓝筹和周期性行业，本基金虽阶段性参与了周期性行业的投资，但总体上成长股和新兴产业持仓较重，致使本基金下半年跑输业绩基准较多。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年，本基金净值下跌 23.71%，业绩基准下跌 9.00%，基金跑输业绩基准 14.71 个百分点。本基金持仓较多的成长股表现较弱，是本基金业绩跑输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 2017 年，本基金认为宏观经济下行压力仍在，结构性矛盾仍旧突出，通货膨胀风险加大，货币政策预计维持稳健中性。随着供给侧结构性改革进一步推进，需求面的复苏程度将决定周期性行业盈利的持续性，2017 年周期性行业的增速可能面临前高后低的局面，周期性行业上半年的机会可能优于下半年；成长股方面，随着自 2015 年 7 月之后成长股的多轮下跌，估值风险已经充分释放，长期投资价值逐步显现，基于此，本基金将继续深度挖掘“新经济、新技术、新模式”领域优质成长性公司的投资机会。

本基金将继续按照基金合同及相关法律法规要求，努力做好基金投资工作，争取未来取得更好的长期投资收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，严格开展对基金相关法律文件和对外宣传资料的合规审核，积极加强对各部门、各主要运作环节的风险监控，并通过定期稽核和专项稽核，及时发现需要完善的业务环节，并落实措施。报告期内，本基金管理人特别关注基金投资研究交易、市场销售以及运营的合法合规和风险控制，对保护投资者利益涉及的各项业务环节以及信息技术安全开展了专项自查和采取控制措施。同时，本基金管理人开展多层次的员工合规教育和日常提示等措施，强化员工风控意识，努力营造合规经营文化。此外，本基金管理人依照规定，及时向监管部门、董事会报送监察稽核报告。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将继续深入分析和识别市场变化和潜在风险，积极采取措施，加强事前、事中

和事后的内部控制，提高监察稽核工作的科学性和有效性。

4.7 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。公司估值委员会由总经理或其任命者负责，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投资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。

4.8 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的利润。

4.9 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”）在对富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金（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《中华人民共和国证券投资基金法》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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21031 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金(原富兰克林国海研究精选股票型证券投资基金,以下简称“国富研究精选混合基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是国富研究精选混合基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为,上述国富研究精选混合基金的财务报表在所有重大

	方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了国富研究精选混合基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	单峰	傅琛慧
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2017 年 3 月 23 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,723,622.66	2,820,291.34
结算备付金		1,298,904.83	1,327,105.08
存出保证金		41,661.39	64,822.86
交易性金融资产	7.4.7.2	57,416,692.10	63,404,005.57
其中：股票投资		57,416,692.10	63,404,005.57
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,398,091.07
应收利息	7.4.7.5	774.64	866.02
应收股利		-	-
应收申购款		54,424.11	54,979.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		61,536,079.73	69,070,161.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	919,438.07
应付赎回款		179,227.63	573,597.77
应付管理人报酬		78,128.69	93,910.48
应付托管费		13,021.46	15,651.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	133,612.13	159,787.04
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	255,652.13	362,159.42
负债合计		659,642.04	2,124,544.50
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	48,398,585.84	40,609,647.34
未分配利润	7.4.7.10	12,477,851.85	26,335,969.83
所有者权益合计		60,876,437.69	66,945,617.17
负债和所有者权益总计		61,536,079.73	69,070,161.67

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.258 元，基金份额总额 48,398,585.84 份。

7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-11,459,574.15	31,884,988.86
1. 利息收入		57,686.63	57,878.46
其中：存款利息收入	7.4.7.11	57,686.63	57,878.46
债券利息收入		-	-
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）		-1,187,511.90	39,677,777.73
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,313,669.01	39,464,536.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	126,157.11	213,241.46
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-10,543,494.50	-8,317,875.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	213,745.62	467,208.24
减：二、费用		2,573,857.67	3,784,969.32
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,054,541.59	1,390,781.84
2. 托管费	7.4.10.2.2	175,756.93	231,796.94

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,114,018.74	1,772,707.65
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	229,540.41	389,682.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,033,431.82	28,100,019.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,033,431.82	28,100,019.54

7.3 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混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	40,609,647.34	26,335,969.83	66,945,617.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,033,431.82	-14,033,431.82
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）	7,788,938.50	175,313.84	7,964,252.34
其中：1. 基金申购款	138,716,936.36	42,385,221.84	181,102,158.20
2. 基金赎回款	-130,927,997.86	-42,209,908.00	-173,137,905.86
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）	48,398,585.84	12,477,851.85	60,876,437.69
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	-	28,100,019.54	28,100,019.54
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）	-14,676,846.66	-28,328,441.62	-43,005,288.28
其中：1. 基金申购款	182,561,991.02	161,496,981.47	344,058,972.49
2. 基金赎回款	-197,238,837.68	-189,825,423.09	-387,064,260.77
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）	40,609,647.34	26,335,969.83	66,945,617.17

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：

<u> 吴显玲 </u>	<u> 吴显玲 </u>	<u> 黄宇虹 </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金（原名为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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，富兰克林国海研究精选股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 8 日公告后更名为富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金。

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混合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、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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 2017 年 3 月 23 日批准报出。

7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)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混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金

指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础

确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101号《关于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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策

的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(2) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。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，暂免征收个人所得税。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	2,723,622.66	2,820,291.34
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	2,723,622.66	2,820,291.34

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	65,161,576.09	57,416,692.10	-7,744,883.99
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	65,161,576.09	57,416,692.10	-7,744,883.99
项目	上年度末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	60,605,395.06	63,404,005.57	2,798,610.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	60,605,395.06	63,404,005.57	2,798,610.51

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	648.44	715.84
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	107.40	120.20

应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	0.78
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	18.80	29.20
合计	774.64	866.02

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	133,612.13	159,787.04
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	133,612.13	159,787.04

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	652.13	2,159.42
审计费	55,000.00	60,000.00
信息披露费	200,000.00	300,000.00
合计	255,652.13	362,159.42

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,609,647.34	40,609,647.34
本期申购	138,716,936.36	138,716,936.36
本期赎回（以“-”号填列）	-130,927,997.86	-130,927,997.86
本期末	48,398,585.84	48,398,585.84

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	38,642,953.11	-12,306,983.28	26,335,969.83
本期利润	-3,489,937.32	-10,543,494.50	-14,033,431.82
本期基金份额交易产生的变动数	6,519,665.12	-6,344,351.28	175,313.84
其中：基金申购款	116,703,606.51	-74,318,384.67	42,385,221.84
基金赎回款	-110,183,941.39	67,974,033.39	-42,209,908.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,672,680.91	-29,194,829.06	12,477,851.85

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	51,703.68	47,366.66
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	5,109.73	8,080.23
其他	873.22	2,431.57
合计	57,686.63	57,878.46

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	368,713,318.94	604,033,042.71
减：卖出股票成本总额	370,026,987.95	564,568,506.44
买卖股票差价收入	-1,313,669.01	39,464,536.27

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	126,157.11	213,241.46
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	126,157.11	213,241.46

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-10,543,494.50	-8,317,875.57
——股票投资	-10,543,494.50	-8,317,875.57
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-10,543,494.50	-8,317,875.57

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

	日	
基金赎回费收入	207,260.64	431,464.85
基金转换费收入	6,484.98	35,743.39
合计	213,745.62	467,208.24

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,114,018.74	1,772,707.65
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,114,018.74	1,772,707.65

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	55,000.00	60,000.00
信息披露费	160,000.00	300,000.00
债券账户维护费	6,000.00	18,000.00
银行汇划费用	8,540.41	11,482.89
其他手续费	-	200.00
合计	229,540.41	389,682.89

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

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、基金注册登记机构、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、基金销售机构
国海证券股份有限公司（“国海证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
邓普顿国际股份有限公司（Templeton International, Inc.）	基金管理人的股东
国海富兰克林资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	5,818,002.90	0.78%	-	-

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31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
国海证券	5,301.88	0.78%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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
国海证券	-	-	-	-

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。
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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,054,541.59	1,390,781.84
其中：支付销售机构的客户维护费	478,591.71	503,025.87

注：支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付	175,756.93	231,796.94

的托管费		
------	--	--

注：支付基金托管人中国银行的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：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

1. 基金管理人运用自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(2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日)基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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(2015 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。

7.4.10.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	2,723,622.66	51,703.68	2,820,291.34	47,366.66

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股未上市	40.29	40.29	1,303	52,497.87	52,497.87	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股未上市	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股未上市	14.11	14.11	589	8,310.79	8,310.79	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股未上市	9.30	9.30	866	8,053.80	8,053.80	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	3.07	3.07	1,527	4,687.89	4,687.89	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002396	星网锐捷	2016年9月12日	重大资产重组停牌	19.70	2017年2月21日	18.35	71,832	1,465,561.33	1,415,090.40	-
002462	嘉事堂	2016年9月28日	重大资产重组停牌	42.53	2017年1月12日	38.98	32,701	1,318,523.56	1,390,773.53	-
300098	高新兴	2016年11月17日	重大资产重组停牌	14.03	2017年1月23日	14.26	96,500	1,418,434.21	1,353,895.00	-
300047	天源迪科	2016年8月15日	重大资产重组停牌	19.90	2017年1月6日	19.00	35,400	749,726.00	704,460.00	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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，该类股票在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末及上年度可比期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在

限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于债券型基金，谋求稳定和可持续的长期收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险控制部负责投资风险管理与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可接受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算

备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,723,622.66	-	-	-	2,723,622.66
结算备付金	1,298,904.83	-	-	-	1,298,904.83
存出保证金	41,661.39	-	-	-	41,661.39
交易性金融资产	-	-	-	57,416,692.10	57,416,692.10
应收利息	-	-	-	774.64	774.64
应收申购款	-	-	-	54,424.11	54,424.11
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,064,188.88	-	-	57,471,890.85	61,536,079.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	179,227.63	179,227.63
应付管理人报酬	-	-	-	78,128.69	78,128.69
应付托管费	-	-	-	13,021.46	13,021.46
应付交易费用	-	-	-	133,612.13	133,612.13
其他负债	-	-	-	255,652.13	255,652.13
负债总计	-	-	-	659,642.04	659,642.04
利率敏感度缺口	4,064,188.88	-	-	56,812,248.81	60,876,437.69
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,820,291.34	-	-	-	2,820,291.34
结算备付金	1,327,105.08	-	-	-	1,327,105.08
存出保证金	64,822.86	-	-	-	64,822.86
交易性金融资产	-	-	-	63,404,005.57	63,404,005.57
应收证券清算款	-	-	-	1,398,091.07	1,398,091.07
应收利息	-	-	-	866.02	866.02
应收申购款	99.40	-	-	54,880.33	54,979.73
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,212,318.68	-	-	64,857,842.99	69,070,161.67
负债					
应付证券清算款	-	-	-	919,438.07	919,438.07
应付赎回款	-	-	-	573,597.77	573,597.77

应付管理人报酬	-	-	-	93,910.48	93,910.48
应付托管费	-	-	-	15,651.72	15,651.72
应付交易费用	-	-	-	159,787.04	159,787.04
其他负债	-	-	-	362,159.42	362,159.42
负债总计	-	-	-	2,124,544.50	2,124,544.50
利率敏感度缺口	4,212,318.68	-	-	62,733,298.49	66,945,617.17

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来

测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	57,416,692.10	94.32	63,404,005.57	94.71
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	57,416,692.10	94.32	63,404,005.57	94.71

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	增加约 405 万元	增加约 346 万元
2. 沪深 300 指数下降 5%	下降约 405 万元	下降约 346 万元	

7.4.14 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 2016 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 52,449,802.96 元, 属于第二层次的余额为 4,966,889.14 元, 无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日: 第一层次 61,055,013.57 元, 第二层次 2,348,992.00 元, 无属于第三层次的余额)。

(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和债券, 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和债券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, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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 2016 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	57,416,692.10	93.31
	其中：股票	57,416,692.10	93.31
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	4,022,527.49	6.54
7	其他各项资产	96,860.14	0.16
8	合计	61,536,079.73	100.00

注：本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	536,318.00	0.88
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,674,971.32	43.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,547,599.09	5.83
G	交通运输、仓储和邮政业	1,167,190.92	1.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,844,623.61	30.96
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,989,017.48	4.91
L	租赁和商务服务业	2,044,900.00	3.36

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,602.72	0.02
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	1,601,468.96	2.63
S	综合	-	-
	合计	57,416,692.10	94.32

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	300458	全志科技	46,541	4,255,243.63	6.99
2	300379	东方通	60,249	4,180,678.11	6.87
3	300236	上海新阳	99,274	3,822,049.00	6.28
4	300377	赢时胜	86,212	3,218,293.96	5.29
5	002077	大港股份	167,171	2,989,017.48	4.91
6	300409	道氏技术	73,664	2,534,041.60	4.16
7	300302	同有科技	107,947	2,402,900.22	3.95
8	300465	高伟达	120,600	2,185,272.00	3.59
9	002712	思美传媒	71,500	2,044,900.00	3.36
10	002766	索菱股份	54,500	2,043,205.00	3.36
11	300364	中文在线	40,523	1,601,468.96	2.63
12	300014	亿纬锂能	54,184	1,582,172.80	2.60
13	300036	超图软件	85,199	1,482,462.60	2.44
14	002396	星网锐捷	71,832	1,415,090.40	2.32
15	002462	嘉事堂	32,701	1,390,773.53	2.28
16	300098	高新兴	96,500	1,353,895.00	2.22
17	300346	南大光电	42,100	1,281,524.00	2.11
18	300390	天华超净	100,693	1,260,676.36	2.07
19	603026	石大胜华	30,100	1,196,174.00	1.96
20	600330	天通股份	112,740	1,178,133.00	1.94
21	002245	澳洋顺昌	130,851	1,167,190.92	1.92

22	300166	东方国信	48,500	1,008,315.00	1.66
23	000070	特发信息	36,898	933,150.42	1.53
24	601599	鹿港文化	99,400	910,504.00	1.50
25	002354	天神娱乐	12,672	876,395.52	1.44
26	002560	通达股份	79,283	849,120.93	1.39
27	300431	暴风集团	18,379	845,434.00	1.39
28	600821	津劝业	70,100	825,077.00	1.36
29	000851	高鸿股份	65,416	762,750.56	1.25
30	300047	天源迪科	35,400	704,460.00	1.16
31	002425	凯撒文化	30,000	682,500.00	1.12
32	300567	精测电子	6,700	651,240.00	1.07
33	002009	天奇股份	40,400	584,588.00	0.96
34	300031	宝通科技	27,500	579,700.00	0.95
35	002534	杭锅股份	51,701	576,983.16	0.95
36	300081	恒信移动	36,900	568,998.00	0.93
37	300224	正海磁材	30,600	566,712.00	0.93
38	002200	云投生态	22,900	536,318.00	0.88
39	300569	天能重工	1,314	131,452.56	0.22
40	300583	赛托生物	1,303	52,497.87	0.09
41	002832	比音勒芬	832	50,502.40	0.08
42	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.06
43	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.04
44	002833	弘亚数控	833	14,677.46	0.02
45	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.02
46	000888	峨眉山A	888	10,602.72	0.02
47	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.02
48	300587	天铁股份	589	8,310.79	0.01
49	300586	美联新材	866	8,053.80	0.01
50	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.01
51	300591	万里马	1,527	4,687.89	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300036	超图软件	13,826,520.14	20.65

2	300379	东方通	12,819,711.76	19.15
3	300458	全志科技	12,373,158.52	18.48
4	300377	赢时胜	11,847,055.81	17.70
5	300465	高伟达	11,032,659.25	16.48
6	300224	正海磁材	10,731,164.21	16.03
7	002077	大港股份	9,420,838.53	14.07
8	002467	二六三	8,193,605.52	12.24
9	300302	同有科技	6,550,783.98	9.79
10	300322	硕贝德	6,290,198.00	9.40
11	300236	上海新阳	6,282,067.00	9.38
12	002502	骅威文化	6,160,034.20	9.20
13	002462	嘉事堂	6,076,421.51	9.08
14	002396	星网锐捷	5,951,178.59	8.89
15	002665	首航节能	5,443,528.36	8.13
16	002657	中科金财	5,354,589.18	8.00
17	000925	众合科技	5,043,543.85	7.53
18	600446	金证股份	4,996,026.06	7.46
19	000630	铜陵有色	4,949,539.82	7.39
20	601788	光大证券	4,943,137.16	7.38
21	002045	国光电器	4,872,606.00	7.28
22	600360	华微电子	4,852,120.82	7.25
23	300014	亿纬锂能	4,779,589.90	7.14
24	300271	华宇软件	4,224,547.68	6.31
25	300409	道氏技术	4,176,245.00	6.24
26	300431	暴风集团	3,926,259.00	5.86
27	600123	兰花科创	3,777,328.00	5.64
28	300066	三川智慧	3,693,371.70	5.52
29	300287	飞利信	3,646,435.62	5.45
30	603308	应流股份	3,421,208.51	5.11
31	002589	瑞康医药	3,398,423.75	5.08
32	300347	泰格医药	3,289,372.31	4.91
33	002766	索菱股份	3,181,761.62	4.75
34	002245	澳洋顺昌	3,068,003.00	4.58
35	002189	利达光电	2,989,419.00	4.47
36	300047	天源迪科	2,909,657.80	4.35
37	300346	南大光电	2,820,063.90	4.21

38	000411	英特集团	2,731,171.67	4.08
39	300364	中文在线	2,721,133.54	4.06
40	002312	三泰控股	2,700,211.00	4.03
41	002655	共达电声	2,676,690.00	4.00
42	002371	七星电子	2,600,222.00	3.88
43	600386	北巴传媒	2,568,838.40	3.84
44	300244	迪安诊断	2,564,520.96	3.83
45	300352	北信源	2,535,971.51	3.79
46	000070	特发信息	2,529,784.60	3.78
47	300113	顺网科技	2,501,986.99	3.74
48	002127	南极电商	2,426,688.00	3.62
49	300299	富春通信	2,404,885.00	3.59
50	002712	思美传媒	2,390,897.09	3.57
51	002185	华天科技	2,348,718.06	3.51
52	600655	豫园商城	2,340,780.00	3.50
53	601555	东吴证券	2,296,668.40	3.43
54	300041	回天新材	2,205,858.00	3.29
55	600570	恒生电子	2,120,814.00	3.17
56	300390	天华超净	2,103,946.00	3.14
57	300121	阳谷华泰	2,097,136.00	3.13
58	600756	浪潮软件	2,039,312.00	3.05
59	600330	天通股份	1,984,666.08	2.96
60	600343	航天动力	1,967,937.56	2.94
61	000078	海王生物	1,967,362.00	2.94
62	300217	东方电热	1,905,926.80	2.85
63	600501	航天晨光	1,840,398.30	2.75
64	300410	正业科技	1,819,030.00	2.72
65	300136	信维通信	1,785,094.00	2.67
66	002523	天桥起重	1,778,497.00	2.66
67	300449	汉邦高科	1,736,651.00	2.59
68	002576	通达动力	1,670,368.61	2.50
69	002699	美盛文化	1,651,777.00	2.47
70	600158	中体产业	1,649,759.00	2.46
71	600410	华胜天成	1,639,939.40	2.45
72	002663	普邦股份	1,637,333.50	2.45
73	600392	盛和资源	1,632,285.00	2.44

74	300088	长信科技	1,624,025.00	2.43
75	300228	富瑞特装	1,620,221.80	2.42
76	300376	易事特	1,586,897.32	2.37
77	002343	慈文传媒	1,583,033.00	2.36
78	002560	通达股份	1,560,701.00	2.33
79	600459	贵研铂业	1,538,605.64	2.30
80	600055	万东医疗	1,523,593.46	2.28
81	000970	中科三环	1,510,520.00	2.26
82	600395	盘江股份	1,490,960.00	2.23
83	000060	中金岭南	1,490,924.00	2.23
84	300085	银之杰	1,486,270.52	2.22
85	000906	物产中拓	1,481,352.00	2.21
86	002535	林州重机	1,458,058.00	2.18
87	600970	中材国际	1,447,792.00	2.16
88	000851	高鸿股份	1,436,856.00	2.15
89	603026	石大胜华	1,432,474.00	2.14
90	002586	围海股份	1,424,897.00	2.13
91	300098	高新兴	1,418,434.21	2.12
92	600469	风神股份	1,398,301.00	2.09
93	600199	金种子酒	1,396,548.00	2.09
94	300081	恒信移动	1,393,002.00	2.08
95	300241	瑞丰光电	1,386,535.40	2.07
96	002534	杭锅股份	1,376,826.50	2.06
97	002354	天神娱乐	1,374,276.00	2.05

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。

8.4.2 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	300036	超图软件	15,481,074.30	23.12
2	300377	赢时胜	10,876,111.38	16.25
3	300224	正海磁材	10,628,955.63	15.88
4	300465	高伟达	9,663,132.15	14.43
5	002665	首航节能	9,418,528.91	14.07
6	002467	二六三	9,193,216.59	13.73

7	300379	东方通	9,176,085.03	13.71
8	300458	全志科技	7,837,916.45	11.71
9	002462	嘉事堂	7,237,273.81	10.81
10	002657	中科金财	7,132,861.94	10.65
11	002077	大港股份	6,881,505.72	10.28
12	300322	硕贝德	6,671,549.15	9.97
13	300347	泰格医药	6,085,362.73	9.09
14	002502	骅威文化	5,867,193.37	8.76
15	002589	瑞康医药	5,699,897.65	8.51
16	000925	众合科技	5,687,980.27	8.50
17	002045	国光电器	5,386,312.66	8.05
18	300244	迪安诊断	5,272,547.50	7.88
19	601788	光大证券	4,949,705.01	7.39
20	600360	华微电子	4,943,795.63	7.38
21	000630	铜陵有色	4,934,760.19	7.37
22	600446	金证股份	4,865,378.83	7.27
23	300066	三川智慧	4,508,799.88	6.74
24	002396	星网锐捷	4,499,053.48	6.72
25	300041	回天新材	4,476,024.22	6.69
26	300287	飞利信	4,220,025.50	6.30
27	300271	华宇软件	4,213,941.72	6.29
28	300302	同有科技	3,963,105.97	5.92
29	600123	兰花科创	3,680,614.25	5.50
30	603308	应流股份	3,636,967.80	5.43
31	600358	国旅联合	3,172,039.68	4.74
32	002576	通达动力	3,044,676.50	4.55
33	002189	利达光电	2,884,762.28	4.31
34	300352	北信源	2,862,601.77	4.28
35	002312	三泰控股	2,814,482.78	4.20
36	000411	英特集团	2,808,115.47	4.19
37	002127	南极电商	2,790,239.86	4.17
38	300168	万达信息	2,736,202.12	4.09
39	300014	亿纬锂能	2,720,859.19	4.06
40	002371	七星电子	2,656,809.72	3.97
41	300431	暴风集团	2,579,152.44	3.85
42	600655	豫园商城	2,515,532.00	3.76
43	300113	顺网科技	2,416,292.11	3.61
44	300236	上海新阳	2,376,909.90	3.55

45	600386	北巴传媒	2,367,055.84	3.54
46	300047	天源迪科	2,357,556.79	3.52
47	002343	慈文传媒	2,333,315.05	3.49
48	002185	华天科技	2,312,611.40	3.45
49	002655	共达电声	2,296,781.89	3.43
50	300299	富春通信	2,275,552.00	3.40
51	002214	大立科技	2,232,519.11	3.33
52	300075	数字政通	2,190,690.13	3.27
53	601555	东吴证券	2,147,487.32	3.21
54	000078	海王生物	2,132,904.56	3.19
55	600756	浪潮软件	2,068,512.66	3.09
56	300390	天华超净	2,062,099.88	3.08
57	300121	阳谷华泰	2,049,321.54	3.06
58	600570	恒生电子	2,045,125.00	3.05
59	600343	航天动力	1,955,099.84	2.92
60	002439	启明星辰	1,937,093.62	2.89
61	002245	澳洋顺昌	1,914,180.98	2.86
62	300217	东方电热	1,877,439.48	2.80
63	600460	士兰微	1,856,083.37	2.77
64	600501	航天晨光	1,810,660.43	2.70
65	600459	贵研铂业	1,762,138.78	2.63
66	002523	天桥起重	1,758,605.10	2.63
67	300136	信维通信	1,744,407.72	2.61
68	300376	易事特	1,680,297.06	2.51
69	002663	普邦股份	1,669,846.50	2.49
70	300228	富瑞特装	1,626,079.20	2.43
71	600410	华胜天成	1,611,324.40	2.41
72	600392	盛和资源	1,589,476.00	2.37
73	300410	正业科技	1,588,650.17	2.37
74	000970	中科三环	1,584,617.00	2.37
75	600158	中体产业	1,569,866.00	2.34
76	300449	汉邦高科	1,569,471.95	2.34
77	300264	佳创视讯	1,559,416.78	2.33
78	300088	长信科技	1,555,675.06	2.32
79	002268	卫士通	1,548,610.66	2.31
80	300020	银江股份	1,545,704.77	2.31
81	300346	南大光电	1,540,943.74	2.30
82	300085	银之杰	1,507,129.38	2.25

83	002766	索菱股份	1,489,045.13	2.22
84	002699	美盛文化	1,487,765.95	2.22
85	300248	新开普	1,484,728.00	2.22
86	600395	盘江股份	1,459,715.00	2.18
87	000070	特发信息	1,454,373.50	2.17
88	600970	中材国际	1,453,581.76	2.17
89	600055	万东医疗	1,453,477.20	2.17
90	002535	林州重机	1,451,658.00	2.17
91	000060	中金岭南	1,444,953.00	2.16
92	000906	物产中拓	1,407,852.51	2.10
93	002586	围海股份	1,386,518.24	2.07
94	600469	风神股份	1,383,634.56	2.07
95	300241	瑞丰光电	1,365,567.41	2.04
96	600199	金种子酒	1,362,060.00	2.03
97	002280	联络互动	1,360,553.60	2.03

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。

8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	374,583,168.98
卖出股票收入（成交）总额	368,713,318.94

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	41,661.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	774.64
5	应收申购款	54,424.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	96,860.14

8.12.4 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。

8.12.5 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中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
4,386	11,034.79	3,400,680.27	7.03%	44,997,905.57	92.97%

9.2 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	14,886.35	0.030758%

9.3 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的情况

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

§ 10 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	40,609,647.34
本报告期基金总申购份额	138,716,936.36
减:本报告期基金总赎回份额	130,927,997.86
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	48,398,585.84

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

1、经国海富兰克林基金管理有限公司 2015 年股东会第八次会议审议通过，自 2016 年 1 月 4 日起，吴显玲女士不再担任公司董事长，由 Gregory E. McGowan 先生担任公司董事长。相关公告已于 2016 年 1 月 9 日在《中国证券报》和公司网站披露。

2、经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第二十二次会议审议通过，自 2016 年 1 月 7 日起，吴显玲女士担任公司总经理，全面主持经营管理工作。相关公告已于 2016 年 1 月 9 日在《中国证券报》和公司网站披露。

3、经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第二十六次会议审议通过，自 2016 年 12 月 7 日起，王雷先生担任公司副总经理。相关公告已于 2016 年 12 月 9 日在《中国证券报》和公司网站披露。

期后事项说明：

1、原富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金基金经理何景风先生因个人原因提出辞职，经公司决定其自 2017 年 2 月 14 日起不再担任该基金的基金经理，由现任基金经理徐荔蓉先生单独管理。公司已办理完成上述基金经理的注销手续。详情请参阅 2017 年 2 月 14 日相关公告。

(二) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016 年 12 月，郭德秋先生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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人应支付给会计师事务所的审计费用是人民币 55,000.00 元，本基金自成立以来对其进行审计的均为普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

(一) 基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

(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，基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
光大证券	2	147,304,064.42	19.84%	135,217.06	19.90%	-
华创证券	1	134,228,872.36	18.08%	122,322.70	18.00%	-
广发证券	1	133,034,132.52	17.91%	121,234.18	17.84%	-
招商证券	1	64,117,563.11	8.63%	58,430.47	8.60%	-
长江证券	2	49,788,439.21	6.70%	45,731.60	6.73%	-
东方证券	2	44,374,910.77	5.98%	40,438.94	5.95%	-
申万宏源	2	42,449,356.68	5.72%	38,987.33	5.74%	-
中银国际	1	36,479,405.07	4.91%	33,243.84	4.89%	-
海通证券	2	32,120,363.21	4.33%	29,338.43	4.32%	-

国信证券	1	22,916,700.66	3.09%	21,342.64	3.14%	-
中泰证券	1	22,479,240.37	3.03%	20,934.80	3.08%	-
国海证券	2	5,818,002.90	0.78%	5,301.88	0.78%	-
兴业证券	1	3,546,442.78	0.48%	3,231.89	0.48%	-
银河证券	1	3,129,360.52	0.42%	2,914.34	0.43%	-
中信证券	1	812,330.00	0.11%	756.49	0.11%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

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：

- ① 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- ② 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；
- ③ 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；
- ④ 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；
- ⑤ 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) 公司基金交易佣金分配依据券商提供的研究报告和服务质量，评判标准包括但不限于：

- ① 全面及时向公司提供高质量的关于宏观、行业和市场的研究报告；
- ② 具有数量研究和开发能力；
- ③ 能有效组织上市公司调研；

④能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；

⑤上门路演和电话会议的质量；

⑥与我公司投资和研究人员的信息交流和沟通能力；

⑦其他与投资相关的服务和支持。

3) 租用基金专用交易单元的程序

①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。

②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。

③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变更情况

报告期内，本基金新增光大证券深圳交易单元 1 个，东吴证券深圳交易单元 1 个，东吴证券上海交易单元 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金更新招募说明书（2015年第2号）	中国证监会指定报刊及公司网站	2016年1月5日
2	富兰克林国海研究精选混合型证券投资基	中国证监会指定报	2016年1月5日

	金更新招募说明书摘要（2015 年第 2 号）	刊及公司网站	
3	国海富兰克林基金管理有限公司关于因交易所发生指数熔断至收市调整旗下部分基金交易申请时间的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 1 月 5 日
4	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 1 月 6 日
5	国海富兰克林基金管理有限公司关于因交易所发生指数熔断至收市调整旗下部分基金交易申请时间的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 1 月 8 日
6	国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告（1）	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 1 月 9 日
7	国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告（2）	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 1 月 9 日
8	富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 1 月 20 日
9	国海富兰克林基金管理有限公司通过申万宏源证券、财富证券开通旗下部分基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 3 月 25 日
10	富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金 2015 年年度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 3 月 28 日
11	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 3 月 31 日
12	富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 4 月 22 日
13	国海富兰克林基金管理有限公司关于不再通过“国海富兰克林基金淘宝官方旗舰店	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 5 月 5 日

	店”提供新开户、基金认购和申购等相关服务的公告		
14	关于增加上海陆金所资产管理有限公司为国海富兰克林基金旗下基金代销机构的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016年5月5日
15	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中国民生银行直销银行“基金通”平台申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016年5月25日
16	关于增加景谷资产为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016年5月27日
17	关于增加大泰金石为国海富兰克林基金旗下基金代销机构并开通转换业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016年6月21日
18	关于增加基煜为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016年6月24日
19	关于增加晟视天下为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016年6月29日
20	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016年6月30日
21	富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金更新招募说明书（2016年第1号）	中国证监会指定报刊及公司网站	2016年7月5日
22	富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2016年第1号）	中国证监会指定报刊及公司网站	2016年7月5日
23	富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016年7月20日
24	国海富兰克林基金关于参加上海陆金所资	中国证监会指定报	2016年7月21日

	产管理有限公司费率优惠活动的公告	刊及公司网站	
25	国海富兰克林基金管理有限公司关于开通旗下部分基金直销柜台申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 8 月 12 日
26	国海富兰克林基金管理有限公司关于调整开户证件类型类型的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 8 月 16 日
27	关于上海陆金所资产管理有限公司开通国海富兰克林基金旗下部分基金转换业务、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 8 月 26 日
28	富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金 2016 年半年报	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 8 月 26 日
29	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 9 月 20 日
30	富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 10 月 24 日
31	关于增加新兰德为国海富兰克林基金旗下基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 11 月 11 日
32	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加和讯信息科技有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 11 月 11 日
33	国海富兰克林基金管理有限公司关于参加新兰德费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 11 月 18 日
34	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 11 月 29 日

35	国海富兰克林基金管理有限公司关于更新银联电子支付支持的银行卡目录并实施申购费率优惠的说明公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 11 月 30 日
36	国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 12 月 9 日
37	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 12 月 22 日
38	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加苏州银行基金申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 12 月 28 日
39	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中国工商银行 2017 倾心回馈基金定投优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 12 月 30 日
40	国海富兰克林基金旗下部分基金参加农业银行开放式证券投资基金申购、定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 12 月 30 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海研究精选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。

12.2 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。

12.3 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

2017年3月28日