富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金

2019 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。

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	国富健康优质生活股票
基金主代码	000761
交易代码	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	367,963,626.86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	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。 1、行业配置策略 (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%。 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。本基金将通过对居民需求变化和行业发展趋势的研究,适时调整健康优质生活主题所覆盖的行业范围。 (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。 2、个股精选策略 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。 3、债券投资策略 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。 4、股指期货投资策略 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。 5、权证投资策略 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。
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

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	38,426.28
本期利润	1,123,677.42
加权平均基金份额本期利润	0.0763
本期基金份额净值增长率	18.57%
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	40,709,595.05
期末基金资产净值	408,673,221.91
期末基金份额净值	1.111

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)。

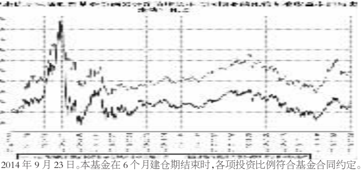
4、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如,开放式基金的申购赎回费等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

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	4.71%	1.03%	4.65%	0.98%	0.06%	0.05%
过去三个月	-3.48%	1.38%	-1.10%	1.29%	-2.38%	0.09%
过去六个月	18.57%	1.37%	22.72%	1.31%	-4.15%	0.06%
过去一年	0.45%	1.41%	8.26%	1.30%	-7.81%	0.11%
过去三年	4.61%	1.11%	18.28%	0.94%	-13.67%	0.17%
自基金合同生效起至今	11.10%	1.84%	53.95%	1.36%	-42.85%	0.48%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金的基金合同生效日为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。

§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		
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

报告期内,经济周期经历了从衰退到复苏,信贷周期从紧到松,科技周期平稳,企业盈利周期平稳,投资者情绪周期由悲观到乐观。A股市场在经历了一季度对过度悲观情绪的纠偏后,二季度重回震荡格局。外部宏观环境的不确定性再次成为影响A股市场中枢的最大变量,贸易摩擦一波三折,国内宏观对冲措施陆续发挥作用,流动性充裕与信用分层并存。权益市场继续分化,漂亮50为代表的"核心资产"已成市场持仓共识,消费和金融行业超额收益明显。债券收益率整体下降,信用分化加剧。

本基金在报告期内的运作中,股票仓位维持在高位,个股持仓以自下而上的选股占绝大部分比例。持仓选择方面主要持有景气回升的行业和成长与估值错配的周期成长股。整体偏向金融、风光伏和地产后周期的消费股,其中地产持仓下降,银行和科技行业持仓上升,食品饮料行业逐步获利了结。整体持仓趋向均衡化。虽然基金重配了消费行业,但在细分行业的配置上表现不理想,重配的家电和地产后周期类消费的表现远远弱于养殖和白酒,是基金跑输基准的主要原因。

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1.111元,本报告期净值增长率为18.57%,同期业绩比较基准增长率为22.72%,本基金跑输业绩比较基准4.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来6个月,中美贸易谈判的进展还会左右市场的节奏和方向,我们对达成一个"休战协议"持乐观态度。但长期来看,贸易摩擦的频率和剧烈程度要比过去10年高一个数量级,资本市场需要适应这种常态化场景。国内方面,传统信贷周期规律正在被打破,背后是政府放弃了以"放松地产和大规模基建刺激"为手段的宏观对冲措施,更重视科技投资、稳定国内消费并化解金融风险。这意味着经济增速的下移,但同时带来了更高质量的增长和更小的宏观风险。

企业层面,中低增速的宏观背景,意味着竞争对手弯道超车的机会越来越少,马太效应、强者恒强,行业龙头企业意味着更低的经营风险和更高的经营增速。对应于A股市场,高质量公司对一般企业的股价超额收益,明显大于不同行业间的超额收益差异。外资的涌入,在交易层面助推了这种情况的延续。在以消费为代表的稳定成长类行业被重估后,深度价值类的金融、地产、汽车等行业的比较优势显现,高成长类行业中的风光伏、云计算、创新药等细分领域高景气延续。"金融+科技"会是本基金的重点关注方向。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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。本报告期内本基金管理人积极开展持续营销,努力落实解决方案。

§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")在对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《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:富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:		
银行存款	182,072,136.03	1,263,772.41
结算备付金	13,901.20	19,695.11
存出保证金	3,640.53	13,244.62
交易性金融资产	382,943,674.25	7,162,647.00
其中:股票投资	382,943,674.25	7,162,647.00
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	15,455.80	321.24
应收股利	-	-
应收申购款	124.83	10,134.81
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	565,048,932.64	8,749,147.74
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负债:		
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	155,894,347.21	-
应付赎回款	9,917.34	-
应付管理人报酬	60,286.09	11,619.00
应付托管费	10,047.66	1,936.47
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	362,336.33	9,880.32
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	38,776.10	132,000.00
负债合计	156,375,710.73	155,435.79
所有者权益:		
实收基金	367,963,626.86	9,175,287.22
未分配利润	40,709,595.05	-581,575.27
所有者权益合计	408,673,221.91	8,593,711.95
负债和所有者权益总计	565,048,932.64	8,749,147.74

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.111元,基金份额总额367,963,626.86份。

6.2 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: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	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	1,737,165.63	-2,878,979.30
1.利息收入	20,071.16	33,611.03
其中:存款利息收入	20,071.16	31,201.14
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)	629,333.89	-140,027.54
其中:股票投资收益	344,539.36	-338,459.62
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	284,794.53	191,809.84
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	1,085,251.14	-2,837,092.50
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,509.44	64,529.71
减:二、费用	613,488.21	775,305.00
1.管理人报酬	118,502.08	359,358.73
2.托管费	19,750.36	59,893.08
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	425,007.99	273,330.45
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	50,227.78	82,722.57
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	1,123,677.42	-3,654,284.30
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	1,123,677.42	-3,654,284.30

6.3 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: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)	9,175,287.22	-581,575.27	8,593,711.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,123,677.42	1,123,677.42
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)	358,788,339.64	40,167,492.90	398,955,832.54
其中:1.基金申购款	360,213,837.27	40,314,323.55	400,528,160.82
2.基金赎回款	-1,425,497.63	-146,830.65	-1,572,328.28
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)	367,963,626.86	40,709,595.05	408,673,221.91
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)	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)	-	-3,654,284.30	-3,654,284.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	14,210,346.24	3,777,179.81	17,987,526.05
其中:1.基金申购款	37,200,618.50	8,459,241.89	45,659,860.39
2.基金赎回款	-22,990,272.26	-4,682,062.08	-27,672,334.34
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)	25,536,985.97	2,705,627.23	28,242,613.20

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%。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×85%+中债国债总指数(全价)收益率×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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

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。

6.4.8.1.2 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。

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	118,502.08	359,358.73
其中:支付销售机构的客户维护费	31,563.48	39,556.05

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1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的托管费	19,750.36	59,893.08

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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

1.基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

2.本报告期和上年度可比期间(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。

6.4.8.4.2 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	182,072,136.03	11,824.69	4,964,562.65	29,367.93

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

6.4.8.7 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。

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

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。

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382,943,674.25元,无属于第二层次及第三层次的余额(2018年12月31日:第一层次7,162,647.00元,无第二或第三层次)。

(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	382,943,674.25	67.77
	其中:股票	382,943,674.25	67.77
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	182,086,037.23	32.22
8	其他各项资产	19,221.16	0.00
9	合计	565,048,932.64	100.00

注:鉴于部分资产占基金总资产的比例过于微小,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"。

7.2 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	5,582,364.03	1.37
B	采矿业	12,311,248.00	3.01
C	制造业	149,449,679.29	36.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,711,494.00	2.13
E	建筑业	11,636,248.00	2.85
F	批发和零售业	5,533,727.00	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	11,593,725.00	2.84
H	住宿和餐饮业	179,800.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,247,742.25	3.49
J	金融业	136,415,594.00	33.38
K	房地产业	17,235,562.00	4.22
L	租赁和商务服务业	5,331,074.00	1.30
M	科学研究和技术服务业	260,040.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	451,041.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,026,630.68	0.50
R	文化、体育和娱乐业	1,977,705.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	382,943,674.25	93.70

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	601318	中国平安	313,400	27,770,374.00	6.80
2	600519	贵州茅台	15,300	15,055,200.00	3.68
3	600036	招商银行	417,700	15,028,846.00	3.68
4	601166	兴业银行	473,800	8,665,802.00	2.12
5	000651	格力电器	152,300	8,376,500.00	2.05
6	000333	美的集团	142,452	7,387,560.72	1.81
7	000858	五粮液	58,400	6,888,280.00	1.69
8	600276	恒瑞医药	95,400	6,296,400.00	1.54
9	600887	伊利股份	187,200	6,254,352.00	1.53
10	600030	中信证券	237,000	5,642,970.00	1.38
11	601939	建设银行	695,000	5,170,800.00	1.27
12	601328	交通银行	843,700	5,163,444.00	1.26
13	000001	平安银行	368,400	5,076,552.00	1.24
14	600016	民生银行	765,500	4,860,925.00	1.19
15	601398	工商银行	814,000	4,794,460.00	1.17
16	601288	农业银行	1,187,900	4,276,440.00	1.05
17	600000	浦发银行	362,900	4,238,672.00	1.04
18	000002	万科A	150,300	4,179,843.00	1.02
19	300498	温氏股份	114,100	4,091,626.00	1.00
20	601668	中国建筑	649,500	3,734,625.00	0.91
21	600900	长江电力	205,000	3,669,500.00	0.90
22	601601	中国太保	97,500	3,559,725.00	0.87
23	600837	海通证券	246,600	3,499,254.00	0.86
24	002415	海康威视	120,400	3,320,632.00	0.81
25	600048	保利地产	219,600	2,802,096.00	0.69
26	600104	上汽集团	108,700	2,771,850.00	0.68
27	601169	北京银行	458,900	2,712,099.00	0.66
28	002304	洋河股份	22,200	2,698,632.00	0.66
29	601888	中国国旅	29,800	2,641,770.00	0.65
30	603288	海天味业	24,580	2,580,900.00	0.63
31	601211	国泰君安	137,700	2,526,795.00	0.62
32	600585	海螺水泥	60,800	2,523,200.00	0.62
33	000725	京东方A	726,300	2,498,472.00	0.61
34	601688	华泰证券	110,800	2,473,056.00	0.61
35	601766	中国中车	299,300	2,421,337.00	0.59
36	600009	上海机场	28,900	2,421,242.00	0.59
37	300059	东方财富	176,415	2,390,423.25	0.58
38	600031	三一重工	182,100	2,381,868.00	0.58
39	000063	中兴通讯	70,600	2,296,618.00	0.56
40	600028	中国石化	413,600	2,262,392.00	0.55
41	601012	隆基股份	92,200	2,130,742.00	0.52
42	600340	华夏幸福	64,600	2,104,022.00	0.51
43	601088	中国神华	102,700	2,093,026.00	0.51
44	600309	万华化学	47,900	2,049,641.00	0.50
45	601229	上海银行	170,000	2,014,500.00	0.49
46	600690	海尔智家	112,000	1,936,480.00	0.47
47	002142	宁波银行	79,300	1,922,232.00	0.47
48	601818	光大银行	496,700	1,892,427.00	0.46
49	000338	潍柴动力	148,400	1,823,836.00	0.45
50	600019	宝钢股份	273,400	1,777,100.00	0.43
51	002475	立讯精密	71,200	1,765,048.00	0.43
52	600050	中国联通	281,900	1,736,504.00	0.42
53	601857	中国石油	250,300	1,722,064.00	0.42
54	000568	泸州老窖	21,100	1,705,513.00	0.42
55	002027	分众传媒	317,800	1,681,162.00	0.41
56	601989	中国重工	289,200	1,607,952.00	0.39
57	600919	江苏银行	214,700	1,558,722.00	0.38
58	601933	永辉超市	149,200	1,523,332.00	0.37
59	601009	南京银行	183,600	1,516,536.00	0.37
60	002202	金风科技	122,000	1,516,460.00	0.37
61	601390	中国中铁	232,500	1,515,900.00	0.37
62	601006	大秦铁路	186,700	1,510,403.00	0.37
63	001979	招商蛇口	72,250	1,510,025.00	0.37
64	600999	招商证券	88,100	1,505,629.00	0.37
65	002230	科大讯飞	45,100	1,499,124.00	0.37
66	002714	牧原股份	25,357	1,490,738.03	0.36
67	601628	中国人寿	50,700	1,435,824.00	0.35
68	600406	国电南瑞	76,400	1,424,096.00	0.35
69	000661	长春高新	4,200	1,419,600.00	0.35
70	002594	比亚迪	27,800	1,410,016.00	0.35
71	601186	中国铁建	141,700	1,409,915.00	0.34
72	000166	申万宏源	278,200	1,393,782.00	0.34
73	601336	新华保险	25,300	1,392,259.00	0.34
74	601899	紫金矿业	366,900	1,383,213.00	0.34
75	002024	苏宁易购	114,600	1,315,608.00	0.32
76	600570	恒生电子	19,200	1,308,480.00	0.32
77	000538	云南白药	15,400	1,284,668.00	0.31
78	000776	广发证券	90,700	1,246,218.00	0.30
79	601669	中国电建	235,000	1,243,150.00	0.30
80	600352	浙江龙盛	76,000	1,198,520.00	0.29
81	300015	爱尔眼科	38,044	1,178,222.68	0.29
82	600958	东方证券	109,600	1,170,528.00	0.29
83	601225	陕西煤业	123,400	1,140,216.00	0.28
84	000100	TCL集团	335,700	1,117,881.00	0.27
85	000876	新希望	63,800	1,108,206.00	0.27
86	300142	沃森生物	38,600	1,094,696.00	0.27
87	600436	片仔癀	9,200	1,059,840.00	0.26
88	600741	华域汽车	49,000	1,058,400.00	0.26
89	600588	用友网络	38,700	1,040,256.00	0.25
90	601155	新城控股	26,100	1,039,041.00	0.25
144	600100	同方股份	73,600	666,080.00	0.16
145	600018	上港集团	97,000	661,540.00	0.16
146	002508	老板电器	24,000	651,360.00	0.16
147	000425	徐工机械	144,800	645,808.00	0.16
148	601607	上海医药	35,300	640,695.00	0.16
149	300033	同花顺	6,500	639,340.00	0.16
150	002352	顺丰控股	18,800	638,448.00	0.16
151	600893	航发动力	28,100	638,151.00	0.16
152	300017	网宿科技	58,800	633,864.00	0.16
153	300408	三环集团	31,100	604,895.00	0.15
154	601919	中远海控	120,300	603,906.00	0.15
155	600176	中国巨石	63,330	603,534.90	0.15
156	002271	东方雨虹	26,600	602,756.00	0.15
157	601877	正泰电器	26,000	600,340.00	0.15
158	601727	上海电气	111,200	598,256.00	0.15
159	600498	烽火通信	21,400	596,204.00	0.15
160	600004	白云机场	32,000	582,400.00	0.14
161	600867	通化东宝	37,300	574,420.00	0.14
162	600023	浙能电力	129,000	570,180.00	0.14
163	601998	中信银行	94,900	566,553.00	0.14
164	000423	东阿阿胶	14,100	561,462.00	0.14
165	002460	赣锋锂业	23,821	558,126.03	0.14
166	600489	中金黄金	54,300	557,661.00	0.14
167	601018	宁波港	122,000	535,580.00	0.13
168	600809	山西汾酒	7,734	534,032.70	0.13
169	600068	葛洲坝	85,400	532,042.00	0.13
170	600066	宇通客车	40,800	531,216.00	0.13
171	600170	上海建工	141,000	530,160.00	0.13
172	600926	杭州银行	63,500	528,955.00	0.13
173	603899	晨光文具	12,000	527,640.00	0.13
174	002673	西部证券	52,200	526,176.00	0.13
175	002466	天齐锂业	20,800	525,824.00	0.13
176	002179	中航光电	15,700	525,322.00	0.13
177	601997	贵阳银行	60,400	522,460.00	0.13
178	300024	机器人	34,300	522,389.00	0.13
179	002602	世纪华通	47,700	520,884.00	0.13
180	002081	金螳螂	50,400	519,624.00	0.13
181	600219	南山铝业	227,900	515,054.00	0.13
182	002241	歌尔股份	57,100	507,619.00	0.12
183	600362	江西铜业	31,600	497,384.00	0.12
184	601021	春秋航空	11,000	495,000.00	0.12
185	600398	海澜之家	54,500	494,315.00	0.12
186	603156	养元饮品	13,300	493,164.00	0.12
187	600085	同仁堂	17,000	493,000.00	0.12
188	300144	宋城演艺	21,300	492,882.00	0.12
189	000630	铜陵有色	200,200	492,492.00	0.12
190	000961	中南建设	56,800	491,888.00	0.12
191	601198	东兴证券	41,300	490,644.00	0.12
192	002739	万达电影	26,500	488,660.00	0.12
193	601838	成都银行	55,300	488,299.00	0.12
194	002146	荣盛发展	52,000	488,280.00	0.12
195	000786	北新建材	26,900	487,697.00	0.12
196	600674	川投能源	54,700	486,830.00	0.12
197	000728	国元证券	52,900	485,093.00	0.12
198	600482	中国动力	20,300	479,486.00	0.12
199	600297	广汇汽车	103,900	463,394.00	0.11
200	601881	中国银河	37,700	461,825.00	0.11
201	000703	恒逸石化	33,800	461,708.00	0.11
202	002493	荣盛石化	37,600	453,456.00	0.11
203	601138	工业富联	37,500	451,875.00	0.11
204	000629	攀钢钒钛	133,100	451,209.00	0.11
205	300070	碧水源	57,900	451,041.00	0.11
206	603986	兆易创新	5,200	450,840.00	0.11
207	002555	三七互娱	33,200	449,860.00	0.11
208	600535	天士力	27,100	448,505.00	0.11
209	002050	三花智控	42,090	444,049.50	0.11
210	603799	华友钴业	19,800	421,938.00	0.10
211	600663	陆家嘴	27,200	421,600.00	0.10
212	603833	欧派家居	3,900	419,718.00	0.10
213	300296	利亚德	53,100	415,773.00	0.10
214	000596	古井贡酒	3,500	414,785.00	0.10
215	600369	西南证券	83,600	412,984.00	0.10
216	002624	完美世界	16,000	412,960.00	0.10
217	000627	天茂集团	63,600	412,764.00	0.10
218	000656	金科股份	68,300	411,849.00	0.10
219	002065	东华软件	58,800	411,012.00	0.10
220	600118	中国卫星	18,200	410,410.00	0.10
221	600516	XR方大炭	32,200	395,738.00	0.10
222	300136	信维通信	15,800	386,310.00	0.09
223	601992	金隅集团	101,900	383,144.00	0.09
224	600153	建发股份	42,900	380,952.00	0.09
225	600027	华电国际	100,600	379,262.00	0.09

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

263	601360	三六零	264,694.00	3.08
264	002773	康弘药业	263,487.00	3.07
265	000898	鞍钢股份	261,917.00	3.05
266	002876	三利谱	260,991.00	3.04
267	603259	药明康德	260,375.00	3.03
268	000938	紫光股份	229,180.00	2.67
269	600372	中航电子	227,859.00	2.65
270	600025	华能水电	227,492.00	2.65
271	601228	广州港	227,411.00	2.65
272	002411	延安必康	227,047.00	2.64
273	000415	渤海租赁	226,841.00	2.64
274	600998	九州通	226,168.00	2.63
275	002468	申通快递	225,338.00	2.62
276	600339	中油工程	225,069.00	2.62
277	002250	联化科技	217,513.00	2.53
278	300146	汤臣倍健	205,800.00	2.39
279	000830	鲁西化工	203,180.00	2.36
280	600258	首旅酒店	196,191.00	2.28
281	601098	中南传媒	195,266.00	2.27
282	002572	索菲亚	189,600.00	2.21
283	601808	中海油服	188,647.00	2.20
284	600612	老凤祥	187,400.00	2.18
285	300253	卫宁健康	184,400.00	2.15
286	000681	视觉中国	178,102.00	2.07

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	601398	工商银行	686,157.00	7.98
2	000902	新洋丰	536,176.00	6.24
3	000002	万科A	531,366.00	6.18
4	603711	香飘飘	507,105.00	5.90
5	300253	卫宁健康	506,064.34	5.89
6	002405	四维图新	468,337.00	5.45
7	601098	中南传媒	458,708.00	5.34
8	002129	中环股份	455,700.00	5.30
9	002876	三利谱	428,214.00	4.98
10	300296	利亚德	420,384.00	4.89
11	600104	上汽集团	411,669.00	4.79
12	002304	洋河股份	410,645.00	4.78
13	000681	视觉中国	380,245.00	4.42
14	601688	华泰证券	380,190.00	4.42
15	601888	中国国旅	379,197.00	4.41
16	002230	科大讯飞	377,000.00	4.39
17	600886	国投电力	329,337.00	3.83
18	300009	安科生物	314,313.00	3.66
19	600718	东软集团	309,500.00	3.60
20	002035	华帝股份	308,303.00	3.59
21	002341	新纶科技	278,000.00	3.23
22	002572	索菲亚	264,757.00	3.08
23	002202	金风科技	264,718.82	3.08
24	300251	光线传媒	252,500.00	2.94
25	600004	白云机场	236,033.00	2.75
26	600038	中直股份	225,099.00	2.62
27	002250	联化科技	222,425.00	2.59
28	600456	宝钛股份	219,000.00	2.55
29	002271	东方雨虹	218,000.00	2.54
30	601818	光大银行	207,500.00	2.41
31	600298	安琪酵母	203,000.00	2.36
32	002044	美年健康	201,600.00	2.35
33	300498	温氏股份	200,507.00	2.33
34	300146	汤臣倍健	188,284.00	2.19
35	600036	招商银行	187,550.00	2.18
36	300443	金雷股份	182,086.00	2.12
37	000830	鲁西化工	180,867.00	2.10
38	002415	海康威视	175,830.00	2.05

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	388,732,836.76
卖出股票收入(成交)总额	14,381,600.01

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同,本基金不投资贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同,本基金不投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,640.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,455.80
5	应收申购款	124.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,221.16

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

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
686	536,390.13	359,710,431.66	97.76%	8,253,195.20	2.24%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	4.15	0.000001%

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(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	9,175,287.22
本报告期期间基金总申购份额	360,213,837.27
减:本报告期期间基金总赎回份额	1,425,497.63
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	367,963,626.86

§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

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

(一)基金管理人及高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形:

本报告期内,基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

(二)基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

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	
光大证券	2	151,973,107.77	37.70%	141,533.11	37.75%	-
中泰证券	1	110,909,042.52	27.52%	103,289.52	27.55%	-
海通证券	2	69,808,486.11	17.32%	65,012.67	17.34%	-
申万宏源	2	54,026,657.20	13.40%	50,315.32	13.42%	-
东方证券	2	6,563,010.74	1.63%	6,112.12	1.63%	-
银河证券	1	2,687,834.00	0.67%	2,503.20	0.67%	-
兴业证券	1	2,537,045.82	0.63%	2,362.71	0.63%	-
太平洋证券	1	1,916,301.85	0.48%	1,401.39	0.37%	-
国信证券	1	776,593.00	0.19%	723.25	0.19%	-
长江证券	2	724,244.00	0.18%	674.53	0.18%	-
东北证券	2	359,183.00	0.09%	262.67	0.07%	-
瑞银证券	1	303,599.00	0.08%	282.73	0.08%	-
华创证券	1	272,367.76	0.07%	253.66	0.07%	-
方正证券	2	203,000.00	0.05%	148.47	0.04%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	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
光大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

§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6月27日至2019年6月30日	-	179,855,215.83	-	179,855,215.83	48.88%
	2	2019年6月27日至2019年6月30日	-	179,855,215.83	-	179,855,215.83	48.88%
产品特有风险							
1.流动性风险 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。 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。 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。 该基金投资者集中度较高,管理人将积极通过持续营销优化持有人结构,审慎办理大额申购和赎回。 2.估值风险 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。							

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