

富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金  
2019 年半年度报告

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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>50</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</b>
11.1 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.....	56

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	国富金融地产混合	
基金主代码	001392	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 9 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	27,098,207.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国富金融地产混合 A	国富金融地产混合 C
下属分级基金的交易代码:	001392	001393
报告期末下属分级基金的份额总额	12,386,521.28 份	14,711,686.68 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过分析金融地产行业的商业模式与利润区，深入挖掘金融地产行业内具有核心竞争优势和持续成长潜力的优质上市公司，力争通过积极的主动管理实现稳健的投资回报。
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>本基金采取“核心-卫星”策略，即将基金股票资产分成核心部分和卫星部分。核心组合主要投资于金融和房地产行业的股票，卫星组合主要投资于与互联网金融主题相关的股票。</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>(四) 股票申购策略</p> <p>本基金将深入研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面，挖掘公司的内在价值，根据当时股票市场整体投资环境及定价水平，一、二级市场间资金供求关系，在有效控制风险的前提下制定相应的股票申购策略。对通过股票申购获得的股票，将根据其实际的投资价值确定持有或卖出。</p> <p>(五) 中小企业私募债券投资策略</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</p>

	<p>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> <p>（六）资产支持证券投资策略</p> <p>对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。</p> <p>（七）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>（八）国债期货投资策略</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>
业绩比较基准	65%×沪深 300 金融地产指数收益率+35%×中债国债总指数收益率（全价）
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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国海富兰克林基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉
	联系电话	021-3855 5555
	电子邮箱	service@ftsfund.com
客户服务电话	400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555	95566
传真	021-6888 3050	010-6659 4942
注册地址	广西南宁市西乡塘区总部路 1 号中国-东盟科技企业孵化基地一期 A-13 栋三层 306 号房	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 9 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	吴显玲	刘连舸

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国海富兰克林基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 9 层

### § 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

基金级别	国富金融地产混合 A	国富金融地产混合 C
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)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	556,303.64	960,886.10
本期利润	2,847,597.14	3,198,510.69
加权平均基金份额本期利润	0.2015	0.2163
本期加权平均净值利润率	17.41%	17.47%
本期基金份额净值增长率	18.28%	19.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	560,927.12	1,499,304.43
期末可供分配基金份额利润	0.0453	0.1019
期末基金资产净值	15,086,787.12	18,884,692.26
期末基金份额净值	1.2180	1.2837
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	21.80%	28.37%

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

国富金融地产混合 A

阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

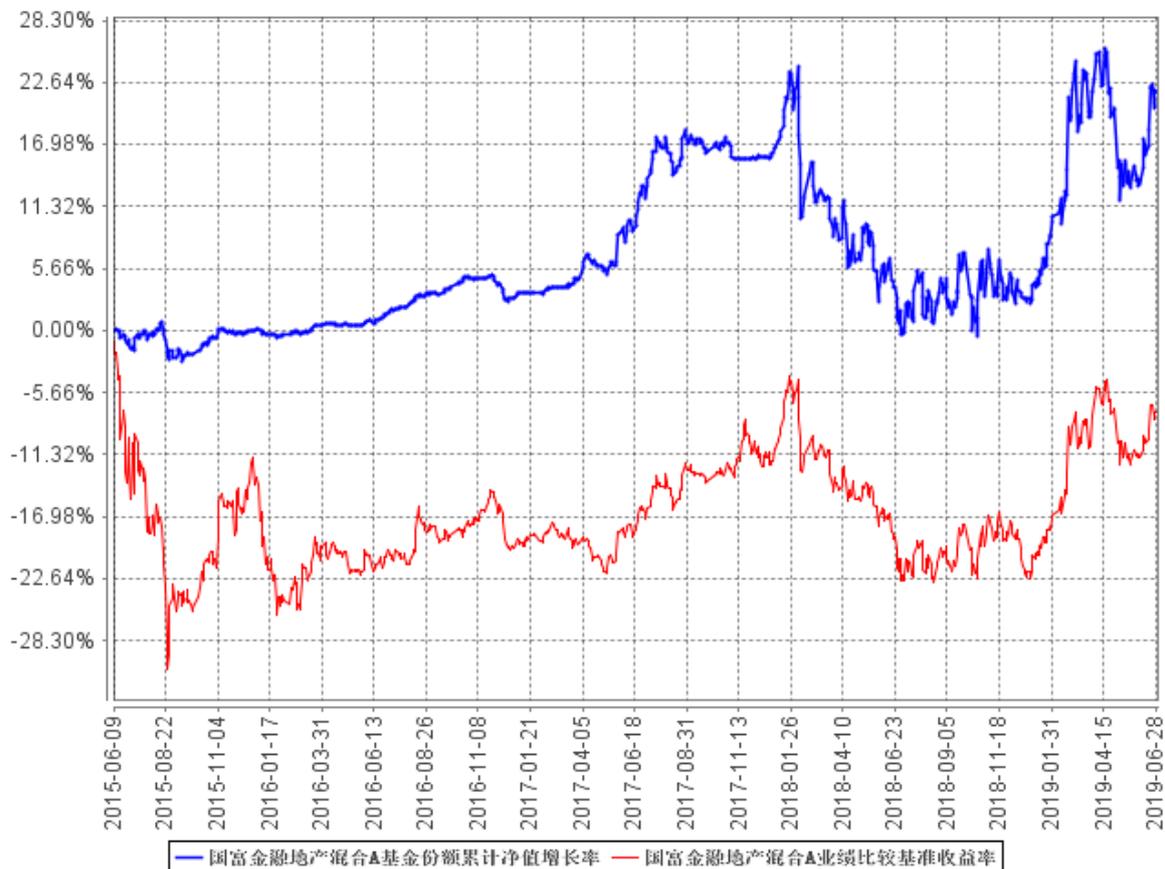
	长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	7.06%	1.11%	4.48%	0.79%	2.58%	0.32%
过去三个月	0.05%	1.29%	0.34%	0.97%	-0.29%	0.32%
过去六个月	18.28%	1.30%	18.57%	1.08%	-0.29%	0.22%
过去一年	19.71%	1.24%	16.76%	1.05%	2.95%	0.19%
过去三年	20.12%	0.85%	16.62%	0.79%	3.50%	0.06%
自基金合同生效起至今	21.80%	0.74%	-7.50%	1.02%	29.30%	-0.28%

## 国富金融地产混合 C

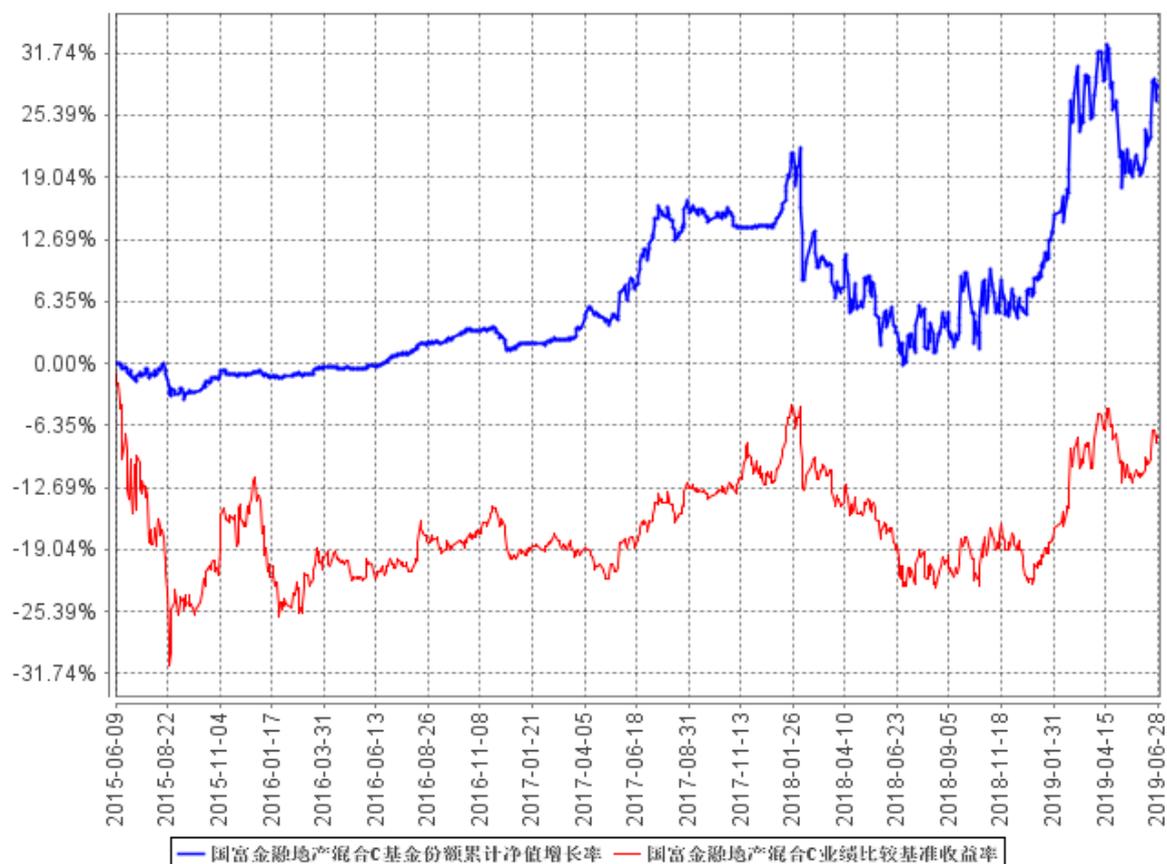
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.03%	1.11%	4.48%	0.79%	2.55%	0.32%
过去三个月	0.67%	1.29%	0.34%	0.97%	0.33%	0.32%
过去六个月	19.37%	1.31%	18.57%	1.08%	0.80%	0.23%
过去一年	25.85%	1.26%	16.76%	1.05%	9.09%	0.21%
过去三年	27.99%	0.86%	16.62%	0.79%	11.37%	0.07%
自基金合同生效起至今	28.37%	0.75%	-7.50%	1.02%	35.87%	-0.27%

### 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

国富金融地产混合A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



### 国富金融地产混合C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 2015 年 6 月 9 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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		
邓钟锋	国富金融地产混合基金、国富新机遇混合基金、国富新增长混合基金、国富新活力混合基金、国富恒丰定期债券基金、国富新趋	2016 年 6 月 29 日	-	12 年	邓钟锋先生，厦门大学金融学硕士。历任深发展银行北京分行公司产品研发及审查、中信银行厦门分行公司信贷审查、上海新世纪信用评级公司债券分析师、农银汇理基金管理有限公司研究员、国海富兰克林基金管理有限公司投资经理、国富恒通纯债债券基金、国富新价值混合基金、国富新收益混合基金的基金经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富金融地产混合基金、国富新机遇混合基金、国富新增

	势混合基金、国富天颐混合基金及国富恒裕 6 个月定期开放债券基金的基金经理				长混合基金、国富新活力混合基金、国富恒丰定期债券基金、国富新趋势混合基金、国富天颐混合基金及国富恒裕 6 个月定期开放债券基金的基金经理。
赵宇焯	国富金融地产混合基金的基金经理兼研究员	2018 年 9 月 8 日	-	5 年	赵宇焯女士，清华大学金融学硕士。历任汇添富基金管理股份有限公司研究员及国海富兰克林基金管理有限公司研究员。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富金融地产混合基金的基金经理兼研究员。

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《富兰克林国海金融地产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

2019 年上半年市场表现强劲，上证综指上涨 19.45%，沪深 300 和创业板指分别上涨 27.07% 和 20.87%。市场上涨一方面源自对经济快速下行担忧的缓解，宏观经济韧性强于市场预期；另一方面受益于一季度流动性释放，风险偏好提高。尽管 5 月份大盘因为中美摩擦回落，但这一事件的冲击远小于 2018 年，表明市场已经逐渐消化中美摩擦，视之为常态。

上半年本基金仓位逐步提高，更关注自下而上选股，仓位集中于短期业绩确定性强、中长期风险较低的优质标的。下半年整体操作偏防御，更重视业绩确定性和估值安全垫。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.2180 元，本报告期份额净值上涨 18.28%，同期业绩基准上涨 18.57%，本基金跑输业绩比较基准 0.29%；本基金 C 类份额净值为 1.2837 元，本报告期份额净值上涨 19.37%，同期业绩基准上涨 18.57%，本基金跑赢业绩比较基准 0.80%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济压力大于上半年。一季度宽松的货币政策延缓了经济向下的节奏，其中房地产行业受益程度最大，成为上半年经济最大的拉动点。但随着政策刺激边际效果递减，地产销售投资增速开始向下，制造业投资难有起色，短期的货币政策也难以逆转经济基本面的趋势，下半年重新面临向下压力。政策层面具备较大的不确定性，目前经济数据尚可，不具备大规模刺激的条件，但处于全球央行降息的环境中，市场对国内进一步货币宽松有一定预期。

下半年市场可能震荡向上，但空间低于上半年。大部分个股已经在上半年完成估值修复，而基本面尚未出现向上拐点，可预期收益率较低。从行业横向比较，金融地产板块估值低，业绩确

定性强，在偏防御的市场中可能获取更多的超额收益。

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投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

#### **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

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

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

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

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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海金融地产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	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,789,671.59	12,507,808.18
结算备付金		4,012.30	25,743.94
存出保证金		7,346.70	2,122.75
交易性金融资产	6.4.7.2	29,333,712.94	10,537,844.80
其中：股票投资		29,333,712.94	10,537,844.80
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	920.23	6,827.20
应收股利		-	-
应收申购款		50,485.48	37,304.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		34,186,149.24	23,117,651.33
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		117,103.38	311,817.99
应付管理人报酬		22,040.78	20,127.70
应付托管费		6,887.75	6,289.94
应付销售服务费		7,662.46	5,602.40
应付交易费用	6.4.7.7	12,144.33	29,098.67

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	48,831.16	219,253.09
负债合计		214,669.86	592,189.79
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	27,098,207.96	21,611,917.31
未分配利润	6.4.7.10	6,873,271.42	913,544.23
所有者权益合计		33,971,479.38	22,525,461.54
负债和所有者权益总计		34,186,149.24	23,117,651.33

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，国富金融地产混合 A 基金份额净值 1.2180 元，基金份额总额 12,386,521.28 份；国富金融地产混合 C 基金份额净值 1.2837 元，基金份额总额 14,711,686.68 份。国富金融地产混合份额总额合计为 27,098,207.96 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海金融地产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	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		6,410,658.39	-3,726,044.13
1.利息收入		32,529.69	105,328.44
其中：存款利息收入	6.4.7.11	32,460.60	29,178.86
债券利息收入		69.09	76,149.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,557,770.08	-738,078.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,228,360.43	-898,018.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	20,902.43	-11,199.52
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	308,507.22	171,139.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,528,918.09	-3,390,923.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	291,440.53	297,628.93
<b>减:二、费用</b>		364,550.56	370,493.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	134,767.82	121,573.08
2. 托管费	6.4.10.2.2	42,114.94	37,991.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	43,658.71	26,651.29
4. 交易费用	6.4.7.18	45,217.51	60,863.15
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	6.4.7.19	98,791.58	123,414.67
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		6,046,107.83	-4,096,537.84
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		6,046,107.83	-4,096,537.84

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 富兰克林国海金融地产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 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)	21,611,917.31	913,544.23	22,525,461.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,046,107.83	6,046,107.83
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)	5,486,290.65	-86,380.64	5,399,910.01
其中: 1.基金申购款	60,167,384.88	14,268,873.56	74,436,258.44
2. 基金赎回款	-54,681,094.23	-14,355,254.20	-69,036,348.43
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)	27,098,207.96	6,873,271.42	33,971,479.38
项目	上年度可比期间 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(基金净值)	25,038,714.61	3,940,292.71	28,979,007.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,096,537.84	-4,096,537.84
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)	11,426,650.41	844,858.18	12,271,508.59
其中：1.基金申购款	52,744,758.33	3,397,437.40	56,142,195.73
2.基金赎回款	-41,318,107.92	-2,552,579.22	-43,870,687.14
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)	36,465,365.02	688,613.05	37,153,978.07

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 \_\_\_\_\_

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_ 林勇 \_\_\_\_\_

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_ 龚黎 \_\_\_\_\_

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海金融地产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[2015]937号《关于准予富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华

《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海金融地产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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 878,794,703.90 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(2015)第 702 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 878,920,700.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 125,996.45 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费及销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取前后端认购/申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要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(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、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或票据)、债券回购、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)。基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 0%-95%；投资于金融、房地产行业内的证券和与互联网金融主题相关的证券资产的比例不低于非现金基金资产的 80%；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%。本基金业绩比较基准为：65% × 沪深 300 金融地产指数收益率+ 35% × 中债国债总指数收益率(全价)。

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》、《富兰克林国海金融地产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

本基金本报告期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
----	-------------------

活期存款	4,789,671.59
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	4,789,671.59

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,245,182.12	29,333,712.94	4,088,530.82
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	25,245,182.12	29,333,712.94	4,088,530.82

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	915.52
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1.71
应收债券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.03
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.97
合计	920.23

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	12,144.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,144.33

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	159.58
审计费	39,671.58
账户维护费	9,000.00
合计	48,831.16

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国富金融地产混合 A		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,710,290.08	15,710,290.08
本期申购	1,244,265.16	1,244,265.16
本期赎回(以“-”号填列)	-4,568,033.96	-4,568,033.96

本期末	12,386,521.28	12,386,521.28
-----	---------------	---------------

金额单位：人民币元

国富金融地产混合 C		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,901,627.23	5,901,627.23
本期申购	58,923,119.72	58,923,119.72
本期赎回(以“-”号填列)	-50,113,060.27	-50,113,060.27
本期末	14,711,686.68	14,711,686.68

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

国富金融地产混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	65,659.63	402,858.28	468,517.91
本期利润	556,303.64	2,291,293.50	2,847,597.14
本期基金份额交易产生的变动数	-61,036.15	-554,813.06	-615,849.21
其中：基金申购款	16,973.88	209,177.51	226,151.39
基金赎回款	-78,010.03	-763,990.57	-842,000.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	560,927.12	2,139,338.72	2,700,265.84

单位：人民币元

国富金融地产混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	276,934.02	168,092.30	445,026.32
本期利润	960,886.10	2,237,624.59	3,198,510.69
本期基金份额交易产生的变动数	261,484.31	267,984.26	529,468.57
其中：基金申购款	3,588,111.97	10,454,610.20	14,042,722.17
基金赎回款	-3,326,627.66	-10,186,625.94	-13,513,253.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,499,304.43	2,673,701.15	4,173,005.58

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	31,731.09
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	445.90
其他	283.61
合计	32,460.60

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	10,706,865.42
减：卖出股票成本总额	9,478,504.99
买卖股票差价收入	1,228,360.43

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	20,902.43
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	20,902.43

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	136,799.52

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	115,825.95
减：应收利息总额	71.14
买卖债券差价收入	20,902.43

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	308,507.22
基金投资产生的股利收益	-
合计	308,507.22

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	4,528,918.09
——股票投资	4,528,918.09
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	4,528,918.09

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	291,424.18

基金转换费收入	16.35
合计	291,440.53

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购费补差和转出基金的赎回费组成，其中不低于转出赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	45,217.51
银行间市场交易费用	-
合计	45,217.51

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	-
账户维护费	18,000.00
银行汇划费用	520.00
其他手续费	600.00
律师费	30,000.00
公证费	10,000.00
合计	98,791.58

注：本基金的律师费与公证费用由 2019 年 5 月 6 日召开的基金份额持有人大会产生。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 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。

#### 6.4.9.2 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

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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	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	134,767.82	121,573.08
其中：支付销售机构的客户维护费	85,478.48	92,442.77

注：自2015年11月19日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提(2015年6月9日(基金合同生效日)至2015年11月19日，1.50%)，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 × 0.80% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	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	42,114.94	37,991.52

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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富金融地产混合 A	国富金融地产混合 C	合计
国海富兰克林基金管理有限公司	-	8,727.76	8,727.76
中国银行	-	9,560.82	9,560.82
国海证券	-	2.96	2.96
合计	-	18,291.54	18,291.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富金融地产混合 A	国富金融地产混合 C	合计
国海富兰克林基金管理有限公司	-	1,273.18	1,273.18
中国银行	-	11,053.65	11,053.65
国海证券	-	0.37	0.37
合计	-	12,327.20	12,327.20

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国海富兰克林基金管理有限公司，再由国海富兰克林基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类份额基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

1. 基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
2. 本报告期和上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

- 注：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。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,789,671.59	31,731.09	20,958,391.32	28,400.11

注：本基金的活期银行存款和部分定期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行约定利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配情况。

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

##### **6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本期末未持有因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

##### **6.4.12.2 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。

##### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于债券型基金而低于股票型基金，谋求稳定和可持续的长期收益”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法

去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，主要是发掘各类风险的风险点，判断风险发生的频度和损失，对风险实行分级管理。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的分析报告，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时对各种风险进行监控和评估，并通过风险处置流程，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不

计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流

动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,789,671.59	-	-	-	4,789,671.59
结算备付金	4,012.30	-	-	-	4,012.30
存出保证金	7,346.70	-	-	-	7,346.70
交易性金融资产	-	-	-	29,333,712.94	29,333,712.94
应收利息	-	-	-	920.23	920.23
应收申购款	-	-	-	50,485.48	50,485.48
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,801,030.59	-	-	29,385,118.65	34,186,149.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	117,103.38	117,103.38
应付管理人报酬	-	-	-	22,040.78	22,040.78
应付托管费	-	-	-	6,887.75	6,887.75
应付销售服务费	-	-	-	7,662.46	7,662.46

应付交易费用	-	-	-	12,144.33	12,144.33
其他负债	-	-	-	48,831.16	48,831.16
负债总计	-	-	-	214,669.86	214,669.86
利率敏感度缺口	4,801,030.59	-	-	-29,170,448.79	33,971,479.38
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,507,808.18	-	-	-	12,507,808.18
结算备付金	25,743.94	-	-	-	25,743.94
存出保证金	2,122.75	-	-	-	2,122.75
交易性金融资产	-	-	-	-10,537,844.80	10,537,844.80
应收利息	-	-	-	6,827.20	6,827.20
应收申购款	-	-	-	37,304.46	37,304.46
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,535,674.87	-	-	-10,581,976.46	23,117,651.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	311,817.99	311,817.99
应付管理人报酬	-	-	-	20,127.70	20,127.70
应付托管费	-	-	-	6,289.94	6,289.94
应付销售服务费	-	-	-	5,602.40	5,602.40
应付交易费用	-	-	-	29,098.67	29,098.67
其他负债	-	-	-	219,253.09	219,253.09
负债总计	-	-	-	592,189.79	592,189.79
利率敏感度缺口	12,535,674.87	-	-	-9,989,786.67	22,525,461.54

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2018 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%；投资于金融、房地产行业内的证券和与互联网金融主题相关的证券资产的比例不低于非现金基金资产的 80%；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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	29,333,712.94	86.35	10,537,844.80	46.78
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	29,333,712.94	86.35	10,537,844.80	46.78

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 197	增加约 127
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 197	减少约 127

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 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 29,333,712.94 元，无第二层次和第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 10,302,497.80 元，第二层次 235,347.00 元，无属于第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 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)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	29,333,712.94	85.81
	其中：股票	29,333,712.94	85.81
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	4,793,683.89	14.02
8	其他各项资产	58,752.41	0.17
9	合计	34,186,149.24	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	-	-
C	制造业	2,020,102.00	5.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	692,300.00	2.04
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	781,022.00	2.30
J	金融业	21,748,328.41	64.02
K	房地产业	3,690,566.29	10.86

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	401,394.24	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	29,333,712.94	86.35

### 7.2.2 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。

### 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	600036	招商银行	72,600	2,612,148.00	7.69
2	601318	中国平安	26,668	2,363,051.48	6.96
3	002142	宁波银行	93,060	2,255,774.40	6.64
4	601166	兴业银行	119,600	2,187,484.00	6.44
5	600030	中信证券	73,413	1,747,963.53	5.15
6	601601	中国太保	43,400	1,584,534.00	4.66
7	002271	东方雨虹	66,700	1,511,422.00	4.45
8	000001	平安银行	91,000	1,253,980.00	3.69
9	601688	华泰证券	51,600	1,151,712.00	3.39
10	601398	工商银行	182,100	1,072,569.00	3.16
11	600837	海通证券	74,600	1,058,574.00	3.12
12	600340	华夏幸福	32,500	1,058,525.00	3.12
13	601818	光大银行	260,700	993,267.00	2.92
14	601288	农业银行	225,800	812,880.00	2.39
15	300059	东方财富	57,640	781,022.00	2.30
16	601328	交通银行	126,500	774,180.00	2.28
17	600048	保利地产	56,305	718,451.80	2.11
18	601668	中国建筑	120,400	692,300.00	2.04
19	601211	国泰君安	37,700	691,795.00	2.04
20	601939	建设银行	91,600	681,504.00	2.01

21	000002	万 科 A	24,429	679,370.49	2.00
22	600383	金地集团	52,300	623,939.00	1.84
23	001979	招商蛇口	29,200	610,280.00	1.80
24	600801	华新水泥	25,120	508,680.00	1.50
25	600000	浦发银行	43,400	506,912.00	1.49
26	300284	苏交科	43,488	401,394.24	1.18

## 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	601601	中国太保	1,727,619.00	7.67
2	600036	招商银行	1,681,556.46	7.47
3	600030	中信证券	1,397,547.00	6.20
4	601166	兴业银行	1,362,371.00	6.05
5	601318	中国平安	1,351,688.00	6.00
6	002142	宁波银行	1,202,471.40	5.34
7	002271	东方雨虹	913,019.00	4.05
8	601688	华泰证券	889,537.00	3.95
9	600048	保利地产	816,845.00	3.63
10	600383	金地集团	811,568.00	3.60
11	000002	万 科 A	780,826.00	3.47
12	600340	华夏幸福	747,434.98	3.32
13	000001	平安银行	717,454.00	3.19
14	601818	光大银行	691,731.00	3.07
15	601398	工商银行	673,572.00	2.99
16	600837	海通证券	661,816.00	2.94
17	601668	中国建筑	623,062.00	2.77
18	601390	中国中铁	576,469.00	2.56
19	601288	农业银行	556,289.00	2.47
20	601211	国泰君安	532,503.00	2.36
21	601328	交通银行	519,657.00	2.31
22	300059	东方财富	513,731.00	2.28

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	000002	万科A	865,946.37	3.84
2	600048	保利地产	831,149.70	3.69
3	601390	中国中铁	790,895.00	3.51
4	601186	中国铁建	706,875.00	3.14
5	002146	荣盛发展	675,466.00	3.00
6	601155	新城控股	522,606.00	2.32
7	600036	招商银行	441,289.00	1.96
8	601318	中国平安	432,829.00	1.92
9	600820	隧道股份	358,839.00	1.59
10	002244	滨江集团	348,017.00	1.54
11	600030	中信证券	346,209.35	1.54
12	600585	海螺水泥	338,271.00	1.50
13	000732	泰禾集团	293,867.00	1.30
14	002142	宁波银行	282,730.00	1.26
15	600340	华夏幸福	258,176.00	1.15
16	601688	华泰证券	243,454.00	1.08
17	600837	海通证券	227,660.00	1.01
18	601398	工商银行	227,585.00	1.01
19	600000	浦发银行	222,904.00	0.99
20	000001	平安银行	219,412.00	0.97

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。

## 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	23,745,455.04
卖出股票收入（成交）总额	10,706,865.42

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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	7,346.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	920.23
5	应收申购款	50,485.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,752.41

#### 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

本基金本报告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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国富金融地产混合 A	657	18,853.15	-	-	12,386,521.28	100.00%
国富金融地产混合 C	4,916	2,992.61	3,886,211.72	26.42%	10,825,474.96	73.58%
合计	5,573	4,862.41	3,886,211.72	14.34%	23,211,996.24	85.66%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国富金融地产混合 A	96.76	0.000781%
	国富金融地产混合 C	8.54	0.000058%
	合计	105.30	0.000389%

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国富金融地产混合 A	0
	国富金融地产混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国富金融地产混合 A	0
	国富金融地产混合 C	0
	合计	0



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富金融地产混 合 A	国富金融地产混 合 C
基金合同生效日（2015 年 6 月 9 日）基金份额总额	759,489,619.80	119,431,080.55
本报告期期初基金份额总额	15,710,290.08	5,901,627.23
本报告期间基金总申购份额	1,244,265.16	58,923,119.72
减：本报告期间基金总赎回份额	4,568,033.96	50,113,060.27
本报告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	12,386,521.28	14,711,686.68

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内基金管理人于 2019 年 5 月 6 日召开基金份额持有人大会，表决通过了《《关于修改富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，该决议自该日起生效。

### 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 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

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，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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	11,733,713.51	34.06%	10,927.75	34.75%	-
银河证券	1	6,290,391.98	18.26%	5,858.48	18.63%	-
国信证券	1	5,668,545.00	16.45%	5,279.11	16.79%	-
申万宏源	2	3,020,852.37	8.77%	2,813.23	8.95%	-
太平洋证券	1	2,399,419.00	6.96%	1,754.69	5.58%	-
兴业证券	1	2,196,582.60	6.38%	2,045.68	6.50%	-
长江证券	2	1,590,007.00	4.62%	1,480.82	4.71%	-
东北证券	2	784,806.00	2.28%	573.90	1.82%	-
光大证券	2	592,031.00	1.72%	551.38	1.75%	-
海通证券	2	175,972.00	0.51%	163.86	0.52%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-

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，本基金新增方正证券深圳交易单元 1 个。

### 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	10,475.23	7.26%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	133,752.29	92.74%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 1 月 18 日
2	富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2019 年第 1	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 1 月 19 日

	号)		
3	富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要(2019年第1号)	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年1月19日
4	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金在部分销售机构开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年2月23日
5	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加华宝证券有限责任公司基金申(认)购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年3月20日
6	国海富兰克林基金管理有限公司关于以通讯方式召开富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年3月27日
7	国海富兰克林基金管理有限公司关于以通讯方式召开富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年3月28日
8	富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金2018年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年3月29日
9	富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金2018年年度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年3月29日
10	国海富兰克林基金管理有限公司关于以通讯方式召开富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年3月29日
11	富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金2019年第1季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年4月22日
12	富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金基	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年5月7日

	金合同-2019 年 5 月修订		
13	国海富兰克林基金管理有限 公司 关于富兰克林国海金融地 产灵活配置混合型证券投资 基金基金份额持有人大会表 决结果暨决议生效的公告	中国证监会指定报 刊及公司网站	2019 年 5 月 7 日
14	关于增加嘉实财富管理有限 公司为国海富兰克林基金旗 下部分基金代销机构并开通 转换业务、定期定额投资业 务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报 刊及公司网站	2019 年 5 月 10 日
15	国海富兰克林基金管理有限 公司关于开通直销网上交易 快捷支付业务并进行费用优 惠以及电话交易业务费率优 惠的公告	中国证监会指定报 刊及公司网站	2019 年 5 月 20 日
16	关于增加上海华夏财富投资 管理有限公司为国海富兰克 林基金旗下部分基金代销机 构并开通转换业务、定期定额 投资业务及相关费率优惠活 动的公告	中国证监会指定报 刊及公司网站	2019 年 5 月 29 日
17	国海富兰克林基金管理有限 公司 关于提请投资者及时更新客 户身份基本信息的公告	中国证监会指定报 刊及公司网站	2019 年 6 月 19 日
18	国海富兰克林基金管理有限 公司关于旗下部分基金可参 与科创板投资及相关风险揭 示的公告	中国证监会指定报 刊及公司网站	2019 年 6 月 21 日
19	国海富兰克林基金管理有限 公司旗下部分基金参加中国 银行股份有限公司基金定期 定额投资费率优惠活动的公 告	中国证监会指定报 刊及公司网站	2019 年 6 月 26 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	2019 年 3 月 26 日至 2019 年 4 月 1 日	-	19,888,623.71	19,888,623.71	-	-
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>							

### 11.2 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投资风险，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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海金融地产混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《富兰克林国海金融地产混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《富兰克林国海金融地产混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《富兰克林国海金融地产混合型证券投资基金托管协议》
- 5、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站：[www.ftsfund.com](http://www.ftsfund.com)。

### 12.3 查阅方式

- 1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件。
- 2、登陆基金管理人网站 [www.ftsfund.com](http://www.ftsfund.com) 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

2019年8月28日