

# 富兰克林国海估值优势灵活配置混合型证券投资基金

## 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

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

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金简称       | 国富估值优势混合        |
| 基金主代码      | 006039          |
| 前端交易代码     | 006039          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2018 年 8 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      | 中国农业银行股份有限公司    |
| 报告期末基金份额总额 | 36,452,957.10 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金通过积极优选 A 股和港股通标的股票当中具有明显估值优势且质地优良的股票，同时通过严格风险控制来追求稳健收益，力求实现基金资产的长期稳定增值。   |
| 投资策略 | <p>(一) 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、国家/地区政策、证券市场流动性、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。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>本基金管理人将坚持自上而下的行业配置与自下而上的个股精选相结合的策略，积极优选 A 股和港股通标的股票当中具有明显估值优势且质地优良的股票，并且在本基金合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内 A 股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例。</p> <p>(三) 债券投资策略</p> <p>本基金通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>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><b>(四) 股指期货投资策略</b></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><b>(五) 国债期货投资策略</b></p> <p>本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。</p> <p><b>(六) 中小企业私募债券投资策略</b></p> <p>本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较，对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析，选择具有优势的品种进行投资，并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×40%+恒生指数收益率×30%+中债综合指数收益率×30%  |
| 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，属于中风险收益特征的基金品种。本基金可通过港股通投资于香港市场股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。  |

### 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                           | 中国农业银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 储丽莉                                      | 贺倩                  |
|         | 联系电话 | 021-3855 5555                            | 010-6606 0069       |
|         | 电子邮箱 | service@ftsfund. com                     | tgxxpl@abchina. com |
| 客户服务电话  |      | 400-700-4518、9510-5680<br>和 021-38789555 | 95599               |
| 传真      |      | 021-6888 3050                            | 010-6812 1816       |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| 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    |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

|               |                             |
|---------------|-----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019年1月1日 – 2019年6月30日) |
| 本期已实现收益       | 26,395,504.61               |
| 本期利润          | 32,372,156.71               |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.3895                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 28.05%                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日)            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1797                      |
| 期末基金资产净值      | 43,003,342.93               |
| 期末基金份额净值      | 1.1797                      |

注：

1. 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则—第1号《主要财务指标的计算及披露》。
2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。
4. 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

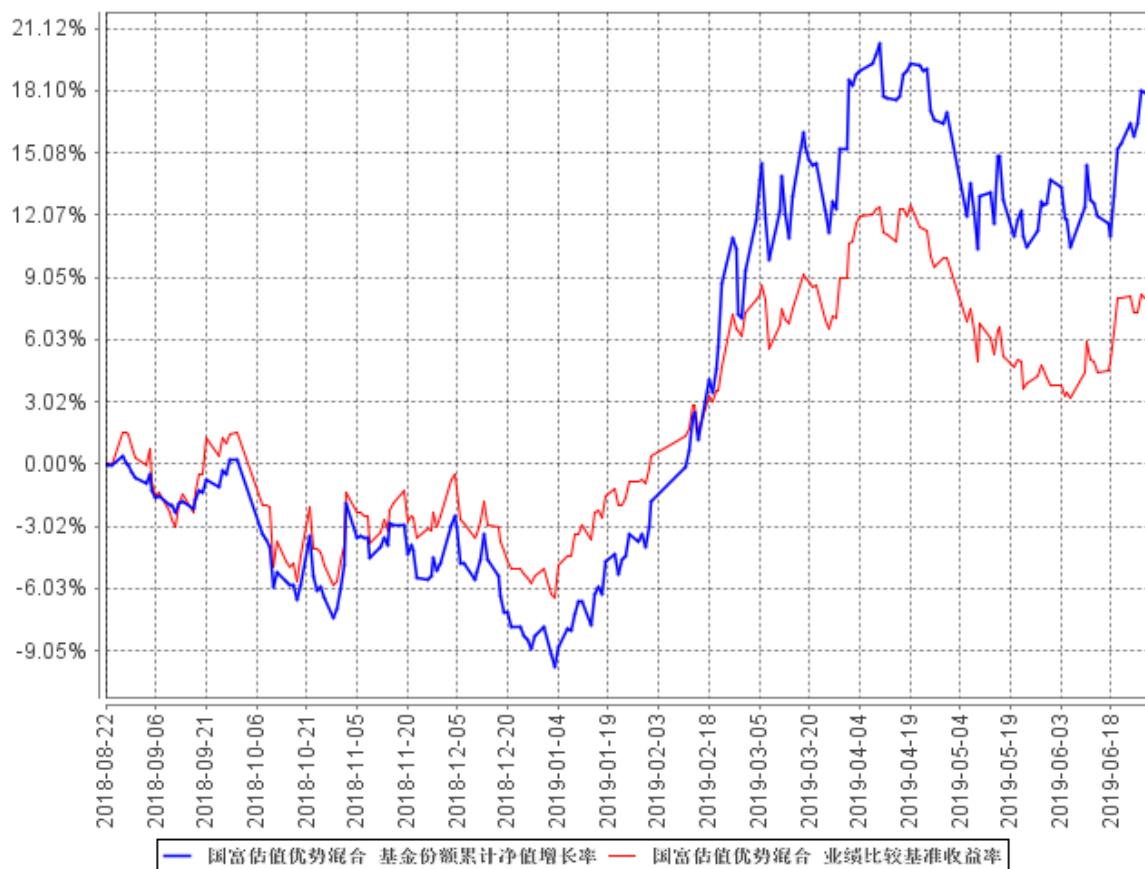
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 3.66%    | 1.08%       | 4.08%      | 0.71%         | -0.42% | 0.37% |
| 过去三个月      | 2.32%    | 1.23%       | -0.92%     | 0.82%         | 3.24%  | 0.41% |
| 过去六个月      | 28.05%   | 1.31%       | 13.83%     | 0.84%         | 14.22% | 0.47% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.97%   | 1.17%       | 8.05%      | 0.91%         | 9.92%  | 0.26% |

### 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

国富估值优势混合 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 2018 年 8 月 22 日。截止本报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

## § 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，本公司旗下运作 32 只基金产品。

#### 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 |        |   |
| 徐成 | 公司 QDII 投资副总监，国富亚洲机会股票 (QDII) 基金、国富大中华精选混合 (QDII) 基金、国富美元债定期债券 (QDII) | 2018 年 8 月 22 日 | -    | 13 年   | 徐成先生，CFA，朴茨茅斯大学（英国）金融决策分析硕士。历任永丰金证券（亚洲）有限公司上海办事处研究员，新加坡东京海上国际资产管理有限公司上海办事处研究员、高级研究员、首席代表。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司 QDII 投资副总监，国富亚洲机会股票 (QDII) 基金、国富大中华精选混合 (QDII) 基金、国富美元债定期债券 (QDII) 基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基 |

|   |  |  |  |                          |
|---|--|--|--|--------------------------|
| 基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金及国富全球科技互联混合(QDII)的基金经理 |  |  |  | 金及国富全球科技互联混合(QDII)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遵规守信情况的说明

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《富兰克林国海估值优势灵活配置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。

报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。

报告期内公司不存在投资组合之间发生的同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度，以选股为主，其中新能源、科技、大消费等行业仓位较高对业绩有正面贡献。二季度，市场总体较为波动；策略上，考虑到宏观的不确定性，降低了仓位。行业上增加了盈利确定性相对较强的公共事业、必选消费、教育等板块。此外，上半年本基金也配置了地产、医药、基建、和互联网等板块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，2019 年上半年净值 1.1797 元，上涨 28.05%，业绩基准上涨 13.83%，跑赢业绩基准 14.22%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，中美贸易摩擦仍将给全球宏观经济带来一定的不确定性，美联储可能会在下半年降息，利好全球股票市场的流动性（包括香港市场）。此外，中国经济仍有韧性，且新兴行业的发展方兴未艾；而且，目前港股和 A 股估值均低于历史平均水平。

下半年，我们将主要关注大消费、新能源、科技及互联网等行业；精选质地较好的个股作重点配置。同时，密切关注宏观经济的形式，也看好股息率较高的个股。

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**

本报告期内，基金资产净值存在连续 20 个工作日低于 5000 万元的情形。

## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国海富兰克林基金管理有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，国海富兰克林基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，国海富兰克林基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海估值优势灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日： 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2019年6月30日         | 上年度末<br>2018年12月31日         |
|-----------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |                           |                             |
| 银行存款            | 1,629,248.55              | 4,576,505.53                |
| 结算备付金           | 1,304,611.25              | 5,639,819.75                |
| 存出保证金           | 211,633.76                | 127,236.95                  |
| 交易性金融资产         | 40,446,562.95             | 149,924,781.71              |
| 其中：股票投资         | 38,056,476.55             | 130,458,684.51              |
| 基金投资            | —                         | —                           |
| 债券投资            | 2,390,086.40              | 19,466,097.20               |
| 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        | —                         | 15,300,000.00               |
| 应收证券清算款         | 150,471.65                | 2,036,281.70                |
| 应收利息            | 25,859.82                 | 470,988.80                  |
| 应收股利            | 145,821.48                | 546.75                      |
| 应收申购款           | 20,887.01                 | 3,699.56                    |
| 递延所得税资产         | —                         | —                           |
| 其他资产            | —                         | —                           |
| 资产总计            | 43,935,096.47             | 178,079,860.75              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2019年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2018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         | 209,112.67                | 3,241,864.01                |
| 应付赎回款           | 445,243.77                | 155,401.19                  |
| 应付管理人报酬         | 52,375.42                 | 247,958.03                  |
| 应付托管费           | 8,729.22                  | 41,326.35                   |
| 应付销售服务费         | —                         | —                           |
| 应付交易费用          | 122,296.78                | 653,739.63                  |

|               |               |                |
|---------------|---------------|----------------|
| 应交税费          | -             | -              |
| 应付利息          | -             | -              |
| 应付利润          | -             | -              |
| 递延所得税负债       | -             | -              |
| 其他负债          | 93,995.68     | 184,889.87     |
| 负债合计          | 931,753.54    | 4,525,179.08   |
| <b>所有者权益:</b> |               |                |
| 实收基金          | 36,452,957.10 | 188,372,850.46 |
| 未分配利润         | 6,550,385.83  | -14,818,168.79 |
| 所有者权益合计       | 43,003,342.93 | 173,554,681.67 |
| 负债和所有者权益总计    | 43,935,096.47 | 178,079,860.75 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1797 元，基金份额总额 36,452,957.10 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海估值优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           | 34,244,833.02                            | -   |
| 1.利息收入                | 163,159.20                               | -   |
| 其中：存款利息收入             | 50,116.62                                | -   |
| 债券利息收入                | 100,030.71                               | -   |
| 资产支持证券利息收入            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            | 13,011.87                                | -   |
| 其他利息收入                | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | 27,904,707.38                            | -   |
| 其中：股票投资收益             | 27,492,257.74                            | -   |
| 基金投资收益                | -  | -   |
| 债券投资收益                | 18,195.80                                | -   |
| 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                  | 394,253.84                               | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 5,976,652.10                             | -   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 200,314.34                               | -   |
| <b>减：二、费用</b>         | 1,872,676.31                             | -   |

|                            |                      |   |
|----------------------------|----------------------|---|
| 1. 管理人报酬                   | 658,841.16           | - |
| 2. 托管费                     | 109,806.81           | - |
| 3. 销售服务费                   | -                    | - |
| 4. 交易费用                    | 994,462.19           | - |
| 5. 利息支出                    | -                    | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                    | - |
| 6. 税金及附加                   | -                    | - |
| 7. 其他费用                    | 109,566.15           | - |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> | <b>32,372,156.71</b> | - |
| 减：所得税费用                    | -                    | - |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   | <b>32,372,156.71</b> | - |

注：本基金成立日为 2018 年 8 月 22 日，因此无上年度可比期间金额。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海估值优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |                |                 |
|--|---------------------------------------|----------------|-----------------|
|  | 实收基金                                  | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 188,372,850.46                        | -14,818,168.79 | 173,554,681.67  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                     | 32,372,156.71  | 32,372,156.71   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | -151,919,893.36                       | -11,003,602.09 | -162,923,495.45 |
| 其中：1.基金申购款                             | 6,386,476.93                          | 786,756.32     | 7,173,233.25    |
| 2.基金赎回款                                | -158,306,370.29                       | -11,790,358.41 | -170,096,728.70 |
| 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                            | 36,452,957.10                         | 6,550,385.83   | 43,003,342.93   |

| 金净值)   |                                 |       |         |
|--|---------------------------------|-------|---------|
| 项目   | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |       |         |
|  | 实收基金                            | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基<br>金净值)                                | -                               | -     | -       |
| 二、本期经营活动产<br>生的基金净值变动数(本<br>期利润)                   | -                               | -     | -       |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填<br>列)      | -                               | -     | -       |
| 其中：1.基金申购款   | -                               | -     | -       |
| 2.基金赎回款  | -                               | -     | -       |
| 四、本期向基金份额持<br>有人分配利润产生的基<br>金净值变动(净值减少<br>以“-”号填列) | -                               | -     | -       |
| 五、期末所有者权益(基<br>金净值)                                | -                               | -     | -       |

注：本基金成立日为 2018 年 8 月 22 日，因此无上年度可比期间金额。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海估值优势灵活配置混合型证券投资基金(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[2018]488 号《关于准予富兰克林国海国策导向(沪港深)灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》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《富兰克林国海估值优势灵活配置混合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，首次募集期间为 2018

年 7 月 23 日至 2018 年 8 月 17 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 545,419,992.26 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(2018)第 0579 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海估值优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 8 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 545,563,004.37 份基金份额，其中认购资金利息折合 143,012.11 份基金份额。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司，基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海估值优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票” )、国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 0%-95%，港股投资比例不得超过股票资产的 50%；其中权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40%+恒生指数收益率×30%+中债综合指数收益率×30%。

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 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《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》、《富兰克林国海估值优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金本报告期内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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 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。

##### **6.4.5.2 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。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

## 6.4.7 关联方关系

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

无。

#### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系               |
|----------------------|-----------------------|
| 国海富兰克林基金管理有限公司       | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司“中国农业银行” | 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       |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 国海证券  | 211,815,051.88             | 36.46%           | -                               | -                |

##### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.8.1.3 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>2019年1月1日至2019年6月30日 |                |           |                  |
|-------|----------------------------|----------------|-----------|------------------|
|       | 当期佣金                       | 占当期佣金总量<br>的比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 国海证券  | 169,452.00                 | 36.06%         | 25,706.42 | 21.02%           |

注：

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

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 658,841.16                     | -                               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 244,601.90                     | -                               |

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 × 1.50% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 109,806.81                 | -                               |

注：支付基金托管人中国农业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 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

1. 基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
2. 本基金基金合同生效日为 2018 年 8 月 22 日，本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

1. 本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
2. 本报告期末和上年度末（2018 年 12 月 31 日）除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方<br>名称 | 本期                              |           | 上年度可比期间                         |        |
|-----------|---------------------------------|-----------|---------------------------------|--------|
|           | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 当期利息收入    | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 当期利息收入 |
| 期末余额      |                                 | 期末余额      |                                 |        |
| 中国农业银行    | 1,629,248.55                    | 27,258.61 | -                               | -      |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 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<br>(单位:股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 601236               | 红塔证券 | 2019 年 6 月 26 日 | 2019 年 7 月 5 日 | 新股未上市  | 3.46 | 3.46   | 9,789        | 33,869.94 | 33,869.94 | -  |

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.9.3 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。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 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 38,022,606.61 元，属于第二层次的余额为 2,423,956.34 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层为 130,458,684.51 元，第二层次为 19,466,097.20 元，无第三层次)。

###### (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、和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、债券和资产支持证券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、债券和资产支持证券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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 38,056,476.55 | 86.62         |
|    | 其中：股票             | 38,056,476.55 | 86.62         |
| 2  | 基金投资              | —             | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 2,390,086.40  | 5.44          |
|    | 其中：债券             | 2,390,086.40  | 5.44          |
|    | 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      | 2,933,859.80  | 6.68          |
| 8  | 其他各项资产            | 554,673.72    | 1.26          |
| 9  | 合计                | 43,935,096.47 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —             | —            |
| B  | 采矿业              | 27,395.35     | 0.06         |
| C  | 制造业              | 10,381,573.79 | 24.14        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 665,091.00    | 1.55         |
| E  | 建筑业              | —             | —            |
| F  | 批发和零售业           | 2,001,830.00  | 4.66         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,699,206.60  | 3.95         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 756,958.00    | 1.76         |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 19,404.00     | 0.05  |
| J | 金融业             | 4,338,156.68  | 10.09 |
| K | 房地产业            | -             | -     |
| L | 租赁和商务服务业        | 744,660.00    | 1.73  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 675,636.00    | 1.57  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | -             | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -             | -     |
| P | 教育              | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 976,508.00    | 2.27  |
| S | 综合              | -             | -     |
|   | 合计              | 22,286,419.42 | 51.82 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值(人民币)     | 占基金资产净值比例(%) |
|------|---------------|--------------|
| 可选消费 | 5,404,821.81  | 12.57        |
| 公用事业 | -             | -            |
| 电信服务 | 861,978.83    | 2.00         |
| 信息技术 | 3,141,393.05  | 7.30         |
| 金融   | 605,260.62    | 1.41         |
| 医疗保健 | -             | -            |
| 材料   | 846,232.92    | 1.97         |
| 工业   | 2,658,541.89  | 6.18         |
| 能源   | -             | -            |
| 日常消费 | -             | -            |
| 房地产  | 2,251,828.01  | 5.24         |
| 合计   | 15,770,057.13 | 36.67        |

注：以上分类采用 GICS 行业分类标准

### 7.3 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  | 603899 | 晨光文具 | 54,000 | 2,374,380.00 | 5.52         |
| 2  | 603711 | 香飘飘  | 57,889 | 1,966,489.33 | 4.57         |
| 3  | 601012 | 隆基股份 | 83,330 | 1,925,756.30 | 4.48         |
| 4  | 600004 | 白云机场 | 93,363 | 1,699,206.60 | 3.95         |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 79,500 | 1,454,055.00 | 3.38         |

|    |          |        |         |              |      |
|----|----------|--------|---------|--------------|------|
| 6  | 600036   | 招商银行   | 39,813  | 1,432,471.74 | 3.33 |
| 7  | 601318   | 中国平安   | 16,000  | 1,417,760.00 | 3.30 |
| 8  | 00968 HK | 信义光能   | 410,400 | 1,389,897.98 | 3.23 |
| 9  | 601799   | 星宇股份   | 15,200  | 1,200,192.00 | 2.79 |
| 10 | 600298   | 安琪酵母   | 35,400  | 1,119,702.00 | 2.60 |
| 11 | 603939   | 益丰药房   | 15,400  | 1,077,846.00 | 2.51 |
| 12 | 300144   | 宋城演艺   | 42,200  | 976,508.00   | 2.27 |
| 13 | 00881 HK | 中升控股   | 49,000  | 937,497.65   | 2.18 |
| 14 | 603883   | 老百姓    | 15,800  | 923,984.00   | 2.15 |
| 15 | 02338 HK | 潍柴动力   | 79,000  | 917,309.45   | 2.13 |
| 16 | 00788 HK | 中国铁塔   | 478,000 | 861,978.83   | 2.00 |
| 17 | 00763 HK | 中兴通讯   | 43,400  | 860,896.85   | 2.00 |
| 18 | 01787 HK | 山东黄金   | 46,250  | 846,232.92   | 1.97 |
| 19 | 00921 HK | 海信家电   | 100,300 | 836,419.43   | 1.95 |
| 20 | 03380 HK | 龙光地产   | 74,000  | 822,798.78   | 1.91 |
| 21 | 02382 HK | 舜宇光学科技 | 11,482  | 815,090.67   | 1.90 |
| 22 | 01918 HK | 融创中国   | 24,000  | 810,694.66   | 1.89 |
| 23 | 600258   | 首旅酒店   | 42,100  | 756,958.00   | 1.76 |
| 24 | 601888   | 中国国旅   | 8,400   | 744,660.00   | 1.73 |
| 25 | 02238 HK | 广汽集团   | 100,306 | 735,881.37   | 1.71 |
| 26 | 002422   | 科伦药业   | 23,900  | 710,547.00   | 1.65 |
| 27 | 300284   | 苏交科    | 73,200  | 675,636.00   | 1.57 |
| 28 | 03898 HK | 中车时代电气 | 18,400  | 666,043.37   | 1.55 |
| 29 | 000966   | 长源电力   | 117,300 | 665,091.00   | 1.55 |
| 30 | 01157 HK | 中联重科   | 144,600 | 652,530.03   | 1.52 |
| 31 | 00175 HK | 吉利汽车   | 53,894  | 633,376.17   | 1.47 |
| 32 | 00868 HK | 信义玻璃   | 86,000  | 620,336.23   | 1.44 |
| 33 | 01896 HK | 猫眼娱乐   | 54,400  | 616,353.13   | 1.43 |
| 34 | 03301 HK | 融信中国   | 72,000  | 609,921.06   | 1.42 |
| 35 | 600486   | 扬农化工   | 11,100  | 607,170.00   | 1.41 |
| 36 | 03908 HK | 中金公司   | 43,600  | 604,446.05   | 1.41 |
| 37 | 600741   | 华域汽车   | 21,100  | 455,760.00   | 1.06 |
| 38 | 01138 HK | 中远海能   | 104,000 | 422,659.04   | 0.98 |
| 39 | 00425 HK | 敏实集团   | 20,000  | 370,336.86   | 0.86 |
| 40 | 01929 HK | 周大福    | 33,000  | 246,744.63   | 0.57 |
| 41 | 03669 HK | 永达汽车   | 32,500  | 204,410.99   | 0.48 |
| 42 | 00780 HK | 同程艺龙   | 14,400  | 196,340.11   | 0.46 |

|    |          |             |       |           |      |
|----|----------|-------------|-------|-----------|------|
| 43 | 00522 HK | ASM PACIFIC | 976   | 68,683.85 | 0.16 |
| 44 | 601236   | 红塔证券        | 9,789 | 33,869.94 | 0.08 |
| 45 | 600968   | 海油发展        | 7,717 | 27,395.35 | 0.06 |
| 46 | 603867   | 新化股份        | 836   | 21,577.16 | 0.05 |
| 47 | 601698   | 中国卫通        | 4,950 | 19,404.00 | 0.05 |
| 48 | 02669 HK | 中海物业        | 2,350 | 8,413.51  | 0.02 |
| 49 | 00700 HK | 腾讯控股        | 22    | 6,823.70  | 0.02 |
| 50 | 01169 HK | 海尔电器        | 200   | 3,800.13  | 0.01 |
| 51 | 00751 HK | 创维数码        | 1,800 | 3,325.11  | 0.01 |
| 52 | 06881 HK | 中国银河        | 200   | 814.57    | 0.00 |

注：鉴于部分股票占基金资产净值的比例过于微小，四舍五入后无法通过小数点后两位数据加以列示，故标注为“0.00”。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码     | 股票名称   | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|--------|--------------|-----------------|
| 1  | 06881 HK | 中国银河   | 6,882,702.27 | 3.97            |
| 2  | 600036   | 招商银行   | 6,222,929.00 | 3.59            |
| 3  | 02238 HK | 广汽集团   | 5,683,667.12 | 3.27            |
| 4  | 00700 HK | 腾讯控股   | 5,639,950.43 | 3.25            |
| 5  | 02628 HK | 中国人寿   | 5,371,825.25 | 3.10            |
| 6  | 601318   | 中国平安   | 5,329,004.00 | 3.07            |
| 7  | 601166   | 兴业银行   | 5,058,459.00 | 2.91            |
| 8  | 02382 HK | 舜宇光学科技 | 4,885,756.19 | 2.82            |
| 9  | 603939   | 益丰药房   | 4,449,966.00 | 2.56            |
| 10 | 00175 HK | 吉利汽车   | 4,390,474.29 | 2.53            |
| 11 | 000568   | 泸州老窖   | 4,197,773.00 | 2.42            |
| 12 | 600519   | 贵州茅台   | 4,189,890.00 | 2.41            |
| 13 | 03888 HK | 金山软件   | 4,158,737.53 | 2.40            |
| 14 | 601100   | 恒立液压   | 4,132,263.40 | 2.38            |
| 15 | 01610 HK | 中粮肉食   | 3,715,510.66 | 2.14            |
| 16 | 002371   | 北方华创   | 3,593,290.00 | 2.07            |
| 17 | 300747   | 锐科激光   | 3,586,200.00 | 2.07            |

|    |          |             |                 |       |
|----|----------|-------------|-----------------|-------|
| 18 | 601628   | 中国人寿        | 3, 558, 480. 00 | 2. 05 |
| 19 | 600312   | 平高电气        | 3, 472, 489. 00 | 2. 00 |
| 20 | 00522 HK | ASM PACIFIC | 3, 462, 671. 99 | 2. 00 |

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。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码     | 股票名称   | 本期累计卖出金额         | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|--------|------------------|-----------------|
| 1  | 00700 HK | 腾讯控股   | 13, 623, 455. 38 | 7. 85           |
| 2  | 601100   | 恒立液压   | 7, 853, 003. 80  | 4. 52           |
| 3  | 06881 HK | 中国银河   | 7, 602, 255. 71  | 4. 38           |
| 4  | 01610 HK | 中粮肉食   | 7, 137, 269. 97  | 4. 11           |
| 5  | 603816   | 顾家家居   | 6, 921, 906. 60  | 3. 99           |
| 6  | 01818 HK | 招金矿业   | 6, 354, 573. 48  | 3. 66           |
| 7  | 600298   | 安琪酵母   | 6, 207, 327. 54  | 3. 58           |
| 8  | 03311 HK | 中国建筑国际 | 6, 116, 909. 41  | 3. 52           |
| 9  | 02628 HK | 中国人寿   | 5, 792, 881. 75  | 3. 34           |
| 10 | 300498   | 温氏股份   | 5, 729, 946. 40  | 3. 30           |
| 11 | 01169 HK | 海尔电器   | 5, 671, 934. 40  | 3. 27           |
| 12 | 02238 HK | 广汽集团   | 5, 662, 829. 47  | 3. 26           |
| 13 | 002714   | 牧原股份   | 5, 457, 567. 40  | 3. 14           |
| 14 | 600036   | 招商银行   | 5, 424, 825. 31  | 3. 13           |
| 15 | 02669 HK | 中海物业   | 5, 341, 684. 04  | 3. 08           |
| 16 | 00968 HK | 信义光能   | 5, 276, 169. 01  | 3. 04           |
| 17 | 000333   | 美的集团   | 5, 013, 253. 34  | 2. 89           |
| 18 | 01788 HK | 国泰君安国际 | 5, 010, 382. 89  | 2. 89           |
| 19 | 600563   | 法拉电子   | 4, 850, 493. 30  | 2. 79           |
| 20 | 601012   | 隆基股份   | 4, 832, 508. 00  | 2. 78           |
| 21 | 000568   | 泸州老窖   | 4, 824, 566. 00  | 2. 78           |
| 22 | 600519   | 贵州茅台   | 4, 550, 135. 00  | 2. 62           |
| 23 | 03888 HK | 金山软件   | 4, 497, 257. 62  | 2. 59           |
| 24 | 603939   | 益丰药房   | 4, 345, 208. 00  | 2. 50           |
| 25 | 601888   | 中国国旅   | 4, 343, 375. 55  | 2. 50           |
| 26 | 06837 HK | 海通证券   | 4, 245, 126. 08  | 2. 45           |
| 27 | 02869 HK | 绿城服务   | 4, 233, 477. 79  | 2. 44           |
| 28 | 03669 HK | 永达汽车   | 4, 213, 498. 18  | 2. 43           |

|    |          |            |                 |       |
|----|----------|------------|-----------------|-------|
| 29 | 002798   | 帝欧家居       | 4, 151, 626. 00 | 2. 39 |
| 30 | 01112 HK | H & H 国际控股 | 4, 084, 788. 61 | 2. 35 |
| 31 | 002371   | 北方华创       | 4, 055, 651. 65 | 2. 34 |
| 32 | 01928 HK | 金沙中国有限公司   | 4, 049, 205. 48 | 2. 33 |
| 33 | 02382 HK | 舜宇光学科技     | 4, 042, 835. 12 | 2. 33 |
| 34 | 03898 HK | 中车时代电气     | 4, 016, 912. 63 | 2. 31 |
| 35 | 601318   | 中国平安       | 3, 978, 984. 84 | 2. 29 |
| 36 | 03988 HK | 中国银行       | 3, 956, 051. 40 | 2. 28 |
| 37 | 01128 HK | 永利澳门       | 3, 923, 707. 06 | 2. 26 |
| 38 | 300012   | 华测检测       | 3, 856, 169. 82 | 2. 22 |
| 39 | 600312   | 平高电气       | 3, 803, 273. 00 | 2. 19 |
| 40 | 300747   | 锐科激光       | 3, 733, 037. 00 | 2. 15 |
| 41 | 601166   | 兴业银行       | 3, 727, 711. 00 | 2. 15 |
| 42 | 00175 HK | 吉利汽车       | 3, 685, 305. 70 | 2. 12 |
| 43 | 601628   | 中国人寿       | 3, 588, 661. 00 | 2. 07 |
| 44 | 01347 HK | 华虹半导体      | 3, 586, 795. 69 | 2. 07 |
| 45 | 00135 HK | 昆仑能源       | 3, 509, 071. 00 | 2. 02 |
| 46 | 000725   | 京东方A       | 3, 484, 954. 00 | 2. 01 |

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                   |
|--------------|-------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 228, 129, 404. 37 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 354, 039, 708. 57 |

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（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值            | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 2, 390, 086. 40 | 5. 56        |
| 2  | 央行票据      | —               | —            |
| 3  | 金融债券      | —               | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —               | —            |
| 4  | 企业债券      | —               | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —               | —            |

|    |           |              |      |   |
|----|-----------|--------------|------|---|
| 6  | 中期票据      |              | -    | - |
| 7  | 可转债（可交换债） |              | -    | - |
| 8  | 同业存单      |              | -    | - |
| 9  | 其他        |              | -    | - |
| 10 | 合计        | 2,390,086.40 | 5.56 |   |

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019611 | 19 国债 01 | 23,920 | 2,390,086.40 | 5.56         |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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

### **7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

### **7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 本基金本期投资的前十名证券中，无报告期内发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。**

**7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。**

### **7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 211,633.76 |
| 2  | 应收证券清算款 | 150,471.65 |
| 3  | 应收股利    | 145,821.48 |
| 4  | 应收利息    | 25,859.82  |
| 5  | 应收申购款   | 20,887.01  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 554,673.72 |

### **7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

### **7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<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 |
| 1,684        | 21,646.65     | 2,986,296.72 | 8.19%      | 33,466,660.38 | 91.81%     |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 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<br>门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                             |                |
|-----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2018年8月22日）基金份额总额   | 545,563,004.37 |
| 本报告期期初基金份额总额                | 188,372,850.46 |
| 本报告期内期间基金总申购份额              | 6,386,476.93   |
| 减：本报告期内期间基金总赎回份额            | 158,306,370.29 |
| 本报告期内期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 本报告期末基金份额总额                 | 36,452,957.10  |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (一) 基金管理人重大人事变动

经国海富兰克林基金管理有限公司第五届董事会第十七次会议审议通过，自 2019 年 6 月 24 日起，王雷先生不再担任公司副总经理。相关公告已于 2019 年 6 月 26 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

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### (一) 基金管理人及高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### (二) 基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称          | 交易单元<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 |    |
| 国海证券          | 2          | 211,815,051.88 | 36.46%               | 169,452.00 | 36.06%         | -  |
| 国盛证券          | 1          | 65,107,884.75  | 11.21%               | 47,613.96  | 10.13%         | -  |
| 西藏东方财富<br>富证券 | 2          | 48,457,259.11  | 8.34%                | 35,436.79  | 7.54%          | -  |
| 安信证券          | 2          | 44,076,842.40  | 7.59%                | 41,048.68  | 8.74%          | -  |
| 中信证券          | 2          | 42,024,432.05  | 7.23%                | 34,728.95  | 7.39%          | -  |
| 天风证券          | 1          | 37,134,661.16  | 6.39%                | 27,156.92  | 5.78%          | -  |
| 国泰君安          | 1          | 36,416,594.26  | 6.27%                | 30,349.30  | 6.46%          | -  |
| 国金证券          | 1          | 21,987,652.13  | 3.78%                | 20,476.91  | 4.36%          | -  |
| 平安证券          | 2          | 19,063,688.39  | 3.28%                | 13,941.47  | 2.97%          | -  |
| 东兴证券          | 1          | 17,931,290.59  | 3.09%                | 16,699.38  | 3.55%          | -  |
| 海通证券          | 1          | 10,863,954.50  | 1.87%                | 8,691.17   | 1.85%          | -  |
| 方正证券          | 1          | 10,062,659.79  | 1.73%                | 9,371.46   | 1.99%          | -  |
| 银河证券          | 1          | 10,014,819.74  | 1.72%                | 9,326.70   | 1.98%          | -  |
| 高华证券          | 1          | 6,035,137.34   | 1.04%                | 5,620.43   | 1.20%          | -  |
| 东北证券          | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 民族证券          | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 华泰证券          | 2          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 中泰证券          | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 兴业证券          | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 国信证券          | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 华安证券          | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 中金公司          | 2          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 申万宏源          | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 招商证券          | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 中信建投          | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 西南证券          | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 第一创业          | 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，本基金交易单元无变更。

### 10.7.2 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<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额          | 占当期债<br>券回购<br>成交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期权证<br>成交总额的<br>比例 |
| 国海证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 国盛证券          | 3,712,424.10 | 39.02%               | 3,700,000.00  | 6.45%                      | -    | -                    |
| 西藏东方财富<br>富证券 | 421,839.50   | 4.43%                | 14,900,000.00 | 25.96%                     | -    | -                    |
| 安信证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 中信证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 天风证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 国泰君安          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 国金证券          | 4,209,949.00 | 44.25%               | -             | -                          | -    | -                    |
| 平安证券          | -            | -                    | 2,600,000.00  | 4.53%                      | -    | -                    |
| 东兴证券          | 1,169,304.40 | 12.29%               | 34,300,000.00 | 59.76%                     | -    | -                    |
| 海通证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 方正证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 银河证券          | -            | -                    | 1,900,000.00  | 3.31%                      | -    | -                    |
| 高华证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 东北证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 民族证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 华泰证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 中泰证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 兴业证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 国信证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 华安证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 中金公司          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 申万宏源          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 招商证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 中信建投          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 西南证券          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 第一创业          | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于公司治理风险、流动性风险、退市风险、股价波动风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

国海富兰克林基金管理有限公司

2019 年 8 月 28 日