

富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金  
2018 年年度报告摘要

2018 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：2019 年 3 月 29 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 2019 年 3 月 27 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金简称       | 国富健康优质生活股票      |
| 基金主代码      | 000761          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2014 年 9 月 23 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 | 9,175,287.22 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 | <p>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。</p> <p>1、行业配置策略</p> <p>（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%。</p> <p>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。本基金将通过研究居民需求变化和行业发展趋势，适时调整健康优质生活主题所覆盖的行业范围。</p> <p>（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。</p> <p>2、个股精选策略</p> <p>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。</p> <p>3、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>4、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> <p>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。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | 85% × 沪深 300 指数收益率 + 15% × 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风险品种，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                                   | 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        |

### 2.4 信息披露方式

|                    |                 |
|--------------------|-----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称     | 证券时报            |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网 | www.ftsfund.com |

|            |                |
|------------|----------------|
| 址          |                |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

## § 3 主要财务指标、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 | 2018 年        | 2017 年        | 2016 年        |
|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期已实现收益       | -5,166,335.35 | 2,307,832.25  | -1,143,539.49 |
| 本期利润          | -6,711,815.68 | 3,362,241.91  | -4,052,364.61 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.2451       | 0.1999        | -0.1951       |
| 本期基金份额净值增长率   | -23.70%       | 14.87%        | -14.21%       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018 年末       | 2017 年末       | 2016 年末       |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0634       | 0.2280        | 0.0686        |
| 期末基金资产净值      | 8,593,711.95  | 13,909,371.45 | 18,252,794.79 |
| 期末基金份额净值      | 0.937         | 1.228         | 1.069         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2018 年末       | 2017 年末       | 2016 年末       |
| 基金份额累计净值增长率   | -6.30%        | 22.80%        | 6.90%         |

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

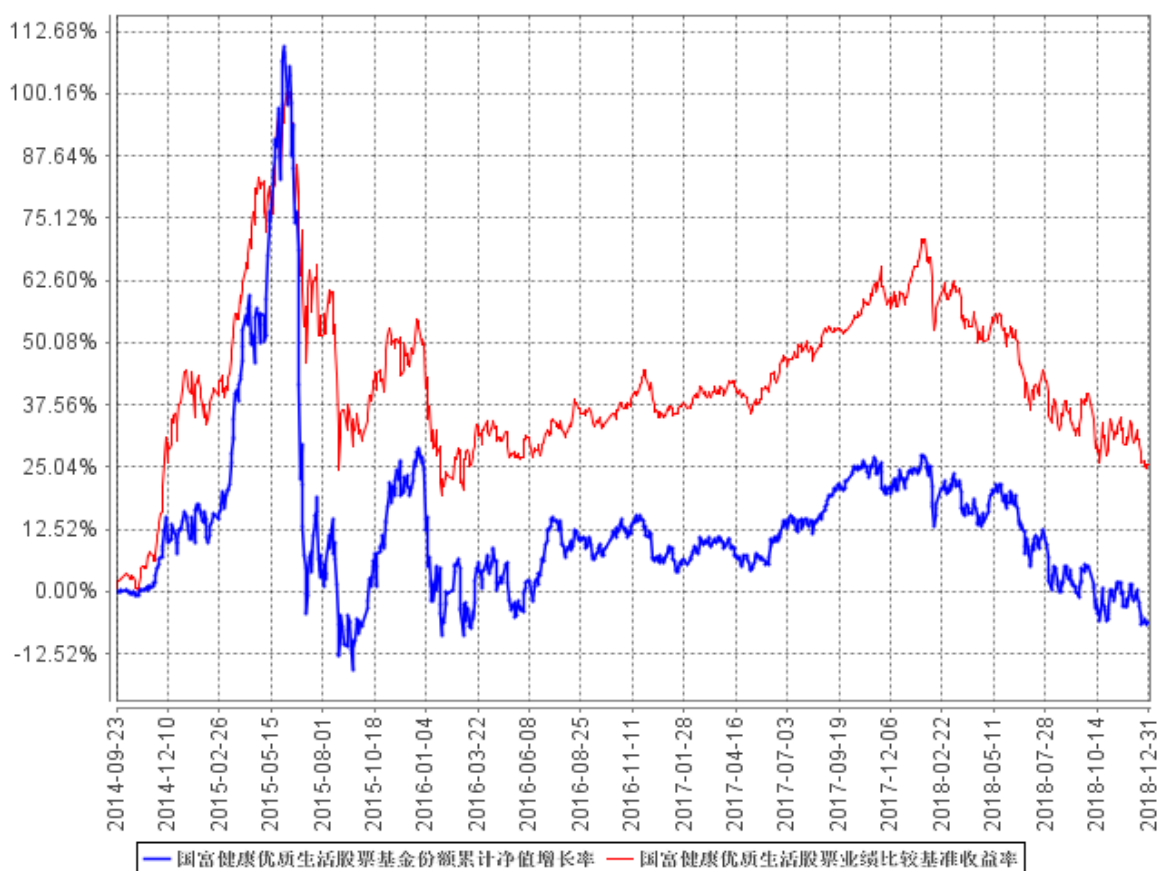
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -10.85%  | 1.55%       | -10.19%    | 1.39%         | -0.66% | 0.16% |
| 过去六个月 | -15.28%  | 1.45%       | -11.78%    | 1.27%         | -3.50% | 0.18% |
| 过去一年  | -23.70%  | 1.30%       | -21.13%    | 1.14%         | -2.57% | 0.16% |

|            |         |       |         |       |         |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去三年       | -24.80% | 1.40% | -16.25% | 1.00% | -8.55%  | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | -6.30%  | 1.89% | 25.45%  | 1.37% | -31.75% | 0.52% |

### 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

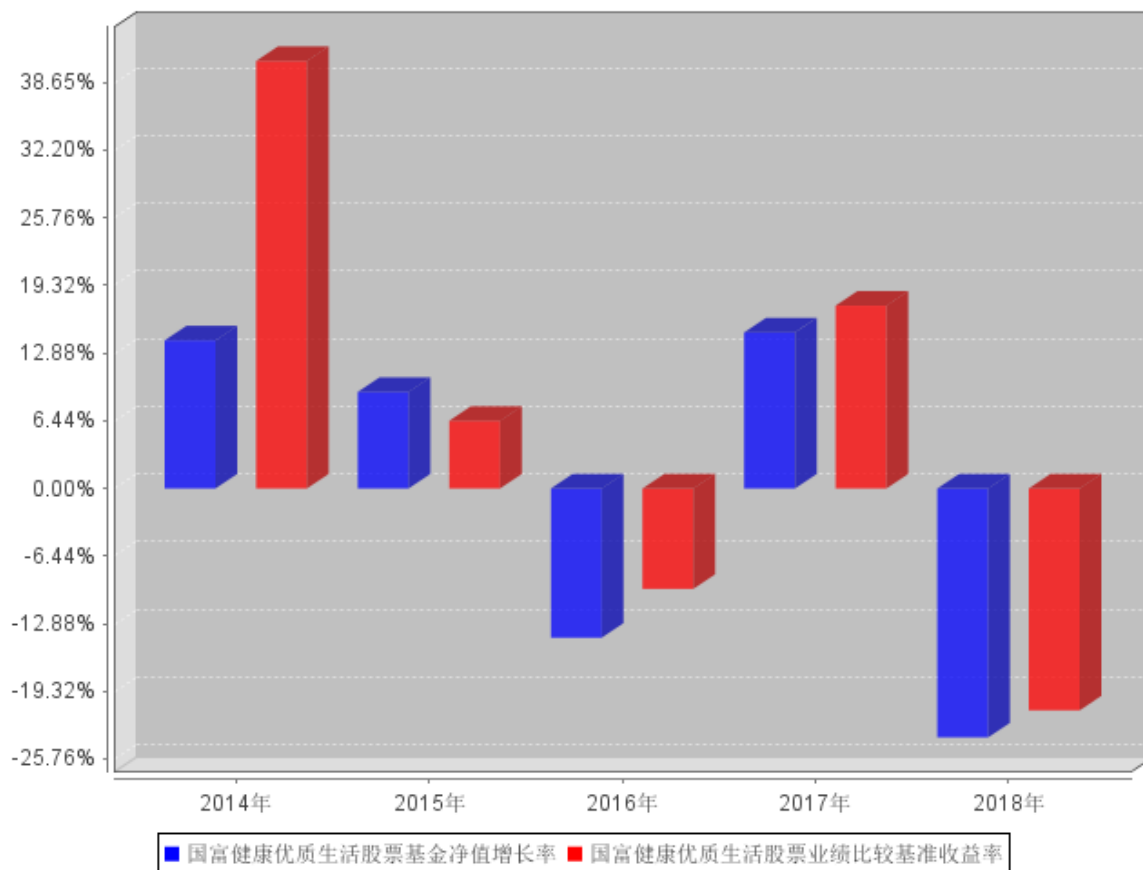
#### 国富健康优质生活股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2014 年 9 月 23 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

国富健康优质生活股票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 2014 年 9 月 23 日，故 2014 年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<br>分红数 | 现金形式发<br>放总额 | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分配合<br>计 | 备注 |
|------|-----------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 2016 | -               | -            | -             | -            |    |
| 2017 | -               | -            | -             | -            |    |
| 2018 | -               | -            | -             | -            |    |
| 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，在全球市场上有超过 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。

本公司具有丰富的基金管理经验。自 2005 年 6 月第一只基金成立开始，截至本报告期末，公司旗下共运作 32 只公募基金产品。

#### 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 |        |   |
| 王晓宁 | 公司研究分析部副总经理、国富策略回报混合基金及国富健康优质生活股票基金的基金经理 | 2014 年 9 月 23 日 | -    | 15 年   | 王晓宁先生，中央财经大学学士。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、国富潜力组合混合基金、国富成长动力混合基金及国富策略回报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研究分析部副总经理、国富策略回报混合基金及国富健康优质生活股票基金的基金经理。 |

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，公司共管理了三十二只公募基金及六只专户产品。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

报告期内，宏观背景出现了多个转折性变化：（1）贸易摩擦加剧，中美谈判过程一波三折，促使市场对我国经济的长期潜在增速预期进行了修正，并由此推演到了各个行业的变化。很多企业的长期增长空间受到压制，并被市场重新定价。（2）国内供给侧改革延伸至金融部门，资管新规的规则制定成为焦点，去杠杆的进程经历了从加速到放缓的过程，地方城投和民营企业融资能力波折较多。（3）进入四季度后，“稳增长”成为宏观政策的主基调，修复宏观资产负债表让位于稳住宏观利润表，“信贷放松+基建加码”的政策组合重新回归。受制于宏观环境的重大变化，2018 年度股票市场也经历了困难的一年，众多公司经历了“投资逻辑重构+估值重构”的过程。结构上，各个行业都没有表现出持续的贝塔机会，行业内股票分化继续扩大，优质公司的阿尔法回报显著。

随着经济增速放缓和各行业竞争格局初定，领先公司的复利效应越发明显，其市场份额和竞争壁垒同步提高。这批投资赔率不高但概率极高的标的，反而在波折的市场中显示出确定性的优势。本基金的基本思路是寻找确定性的成长机会，报告期内增加了“深度价值”和“稳定成长”

类公司的持仓，行业选择上偏向于金融、消费和科技行业，自下而上的选股占持仓的绝大部分比例。整体来看，高质量的价值股和稳定成长股为基金贡献了较多的超额收益，而持仓中负债率和现金流表有争议的个股是造成投资损失的主要来源。

#### 4.4.2 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 0.937 元，本报告期净值增长率为-23.70%，同期业绩比较基准增长率为-21.13%，本基金跑输业绩比较基准 2.57%。

#### 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 2019 年，我们并不悲观。考虑影响市场的 3 大变量——利率、政策、公司盈利，其中流动性和政府政策朝着有利于股市的方向发展，而经济增速回落拖累上市公司业绩。指数大概率从 2018 年的下跌趋势转为今年的“磨底”，维持低位震荡的可能性较高，赚钱效应改善。深度价值类股票受益于利率趋势，其股价中枢依旧是向上。周期成长股经历了 2018 年的“杀逻辑+杀估值”的股价回调后，2019 年“杀业绩”的影响会相对温和，优质公司的阿尔法如可抵抗行业贝塔，其股价将进入长期建仓区域，选股难度降低。而稳健/高成长类的公司会继续经受考验，极少数受益于科技周期和经济周期共振的行业会成为寻找慢牛股的重要线索，比如新能源行业。

整体来看，2019 年股市的风险收益比是在提升的。选股中重视优质公司所产生的复利，择时中以绝对收益为导向，会是长期超额回报的来源。

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，争取未来更好的长期投资收益。

#### 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，根据基金合同和相关法律的规定，本基金无应分配但尚未分配的利润。

#### **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**

报告期内，本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

## §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”）在富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金（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《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

会计师出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b>      |                         |                          |
| 银行存款            | 1,263,772.41            | 2,144,192.61             |
| 结算备付金           | 19,695.11               | 93,743.72                |
| 存出保证金           | 13,244.62               | 15,877.61                |
| 交易性金融资产         | 7,162,647.00            | 12,052,803.06            |
| 其中：股票投资         | 7,162,647.00            | 12,052,803.06            |
| 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         | 279,332.55              | -                        |
| 应收利息            | 321.24                  | 508.95                   |
| 应收股利            | -                       | -                        |
| 应收申购款           | 10,134.81               | 5,880.82                 |
| 递延所得税资产         | -                       | -                        |
| 其他资产            | -                       | -                        |
| 资产总计            | 8,749,147.74            | 14,313,006.77            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>              | <b>上年度末</b>              |
|                 | <b>2018 年 12 月 31 日</b> | <b>2017 年 12 月 31 日</b>  |
| <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         | -                       | 104,905.45               |
| 应付赎回款           | -                       | 3,685.42                 |
| 应付管理人报酬         | 11,619.00               | 19,199.38                |
| 应付托管费           | 1,936.47                | 3,199.90                 |
| 应付销售服务费         | -                       | -                        |
| 应付交易费用          | 9,880.32                | 62,643.89                |
| 应交税费            | -                       | -                        |



|               |              |               |
|---------------|--------------|---------------|
| 应付利息          | -            | -             |
| 应付利润          | -            | -             |
| 递延所得税负债       | -            | -             |
| 其他负债          | 132,000.00   | 210,001.28    |
| 负债合计          | 155,435.79   | 403,635.32    |
| <b>所有者权益：</b> |              |               |
| 实收基金          | 9,175,287.22 | 11,326,639.73 |
| 未分配利润         | -581,575.27  | 2,582,731.72  |
| 所有者权益合计       | 8,593,711.95 | 13,909,371.45 |
| 负债和所有者权益总计    | 8,749,147.74 | 14,313,006.77 |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.937 元，基金份额总额 9,175,287.22 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---|--|
| <b>一、收入</b>            | -5,610,307.86                             | 4,166,519.70                                   |
| 1. 利息收入                | 44,256.25                                 | 23,715.12                                      |
| 其中：存款利息收入              | 41,846.36                                 | 23,715.12                                      |
| 债券利息收入                 | 2,409.89                                  | -  |
| 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）      | -4,196,840.60                             | 2,854,919.35                                   |
| 其中：股票投资收益              | -4,632,733.11                             | 2,675,546.37                                   |
| 基金投资收益                 | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 6,622.24                                  | -  |
| 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                   | 429,270.27                                | 179,372.98                                     |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -1,545,480.33                             | 1,054,409.66                                   |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 87,756.82                                 | 233,475.57                                     |
| <b>减：二、费用</b>          | 1,101,507.82                              | 804,277.79                                     |

|                     |               |              |
|---------------------|---------------|--------------|
| 1. 管理人报酬            | 475,108.05    | 296,642.40   |
| 2. 托管费              | 79,184.59     | 49,440.40    |
| 3. 销售服务费            | -             | -            |
| 4. 交易费用             | 355,225.36    | 305,676.84   |
| 5. 利息支出             | -             | -            |
| 其中：卖出回购金融资产支出       | -             | -            |
| 6. 税金及附加            | 0.17          | -            |
| 7. 其他费用             | 191,989.65    | 152,518.15   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -6,711,815.68 | 3,362,241.91 |
| 减：所得税费用             | -             | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   | -6,711,815.68 | 3,362,241.91 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 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）                        | 11,326,639.73                          | 2,582,731.72  | 13,909,371.45  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                      | -6,711,815.68 | -6,711,815.68  |
| 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）      | -2,151,352.51                          | 3,547,508.69  | 1,396,156.18   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 38,218,009.68                          | 8,467,696.80  | 46,685,706.48  |
| 2. 基金赎回款                               | -40,369,362.19                         | -4,920,188.11 | -45,289,550.30 |
| 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）                        | 9,175,287.22                           | -581,575.27   | 8,593,711.95   |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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）                        | 17,081,681.26                               | 1,171,113.53  | 18,252,794.79  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 3,362,241.91  | 3,362,241.91   |
| 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）      | -5,755,041.53                               | -1,950,623.72 | -7,705,665.25  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 31,287,955.52                               | 6,251,286.64  | 37,539,242.16  |
| 2. 基金赎回款                               | -37,042,997.05                              | -8,201,910.36 | -45,244,907.41 |
| 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）                        | 11,326,639.73                               | 2,582,731.72  | 13,909,371.45  |

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：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| _____    | _____     | _____   |
| 林勇       | 林勇        | 龚黎      |
| 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

富兰克林国海健康优质生活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[2013]第 1648 号《关于核准富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金募集的批复》注册，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《富兰克林国海健康优质生活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 295,831,329.11 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字

(2014)第 560 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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》于 2014 年 9 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 295,887,926.59 份。本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 56,597.48 元。在本基金成立后，其中 56,597.48 元折算为 56,597.48 份基金金份额，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《富兰克林国海健康优质生活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，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板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：股票投资比例为基金资产的 80%-95%，其中投资于与提升居民健康和生活品质主题直接相关行业的股票比例不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具、现金、资产支持证券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投资比例为基金资产的 5%-20%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率  $\times$  85% + 中债国债总指数(全价)收益率  $\times$  15%。

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 2019 年 3 月 22 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》、《富兰克林国海健康优质生活股票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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2018 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并

在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 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一致。

### 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[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》、财税[2016]140 号《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[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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，股票的股息、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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月<br>31日 |                      | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |                      |
|-------|---------------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 国海证券  | -                               | -                    | 4,816,091.28                     | 2.42%                |

#### 7.4.8.1.2 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。

#### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日      |                |          |                  |
|-------|----------------------------------|----------------|----------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 国海证券  | -                                | -              | -        | -                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |                |          |                  |
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 国海证券  | 4,485.26                         | 2.42%          | 4,485.26 | 7.16%            |

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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年1月1日至2018年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月<br>31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
|                 | 当期发生的基金应支付的管理费                  | 475,108.05                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 71,775.99                       | 114,977.38                           |

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。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                    | 上年度可比期间               |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
|                | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年1月1日至2017年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 79,184.59             | 49,440.40             |

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。

#### 7.4.8.3 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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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（2017年1月1日至2017年12月31日）基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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（2017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。

#### 7.4.8.5 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                    |           | 上年度可比期间               |           |
|-------|-----------------------|-----------|-----------------------|-----------|
|       | 2018年1月1日至2018年12月31日 |           | 2017年1月1日至2017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  | 1,263,772.41          | 39,487.88 | 2,144,192.61          | 22,322.43 |

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。



#### 7.4.8.6 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。

#### 7.4.8.7 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。

### 7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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。

#### 7.4.10 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 2018 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 7,162,647.00 元，无属于第二或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 12,052,803.06 元，无第二或第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票、债券和资产支持证券，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、债券和资产支持证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、债券和资产支持证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 2018 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(2017 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)其他

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              | 7,162,647.00 | 81.87         |
|    | 其中：股票             | 7,162,647.00 | 81.87         |
| 2  | 基金投资              | -            | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -            | -             |
|    | 其中：债券             | -            | -             |
|    | 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      | 1,283,467.52 | 14.67         |
| 8  | 其他各项资产            | 303,033.22   | 3.46          |
| 9  | 合计                | 8,749,147.74 | 100.00        |

### 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         | 157,080.00   | 1.83          |
| B  | 采矿业              | -            | -             |
| C  | 制造业              | 3,592,260.00 | 41.80         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 322,000.00   | 3.75          |
| E  | 建筑业              | -            | -             |
| F  | 批发和零售业           | -            | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 100,500.00   | 1.17          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 249,200.00   | 2.90          |
| J  | 金融业              | 1,150,967.00 | 13.39         |
| K  | 房地产业             | 659,440.00   | 7.67          |
| L  | 租赁和商务服务业         | -            | -             |

|   |               |              |       |
|---|---------------|--------------|-------|
| 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       | 179,400.00   | 2.09  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 751,800.00   | 8.75  |
| S | 综合            | -            | -     |
|   | 合计            | 7,162,647.00 | 83.35 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未通过港股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  | 601398 | 工商银行 | 122,300 | 646,967.00 | 7.53         |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 20,000  | 504,000.00 | 5.86         |
| 3  | 002202 | 金风科技 | 50,000  | 499,500.00 | 5.81         |
| 4  | 000902 | 新洋丰  | 50,000  | 448,000.00 | 5.21         |
| 5  | 000002 | 万科A  | 17,000  | 404,940.00 | 4.71         |
| 6  | 300296 | 利亚德  | 50,000  | 384,500.00 | 4.47         |
| 7  | 000681 | 视觉中国 | 15,000  | 349,800.00 | 4.07         |
| 8  | 600886 | 国投电力 | 40,000  | 322,000.00 | 3.75         |
| 9  | 002304 | 洋河股份 | 3,000   | 284,160.00 | 3.31         |
| 10 | 300009 | 安科生物 | 20,000  | 267,200.00 | 3.11         |
| 11 | 002035 | 华帝股份 | 30,000  | 265,500.00 | 3.09         |
| 12 | 002415 | 海康威视 | 10,000  | 257,600.00 | 3.00         |
| 13 | 600340 | 华夏幸福 | 10,000  | 254,500.00 | 2.96         |
| 14 | 601098 | 中南传媒 | 20,000  | 250,000.00 | 2.91         |
| 15 | 300253 | 卫宁健康 | 20,000  | 249,200.00 | 2.90         |
| 16 | 600038 | 中直股份 | 5,000   | 186,800.00 | 2.17         |
| 17 | 002044 | 美年健康 | 12,000  | 179,400.00 | 2.09         |
| 18 | 600332 | 白云山  | 5,000   | 178,800.00 | 2.08         |
| 19 | 002341 | 新纶科技 | 15,000  | 178,200.00 | 2.07         |
| 20 | 002876 | 三利谱  | 5,000   | 159,800.00 | 1.86         |
| 21 | 300498 | 温氏股份 | 6,000   | 157,080.00 | 1.83         |
| 22 | 300251 | 光线传媒 | 20,000  | 152,000.00 | 1.77         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 23 | 600456 | 宝钛股份 | 10,000 | 150,900.00 | 1.76 |
| 24 | 002271 | 东方雨虹 | 10,000 | 129,500.00 | 1.51 |
| 25 | 002236 | 大华股份 | 10,000 | 114,600.00 | 1.33 |
| 26 | 600004 | 白云机场 | 10,000 | 100,500.00 | 1.17 |
| 27 | 601012 | 隆基股份 | 5,000  | 87,200.00  | 1.01 |

## 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  | 601336 | 新华保险 | 3,430,966.00 | 24.67           |
| 2  | 600196 | 复星医药 | 3,140,879.00 | 22.58           |
| 3  | 000001 | 平安银行 | 3,139,763.62 | 22.57           |
| 4  | 601939 | 建设银行 | 2,860,425.65 | 20.56           |
| 5  | 002202 | 金风科技 | 2,771,735.50 | 19.93           |
| 6  | 600028 | 中国石化 | 2,756,545.00 | 19.82           |
| 7  | 300199 | 翰宇药业 | 2,725,900.87 | 19.60           |
| 8  | 600887 | 伊利股份 | 2,540,313.00 | 18.26           |
| 9  | 601398 | 工商银行 | 2,530,000.00 | 18.19           |
| 10 | 000858 | 五粮液  | 2,492,801.00 | 17.92           |
| 11 | 603708 | 家家悦  | 2,475,212.40 | 17.80           |
| 12 | 601966 | 玲珑轮胎 | 2,345,897.00 | 16.87           |
| 13 | 002304 | 洋河股份 | 2,333,392.60 | 16.78           |
| 14 | 002292 | 奥飞娱乐 | 2,328,701.00 | 16.74           |
| 15 | 300232 | 洲明科技 | 2,289,998.00 | 16.46           |
| 16 | 600036 | 招商银行 | 2,181,952.80 | 15.69           |
| 17 | 300142 | 沃森生物 | 2,167,772.00 | 15.58           |
| 18 | 300296 | 利亚德  | 2,118,902.00 | 15.23           |
| 19 | 000426 | 兴业矿业 | 2,065,492.00 | 14.85           |
| 20 | 000902 | 新洋丰  | 2,004,372.00 | 14.41           |
| 21 | 600383 | 金地集团 | 1,993,807.00 | 14.33           |
| 22 | 600487 | 亨通光电 | 1,942,536.15 | 13.97           |
| 23 | 601166 | 兴业银行 | 1,895,958.00 | 13.63           |
| 24 | 002258 | 利尔化学 | 1,886,711.00 | 13.56           |

|    |        |       |              |       |
|----|--------|-------|--------------|-------|
| 25 | 002236 | 大华股份  | 1,840,267.00 | 13.23 |
| 26 | 600019 | 宝钢股份  | 1,820,000.00 | 13.08 |
| 27 | 601318 | 中国平安  | 1,792,607.47 | 12.89 |
| 28 | 600584 | 长电科技  | 1,690,895.00 | 12.16 |
| 29 | 600388 | 龙净环保  | 1,647,784.50 | 11.85 |
| 30 | 002563 | 森马服饰  | 1,578,804.00 | 11.35 |
| 31 | 603365 | 水星家纺  | 1,563,254.40 | 11.24 |
| 32 | 002648 | 卫星石化  | 1,533,091.00 | 11.02 |
| 33 | 002470 | 金正大   | 1,496,470.62 | 10.76 |
| 34 | 002530 | 金财互联  | 1,475,284.00 | 10.61 |
| 35 | 002573 | 清新环境  | 1,433,034.00 | 10.30 |
| 36 | 600637 | 东方明珠  | 1,397,052.24 | 10.04 |
| 37 | 600048 | 保利地产  | 1,387,088.00 | 9.97  |
| 38 | 002385 | 大北农   | 1,300,500.00 | 9.35  |
| 39 | 600376 | 首开股份  | 1,268,975.00 | 9.12  |
| 40 | 300285 | 国瓷材料  | 1,262,909.00 | 9.08  |
| 41 | 002419 | 天虹股份  | 1,256,283.08 | 9.03  |
| 42 | 300121 | 阳谷华泰  | 1,232,560.93 | 8.86  |
| 43 | 600570 | 恒生电子  | 1,208,944.00 | 8.69  |
| 44 | 300601 | 康泰生物  | 1,207,806.00 | 8.68  |
| 45 | 002496 | ST 辉丰 | 1,172,000.00 | 8.43  |
| 46 | 002273 | 水晶光电  | 1,166,323.00 | 8.39  |
| 47 | 000681 | 视觉中国  | 1,163,071.00 | 8.36  |
| 48 | 600466 | 蓝光发展  | 1,161,196.00 | 8.35  |
| 49 | 300253 | 卫宁健康  | 1,155,590.00 | 8.31  |
| 50 | 601636 | 旗滨集团  | 1,144,016.00 | 8.22  |
| 51 | 600702 | 舍得酒业  | 1,140,000.00 | 8.20  |
| 52 | 002798 | 帝欧家居  | 1,104,327.00 | 7.94  |
| 53 | 600426 | 华鲁恒升  | 1,073,802.00 | 7.72  |
| 54 | 000069 | 华侨城 A | 1,042,782.17 | 7.50  |
| 55 | 000568 | 泸州老窖  | 1,012,623.00 | 7.28  |
| 56 | 601233 | 桐昆股份  | 925,150.00   | 6.65  |
| 57 | 300009 | 安科生物  | 871,192.00   | 6.26  |
| 58 | 300059 | 东方财富  | 858,148.00   | 6.17  |
| 59 | 002341 | 新纶科技  | 847,383.00   | 6.09  |
| 60 | 600406 | 国电南瑞  | 823,649.00   | 5.92  |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 61 | 601009 | 南京银行 | 763,772.00 | 5.49 |
| 62 | 300144 | 宋城演艺 | 710,874.00 | 5.11 |
| 63 | 002044 | 美年健康 | 709,946.00 | 5.10 |
| 64 | 600741 | 华域汽车 | 680,249.56 | 4.89 |
| 65 | 600138 | 中青旅  | 673,079.00 | 4.84 |
| 66 | 600276 | 恒瑞医药 | 641,123.75 | 4.61 |
| 67 | 600141 | 兴发集团 | 601,516.00 | 4.32 |
| 68 | 601888 | 中国国旅 | 599,830.08 | 4.31 |
| 69 | 002867 | 周大生  | 567,727.08 | 4.08 |
| 70 | 600114 | 东睦股份 | 559,429.00 | 4.02 |
| 71 | 300094 | 国联水产 | 546,000.00 | 3.93 |
| 72 | 600409 | 三友化工 | 530,989.00 | 3.82 |
| 73 | 300122 | 智飞生物 | 521,073.00 | 3.75 |
| 74 | 002007 | 华兰生物 | 511,378.00 | 3.68 |
| 75 | 600886 | 国投电力 | 444,797.00 | 3.20 |
| 76 | 000002 | 万科A  | 417,074.00 | 3.00 |
| 77 | 300003 | 乐普医疗 | 332,356.00 | 2.39 |
| 78 | 600256 | 广汇能源 | 307,900.00 | 2.21 |

注：买入金额按买入成交金额（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  | 601939 | 建设银行 | 3,436,070.00 | 24.70          |
| 2  | 300232 | 洲明科技 | 3,185,440.04 | 22.90          |
| 3  | 601336 | 新华保险 | 3,124,963.00 | 22.47          |
| 4  | 300199 | 翰宇药业 | 2,967,258.08 | 21.33          |
| 5  | 600196 | 复星医药 | 2,935,265.00 | 21.10          |
| 6  | 000001 | 平安银行 | 2,903,893.00 | 20.88          |
| 7  | 002304 | 洋河股份 | 2,718,090.91 | 19.54          |
| 8  | 603708 | 家家悦  | 2,624,159.80 | 18.87          |
| 9  | 600036 | 招商银行 | 2,621,829.00 | 18.85          |
| 10 | 600028 | 中国石化 | 2,592,495.00 | 18.64          |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 2,566,299.40 | 18.45          |
| 12 | 000426 | 兴业矿业 | 2,536,305.45 | 18.23          |
| 13 | 000858 | 五粮液  | 2,288,291.00 | 16.45          |

|    |        |       |              |       |
|----|--------|-------|--------------|-------|
| 14 | 300142 | 沃森生物  | 2,266,640.00 | 16.30 |
| 15 | 600887 | 伊利股份  | 2,257,020.85 | 16.23 |
| 16 | 002202 | 金风科技  | 2,182,376.00 | 15.69 |
| 17 | 002258 | 利尔化学  | 2,177,251.86 | 15.65 |
| 18 | 002292 | 奥飞娱乐  | 2,166,574.00 | 15.58 |
| 19 | 600584 | 长电科技  | 2,160,903.00 | 15.54 |
| 20 | 601966 | 玲珑轮胎  | 2,109,515.55 | 15.17 |
| 21 | 600487 | 亨通光电  | 1,967,372.00 | 14.14 |
| 22 | 600019 | 宝钢股份  | 1,879,818.22 | 13.51 |
| 23 | 601166 | 兴业银行  | 1,824,000.00 | 13.11 |
| 24 | 002563 | 森马服饰  | 1,729,997.52 | 12.44 |
| 25 | 002530 | 金财互联  | 1,717,829.85 | 12.35 |
| 26 | 603365 | 水星家纺  | 1,700,643.00 | 12.23 |
| 27 | 300285 | 国瓷材料  | 1,617,407.00 | 11.63 |
| 28 | 601398 | 工商银行  | 1,611,732.00 | 11.59 |
| 29 | 600426 | 华鲁恒升  | 1,567,893.00 | 11.27 |
| 30 | 002648 | 卫星石化  | 1,562,103.00 | 11.23 |
| 31 | 002419 | 天虹股份  | 1,546,609.00 | 11.12 |
| 32 | 300601 | 康泰生物  | 1,539,480.00 | 11.07 |
| 33 | 002470 | 金正大   | 1,504,208.93 | 10.81 |
| 34 | 600388 | 龙净环保  | 1,477,632.00 | 10.62 |
| 35 | 600466 | 蓝光发展  | 1,451,595.00 | 10.44 |
| 36 | 601636 | 旗滨集团  | 1,417,488.00 | 10.19 |
| 37 | 600637 | 东方明珠  | 1,413,009.00 | 10.16 |
| 38 | 000902 | 新洋丰   | 1,392,257.00 | 10.01 |
| 39 | 300059 | 东方财富  | 1,351,802.00 | 9.72  |
| 40 | 600383 | 金地集团  | 1,340,801.00 | 9.64  |
| 41 | 300121 | 阳谷华泰  | 1,325,821.00 | 9.53  |
| 42 | 600376 | 首开股份  | 1,298,904.00 | 9.34  |
| 43 | 002385 | 大北农   | 1,234,363.09 | 8.87  |
| 44 | 600048 | 保利地产  | 1,219,847.00 | 8.77  |
| 45 | 600570 | 恒生电子  | 1,197,176.03 | 8.61  |
| 46 | 600406 | 国电南瑞  | 1,161,440.00 | 8.35  |
| 47 | 002236 | 大华股份  | 1,154,932.00 | 8.30  |
| 48 | 002798 | 帝欧家居  | 1,146,978.20 | 8.25  |
| 49 | 601233 | 桐昆股份  | 1,126,000.00 | 8.10  |
| 50 | 002496 | ST 辉丰 | 1,105,297.70 | 7.95  |
| 51 | 600114 | 东睦股份  | 1,091,758.52 | 7.85  |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 52 | 600741 | 华域汽车 | 1,063,740.00 | 7.65 |
| 53 | 002573 | 清新环境 | 1,043,931.00 | 7.51 |
| 54 | 300296 | 利亚德  | 1,014,403.00 | 7.29 |
| 55 | 002273 | 水晶光电 | 1,008,144.00 | 7.25 |
| 56 | 300253 | 卫宁健康 | 931,288.00   | 6.70 |
| 57 | 600702 | 舍得酒业 | 844,398.00   | 6.07 |
| 58 | 000069 | 华侨城A | 814,513.00   | 5.86 |
| 59 | 000568 | 泸州老窖 | 794,169.00   | 5.71 |
| 60 | 000681 | 视觉中国 | 748,140.00   | 5.38 |
| 61 | 000002 | 万科A  | 741,634.00   | 5.33 |
| 62 | 601009 | 南京银行 | 719,170.00   | 5.17 |
| 63 | 300144 | 宋城演艺 | 716,308.00   | 5.15 |
| 64 | 601888 | 中国国旅 | 634,559.00   | 4.56 |
| 65 | 002867 | 周大生  | 632,992.00   | 4.55 |
| 66 | 600276 | 恒瑞医药 | 625,430.00   | 4.50 |
| 67 | 002341 | 新纶科技 | 602,372.00   | 4.33 |
| 68 | 600138 | 中青旅  | 575,212.00   | 4.14 |
| 69 | 300122 | 智飞生物 | 569,117.00   | 4.09 |
| 70 | 600141 | 兴发集团 | 536,964.31   | 3.86 |
| 71 | 300009 | 安科生物 | 534,924.54   | 3.85 |
| 72 | 002007 | 华兰生物 | 514,750.00   | 3.70 |
| 73 | 600409 | 三友化工 | 472,931.00   | 3.40 |
| 74 | 002044 | 美年健康 | 451,285.00   | 3.24 |
| 75 | 300323 | 华灿光电 | 442,170.84   | 3.18 |
| 76 | 300094 | 国联水产 | 393,140.80   | 2.83 |
| 77 | 000513 | 丽珠集团 | 378,521.00   | 2.72 |
| 78 | 600256 | 广汇能源 | 315,215.00   | 2.27 |
| 79 | 601766 | 中国中车 | 306,000.00   | 2.20 |
| 80 | 002217 | 合力泰  | 286,800.00   | 2.06 |
| 81 | 300003 | 乐普医疗 | 286,744.00   | 2.06 |

注：卖出金额按卖出成交金额（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 | 118,491,655.27 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 117,203,597.89 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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，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：

招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）于 2018 年 5 月 4 日收到中国银行保险监督管理委员会（以下简称“中国银保监会”）出具的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银监罚决字（2018）1 号）》，就招商银行主要违法违规事实公告如下：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。

中国银保监会对招商银行做出如下行政处罚：没收违法所得人民币 3.024 万元，处以罚款人民币 6,570 万元，罚没合计人民币 6,573.024 万元。

本基金对招商银行投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件仅对招商银行短期经营有一定影响，不改变长期投资价值。同时由于本基金看好银行的长期发展前景，因此买入招商银行。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。

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   | 13,244.62  |
| 2  | 应收证券清算款 | 279,332.55 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 321.24     |
| 5  | 应收申购款   | 10,134.81  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |

|   |    |            |
|---|----|------------|
| 9 | 合计 | 303,033.22 |
|---|----|------------|

#### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额         | 占总份<br>额比例 |
| 775          | 11,839.08     | -     | -          | 9,175,287.22 | 100.00%    |

### 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<br>持有本基金 | 4.15      | 0.000045% |

### 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<br>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（2014年9月23日）基金份额总额  | 295,887,926.59 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 11,326,639.73  |
| 本报告期期间基金总申购份额              | 38,218,009.68  |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额            | 40,369,362.19  |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 9,175,287.22   |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本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第五届董事会第十一次会议审议通过，自 2018 年 11 月 20 日起，胡昕彦女士不再担任公司副总经理。相关公告已于 2018 年 11 月 17 日在《中国证券报》和公司网站披露。

#### (二) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。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 63000.00 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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<br>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<br>成交总额的比<br>例 | 佣金        | 占当期佣金<br>总量的比例 |    |
| 东方证券  | 2          | 68,366,887.62 | 29.01%               | 63,670.22 | 29.33%         | -  |
| 长江证券  | 2          | 36,413,532.59 | 15.45%               | 33,912.11 | 15.62%         | -  |
| 光大证券  | 2          | 32,090,071.03 | 13.62%               | 29,884.97 | 13.76%         | -  |
| 广发证券  | 1          | 19,580,950.22 | 8.31%                | 18,235.81 | 8.40%          | -  |
| 华创证券  | 1          | 17,241,001.50 | 7.32%                | 16,056.57 | 7.40%          | -  |
| 银河证券  | 1          | 13,323,227.70 | 5.65%                | 12,407.87 | 5.72%          | -  |
| 中信建投  | 2          | 11,777,956.00 | 5.00%                | 10,968.70 | 5.05%          | -  |
| 太平洋证券 | 1          | 10,536,957.71 | 4.47%                | 7,705.74  | 3.55%          | -  |
| 中信证券  | 1          | 8,167,904.40  | 3.47%                | 7,606.78  | 3.50%          | -  |
| 海通证券  | 2          | 5,307,069.00  | 2.25%                | 4,942.51  | 2.28%          | -  |
| 国信证券  | 1          | 4,383,103.43  | 1.86%                | 4,081.94  | 1.88%          | -  |
| 东吴证券  | 2          | 4,264,635.93  | 1.81%                | 3,971.72  | 1.83%          | -  |
| 兴业证券  | 1          | 1,282,765.00  | 0.54%                | 1,194.70  | 0.55%          | -  |
| 中泰证券  | 1          | 1,268,517.00  | 0.54%                | 1,181.36  | 0.54%          | -  |
| 东北证券  | 2          | 1,010,921.03  | 0.43%                | 739.24    | 0.34%          | -  |
| 申万宏源  | 2          | 366,620.00    | 0.16%                | 341.44    | 0.16%          | -  |
| 方正证券  | 1          | 285,593.00    | 0.12%                | 208.86    | 0.10%          | -  |
| 华泰证券  | 1          | -             | -                    | -         | -              | -  |
| 瑞银证券  | 1          | -             | -                    | -         | -              | -  |
| 中金公司  | 1          | -             | -                    | -         | -              | -  |
| 国海证券  | 2          | -             | -                    | -         | -              | -  |



|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |

注：

管理人对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其他相关因素后决定的。报告期内，本基金新增太平洋证券上海交易单元 1 个，方正证券上海交易单元 1 个。停止租用广发证券上海交易单元 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例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长江证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 光大证券  | 2,153,291.40 | 51.86%       | -      | -              | -    | -            |
| 广发证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华创证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 银河证券  | 1,998,800.00 | 48.14%       | -      | -              | -    | -            |
| 中信建投  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 太平洋证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 海通证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国信证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东吴证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 兴业证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中泰证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东北证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 申万宏源  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                  |      |               |               | 报告期末持有基金情况 |      |
|--|----------------|----------------------------------|------|---------------|---------------|------------|------|
|  | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间          | 期初份额 | 申购份额          | 赎回份额          | 持有份额       | 份额占比 |
| 机构   | 1              | 2018 年 8 月 24 日至 2018 年 9 月 17 日 | -    | 4,070,846.91  | 4,070,846.91  | -          | -    |
|  | 2              | 2018 年 1 月 2 日至 2018 年 5 月 10 日  | -    | 20,357,491.86 | 20,357,491.86 | -          | -    |
|  | 3              | 2018 年 1 月 2 日至 2018 年 8 月 26 日  | -    | 12,214,169.38 | 12,214,169.38 | -          | -    |
| 产品特有风险   |                |                                  |      |               |               |            |      |
| <p>1. 流动性风险</p> <p>投资者大额赎回所持有的基金份额时，为了实现基金资产的迅速变现，在基金交易过程中可能存在无法实现交易价格最优；亦或导致基金仓位调整困难，基金资产不能迅速转变成现金，产生流动性风险。</p> <p>一旦引发巨额赎回，当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，可能出现比例赎回、延期支付赎回款等情形。</p> <p>管理人有权根据本基金合同和招募说明书的约定，基于投资者保护原则，暂停或拒绝申购、暂停赎回。</p> <p>2. 估值风险</p> <p>投资者大额赎回所持有的基金份额时，基金份额净值可能受到尾差和部分赎回费归入基金资产的影响，从而导致非市场因素的净值异常波动。</p> |                |                                  |      |               |               |            |      |

国海富兰克林基金管理有限公司

2019 年 3 月 29 日