

富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金
2017 年半年度报告摘要
2017 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：2017 年 8 月 25 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 2017 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 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	国富亚洲机会股票（QDII）
基金主代码	457001
交易代码	457001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 2 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	409,520,604.56 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是通过投资在亚洲地区（不包括日本）证券市场进行交易以及公司总部或经营范围在亚洲地区（不包括日本）的上市公司以实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金在投资过程中首先强调亚洲国家和地区上市公司的品质与成长性的结合。采取“自下而上”的选股策略，注重个股成长性指标分析，挖掘拥有更佳成长特性的公司，构建股票池。同时，在亚洲国家和地区经济发展格局下，注重各区域市场环境、政经前景分析，甄别不同亚洲国家与地区、行业与板块的投资机会，优先考虑国家与地区的资产配置，决定行业与板块的基本布局，并从中筛选出具有国际比较优势的优质上市公司。最后通过深入的投资价值评估，形成优化的投资组合。</p> <p>在固定收益类投资部分，其资产布局坚持安全性、流动性和收益性为资产配置原则，并结合现金管理、货币市场工具等来制订具体策略。</p>
业绩比较基准	MSCI 亚洲（除日本）净总收益指数
风险收益特征	本基金为区域性股票型证券投资基金，基金预期投资风险收益水平高于混合型基金和债券型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的基金品种。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	林葛
	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 和 021-38789555	95599
传真		021-6888 3050	010-6812 1816

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Franklin Advisers, Inc. ,	JP Morgan Chase Bank, National Association
	中文	富兰克林顾问公司	摩根大通银行
注册地址		1 Franklin Parkway, San Mateo, CA, USA	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH, USA
办公地址		1 Franklin Parkway, San Mateo, CA, USA	270 Park Avenue, New York, New York ,USA
邮政编码		94403	10017

2.5 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	20,754,200.83
本期利润	39,265,889.25
加权平均基金份额本期利润	0.0974
本期基金份额净值增长率	11.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0507
期末基金资产净值	388,755,252.59
期末基金份额净值	0.949

注：

1. 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则一第1号《主要财务指标的计算及披露》。
2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。
4. 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

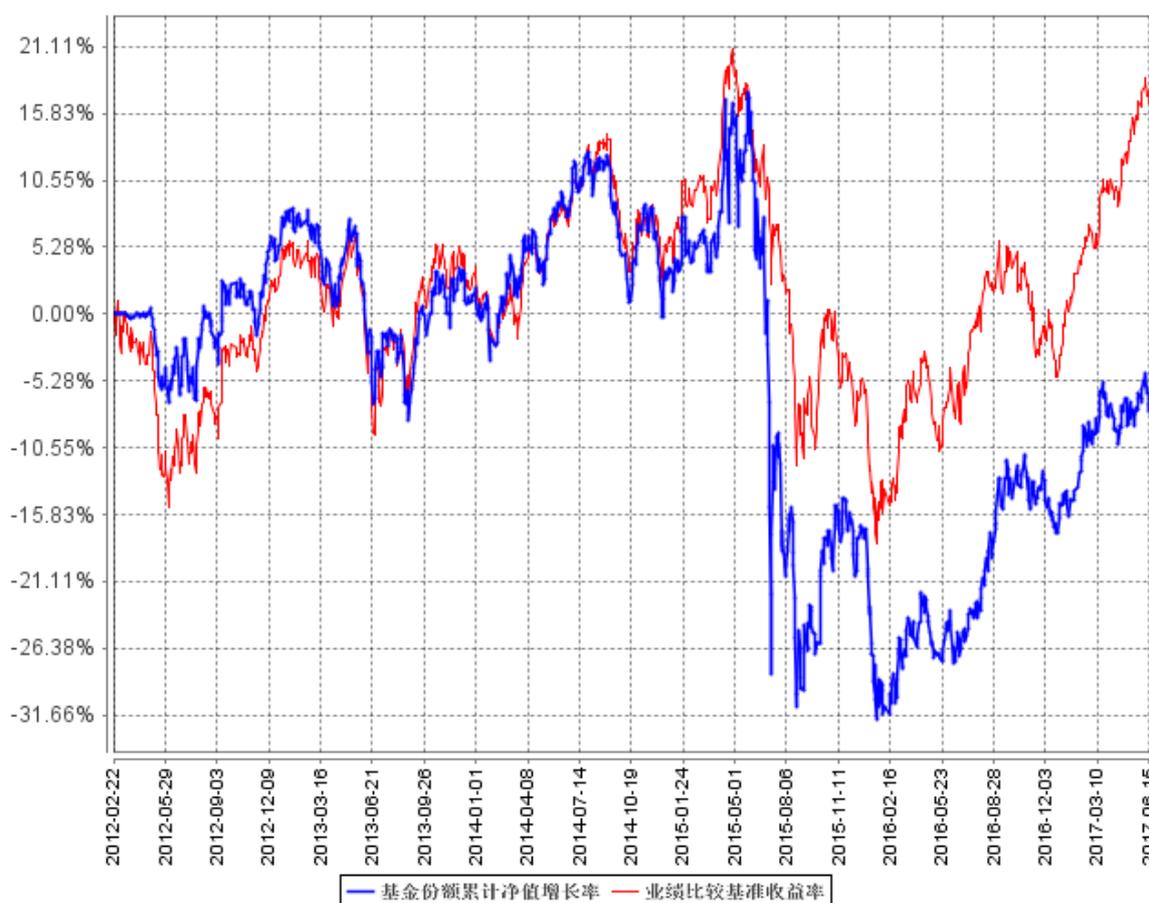
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.71%	0.75%	1.12%	0.50%	0.59%	0.25%
过去三个月	2.48%	0.73%	7.45%	0.53%	-4.97%	0.20%
过去六个月	11.65%	0.74%	21.59%	0.53%	-9.94%	0.21%
过去一年	27.04%	0.84%	24.16%	0.70%	2.88%	0.14%

过去三年	-13.41%	1.52%	7.91%	0.89%	-21.32%	0.63%
自基金合同生效起至今	-5.10%	1.24%	17.64%	0.88%	-22.74%	0.36%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2012 年 2 月 22 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国海富兰克林基金管理有限公司成立于 2004 年 11 月，由国海证券股份有限公司和富兰克林邓普顿投资集团全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建，目前公司注册资本 2.2 亿元人民币，国海证券股份有限公司持有 51% 的股份，邓普顿国际股份有限公司持有 49% 的股份。

国海证券股份有限公司是国内 A 股市场第 16 家上市券商，是拥有全业务牌照，营业网点遍布中国主要城市的全国性综合类证券公司。富兰克林邓普顿投资集团是世界知名基金管理公司，在全球市场上有 70 年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿投资集团享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系，借助国海证券股份有限公司的综合业务优势，力争成为国内一流的基金管理公司。

本公司具有丰富的管理基金经验。自 2005 年 6 月第一只基金成立开始，截至本报告期末，本公司已经成功管理了 31 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）基金及国富美元债定期债券（QDII）基金的基金经理	2015 年 12 月 24 日	-	11 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）基金及国富美元债定期债券（QDII）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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职位	证券从业年限	说明
斯蒂芬多佛 (Stephen H. Dover)	董事总经理和国际首席投资官	32	负责韩国、巴西和印度地区管理和销售的基金产品和其他受托管理资产的投资，以及富兰克林名下的亚洲股权类成长性投资产品的投资。他也是国海富兰克林基金管理有限公司投资团队的顾问。
苏库玛拉贾 (Sukumar Rajah)	常务董事和亚洲权益资本的首席投资官	26	负责印度权益类投资团队，并管理印度国内的富兰克林权益类基金、富兰克林印度基金和印度以外的机构账户。

4.3 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《富兰克林国海亚洲（除日本）机会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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配，信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》，严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金策略以投资香港中小盘股票为主；目前，香港市场估值较低，特别是一些中小盘的成长股（PEG 大多在 1x 一下），颇具投资价值。同时，本基金也逐步买入优质、估值合理的台湾科技股，这些企业有望得益于行业发展所带来的新机遇。

行业配置上，主要超配了互联网、科技、新能源和环保、保险以及大消费等板块；对必选消费品较为谨慎。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.949 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.65%，业绩比较基准收益率为 21.59%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济处于转型期，新经济方兴未艾、未来发展的空间较大；老经济获益于供给侧改革，中长期来看核心企业盈利能力有望逐步得到改善。中报业绩有望总体好于预期。

尽管目前港股市场已有不错涨幅，但是估值仍不高（市盈率低于美国、欧洲以及亚洲其它市场）。相对于 A 股，港股在平均估值上仍有优势。台湾市场上半年也有所涨幅，但是有核心竞争力的企业仍将获得较好盈利增长，且支撑股价表现。

2017 年下半年，美联储可能继续加息，并可能逐步推进“缩表”；此外，欧洲经济也有望延续其复苏的步伐。因此，全球再次大规模货币放松的可能性不大。但是，港股通的资金仍值得关注，南下的资金可能仍将给估值较低的香港市场带来支撑。

我们将关注有结构性增长机会的行业，如互联网、科技、教育、大消费、医药以及清洁能源等；同时，也将继续关注得益于供给侧改革、盈利有望改善的“旧经济”。

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。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会（简称“估值委员会”），并已制订了《公允估值管理办法》。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由总经理或其任命者负责，成员包括投研、风险控制、监察稽核、交易、基金核算方面的部门主管，相关人员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行过利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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：富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	54,377,779.58	110,060,158.46
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	330,545,118.28	221,809,952.33
其中：股票投资	330,545,118.28	221,809,952.33
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	9,789,024.59	-
应收利息	197.75	262.95
应收股利	1,598,123.13	-
应收申购款	44,019.98	5,812.74
递延所得税资产	-	-
其他资产	9,773,603.90	3,704,480.88
资产总计	406,127,867.21	335,580,667.36
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017 年 6 月 30 日	2016 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	6,176,413.65	3,704,480.88
应付赎回款	422,664.37	278,925.18
应付管理人报酬	572,874.89	495,644.08
应付托管费	111,392.31	96,375.24
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	16.19	-

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	10,089,253.21	3,917,040.76
负债合计	17,372,614.62	8,492,466.14
所有者权益：		
实收基金	409,520,604.56	384,971,327.71
未分配利润	-20,765,351.97	-57,883,126.49
所有者权益合计	388,755,252.59	327,088,201.22
负债和所有者权益总计	406,127,867.21	335,580,667.36

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.949 元，基金份额总额 409,520,604.56 份。

6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	45,387,444.09	5,977,130.12
1.利息收入	8,032.54	9,414.86
其中：存款利息收入	8,032.54	9,414.86
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	27,834,076.75	-81,858.16
其中：股票投资收益	24,326,491.41	-1,660,247.32
基金投资收益	-	-42,342.65
债券投资收益	-	-
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	3,507,585.34	1,620,731.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”	18,511,688.42	5,653,769.69

”号填列)		
4.汇兑收益（损失以“-”号填列)	-976,105.58	394,955.53
5.其他收入（损失以“-”号填列)	9,751.96	848.20
减：二、费用	6,121,554.84	1,807,947.28
1. 管理人报酬	3,269,352.53	667,693.77
2. 托管费	635,707.36	129,829.40
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,009,873.20	852,779.33
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	206,621.75	157,644.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)	39,265,889.25	4,169,182.84
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)	39,265,889.25	4,169,182.84

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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)	384,971,327.71	-57,883,126.49	327,088,201.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润)	-	39,265,889.25	39,265,889.25
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)	24,549,276.85	-2,148,114.73	22,401,162.12
其中：1.基金申购款	33,544,601.14	-2,940,475.77	30,604,125.37
2.基金赎回款	-8,995,324.29	792,361.04	-8,202,963.25

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）	409,520,604.56	-20,765,351.97	388,755,252.59
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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）	8,748,215.72	-1,481,082.69	7,267,133.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	4,169,182.84	4,169,182.84
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）	341,882,131.78	-91,282,820.66	250,599,311.12
其中：1.基金申购款	343,136,155.94	-91,609,843.16	251,526,312.78
2.基金赎回款	-1,254,024.16	327,022.50	-927,001.66
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）	350,630,347.50	-88,594,720.51	262,035,626.99

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

胡昕彦

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

富兰克林国海亚洲(除日本)机会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”)证监许可字[2011]第1380号《关于同意富兰克林国海亚洲

(除日本)机会股票型证券投资基金募集的批复》核准，由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海亚洲(除日本)机会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人民币 327,681,782.17 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 28 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 2 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 327,738,555.14 份，其中认购资金利息折合 56,772.97 份基金份额，划入基金份额持有人账户。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司，境外托管人为摩根大通银行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》，《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票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银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；境外证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品；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：股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例不低于 60%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%(若法律法规变更或取消本限制的，则本基金按变更或取消后的规定执行)。本基金的业绩比较基准为：MSCI 亚洲(除日本)净总收益指数(MSCI AC Asia ex Japan Index(Net Total Return))。

本财务报表由本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于 2017 年 8 月 25 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》、《富兰克林国海亚洲(除日本)机会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。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

会计年度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

会计政策变更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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税（于 2016 年 5 月 1 日前）或增值税（自 2016 年 5 月 1 日起）且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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、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
摩根大通银行（J.P. Morgan Chase & Co.）	基金境外资产托管人

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,269,352.53	667,693.77
其中：支付销售机构的客户维护费	69,022.20	23,077.30

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

1.8%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 × 1.8% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	635,707.36	129,829.40

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 0.35% 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 × 0.35% / 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、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（2016 年 1 月 1 日至 2016 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（2016 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
农业银行	1,031,066.42	8,032.40	178,947.19	1,014.62
摩根大通银行	53,346,713.16	0.13	56,436,545.90	-
合计	54,377,779.58	8,032.53	56,615,493.09	1,014.62

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国农业银行和境外资产托管人摩根大通银行保管，按适用利率或约定利率计息。

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（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有流通受限的证券。

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 2017 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 330,545,118.28 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 221,809,952.33 元，无第二、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 2017 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(2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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	330,545,118.28	81.39
	其中：普通股	320,158,344.00	78.83
	存托凭证	10,386,774.28	2.56
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	54,377,779.58	13.39
8	其他各项资产	21,204,969.35	5.22
9	合计	406,127,867.21	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 24,232.33 元，占资产净值比例为 0.01%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
香港	227,345,742.16	58.48
台湾	66,463,465.83	17.10
美国	24,294,725.87	6.25
韩国	12,441,184.42	3.20
英国	-	-
卢森堡	-	-
马来西亚	-	-

泰国	-	-
印度尼西亚	-	-
新加坡	-	-
合计	330,545,118.28	85.03

注：以上国家（地区）均按照股票及存托凭证上市交易地点进行统计。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
材料	-	-
电信服务	8,356,333.76	2.15
信息技术	158,611,624.61	40.80
非必需消费品	44,841,872.27	11.53
必需消费品	-	-
能源	-	-
保健	11,730,476.90	3.02
金融	54,733,135.58	14.08
工业	31,424,900.72	8.08
公用事业	20,846,774.44	5.36
合计	330,545,118.28	85.03

注：以上分类采用 GICS 行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	Chinasoft International Ltd	中软国际	BBG000KV JJD2	香港联合交易所	香港	4,718,000	16,952,664.76	4.36
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	BBG000BJ 35N5	香港联合交易所	香港	66,000	15,993,335.43	4.11
3	China Pacific Insurance Group	中国太平洋保险	BBG000KV B7C7	香港联合交易所	香港	521,200	14,430,280.94	3.71
4	Grand Baoxin Auto Group Ltd	宝信汽车	BBG0029C PT53	香港联合交易所	香港	4,256,500	13,853,630.55	3.56
5	China Yongda Auto Mobiles	永达汽车	BBG002ZF X5C2	香港联合交易所	香港	1,981,000	13,668,828.68	3.52

	Servive Group							
6	LandMark Optoelectronics Corp	联亚光电	BBG006RZ Z2N1	台湾证券交易所	台湾	174,000	13,482,447.62	3.47
7	China Everbright International Group	光大国际	BBG000BC 11N1	香港联合交易所	香港	1,591,000	13,449,583.41	3.46
8	JuTeng International Holdings	巨腾国际控股	BBG000FL KNV9	香港联合交易所	香港	4,704,000	13,064,626.18	3.36
9	Huaneng Renewables Corp Ltd	华能新能源	BBG0019P DFM0	香港联合交易所	香港	6,159,500	12,883,747.31	3.31
10	Samsung Electronics Co., Ltd	三星电子	BBG000BC Y2S8	韩国证券交易所	韩国	884	12,441,184.42	3.20
11	Silergy Corporation	矽力杰半导体	BBG004YZ 9NS6	台湾证券交易所	台湾	92,000	12,003,991.87	3.09
12	Geely Automobile Holdings Ltd	吉利汽车	BBG000BZ 3PX4	香港联合交易所	香港	785,000	11,473,381.65	2.95
13	China Railway Signal & Communication Corp	中国通号	BBG009PV 3Q21	香港联合交易所	香港	2,118,000	11,066,292.45	2.85
14	Largan Precision Co Ltd	大立光电	BBG000HL SVV1	台湾证券交易所	台湾	10,000	10,798,961.38	2.78
15	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	BBG006G2 JVL2	纽约证券交易所	美国	10,410	9,936,479.91	2.56
16	Kingdee International Software Group	金蝶国际软件	BBG000FQ H8C6	香港联合交易所	香港	3,314,000	9,347,932.36	2.40
17	New China Life Insurance Co Ltd	新华保险	BBG0028V Y3J4	香港联合交易所	香港	257,600	8,875,974.82	2.28
18	Ping An Insurance Group Co of China	平安保险集团	BBG000GD 4N44	香港联合交易所	香港	197,000	8,796,933.35	2.26
19	China Taiping Insurance Group	中国太平保险	BBG000BY 28H4	香港联合交易所	香港	510,000	8,755,403.38	2.25
20	China Unicom Hong Kong Ltd	中国联通香港	BBG000DZ 05Z7	香港联合交易所	香港	830,000	8,356,333.76	2.15
21	Taiwan Union Technology Corporation	台湾联合科技	BBG000LL H1T7	台湾证券交易所	台湾	663,000	8,237,358.68	2.12
22	Beijing	北控水	BBG000BD	香港联合	香港	1,514,	7,963,0	2.05

	Enterprises Water Group	务集团	W6Y2	交易所		000	27.13	
23	United Laboratories International Holdings Ltd	联邦制药	BBG000JZ6DW1	香港联合交易所	香港	1,668,000	7,455,606.38	1.92
24	China Jinmao Holdings Group Limited	中国金茂集团	BBG000BYML92	香港联合交易所	香港	2,594,000	7,249,458.03	1.86
25	CRCC High-Tech Equipment Corporation	中铁高新技术设备	BBG009RTY8C9	香港联合交易所	香港	2,431,000	6,962,714.62	1.79
26	AIA Group Ltd	友邦保险	BBG0016XR1Q8	香港联合交易所	香港	133,800	6,625,085.06	1.70
27	Airtac International Group	亚德客	BBG0014M8L81	台湾证券交易所	台湾	78,000	6,243,580.95	1.61
28	Win Semiconductors Corporation	稳懋半导体	BBG000W1CHV6	台湾证券交易所	台湾	164,000	6,098,184.62	1.57
29	MGM China Holdings Ltd	米高梅中国	BBG001J119M9	香港联合交易所	香港	388,000	5,846,031.39	1.50
30	SINA Corporation	新浪集团	BBG000CJZ2W6	纳斯达克	美国	10,000	5,756,207.68	1.48
31	Parade Technologies Ltd	谱瑞科技	BBG0021GYN91	台湾证券交易所	台湾	58,000	4,829,918.97	1.24
32	Sunonwealth Electric Machine Industry Co. Ltd	建准电机	BBG000F83TB6	台湾证券交易所	台湾	545,000	4,769,021.74	1.23
33	Broadcom Ltd	博通公司	BBG009XV39D8	纳斯达克	美国	2,800	4,420,566.98	1.14
34	Microport Scientific Corporation	微创医疗	BBG0015NVM80	香港联合交易所	香港	754,000	4,024,631.83	1.04
35	Finisar Corporation	菲尼萨	BBG000C26K28	纳斯达克	美国	21,200	3,731,176.93	0.96
36	Weibo Corporation	微博	BBG0065XPGX9	纳斯达克	美国	1,000	450,294.37	0.12
37	Shanghai Haohai Biological Technology Co Ltd	上海昊海生物科技	BBG008K6DXS9	香港联合交易所	香港	6,800	250,238.69	0.06

注:

1. 本基金对以上证券代码采用彭博 BBG-ID。
2. 上述表格“所属国家（地区）”均按照股票及存托凭证上市交易地点统计。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	China Yongda Automobiles Services Holding limited	BBG002ZFX5C2	26,222,459.26	8.02
2	Grand Baoxin Auto Group Ltd	BBG0029CPT53	24,318,997.30	7.44
3	China Pacific Insurance Group	BBG000KVB7C7	19,224,465.47	5.88
4	Geely Automobile Holdings Ltd	BBG000BZ3PX4	18,385,340.71	5.62
5	Huadian Fuxin Energy Corp Ltd	BBG0033JQ2C2	17,747,962.44	5.43
6	Sunny Optical Technology Group	BBG000C16952	15,402,408.33	4.71
7	YY Inc	BBG003H0XV18	14,418,910.88	4.41
8	Weichai Power Co Ltd	BBG000L8BY83	13,344,373.83	4.08
9	Samsung Electronics Co Ltd	BBG000BCY2S8	12,711,254.70	3.89
10	Ju Teng International Holdings Ltd	BBG000FLKNV9	12,443,209.95	3.80
11	Win Semiconductors Corporation	BBG000W1CHV6	11,766,661.37	3.60
12	TPK Holding Co Ltd	BBG0017RZ591	11,326,571.51	3.46
13	Land Mark Optoelectronics Corp	BBG006RZZ2N1	10,641,052.63	3.25
14	New China Life Insurance Co Ltd	BBG0028VY3J4	9,224,321.73	2.82
15	China Taiping Insurance Holdings Ltd	BBG000BY28H4	8,966,995.37	2.74
16	Ctrip.com International Ltd	BBG000CWMB24	8,921,644.06	2.73
17	Taiwan Union Technology Corporation	BBG000LLH1T7	7,802,282.77	2.39

18	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	BBG000BD90Z0	7,783,178.11	2.38
19	NetEase Inc	BBG000BX72V8	7,654,573.55	2.34
20	Ping An Insurance Group Co of China	BBG000GD4N44	7,552,520.90	2.31

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Geely Automobile Holdings Ltd	BBG000BZ3PX4	19,528,127.75	5.97
2	Sunny Optical Technology Group	BBG000C16952	17,159,854.45	5.25
3	Dongjiang Environmental Co Ltd	BBG000PN4FN8	16,436,400.14	5.03
4	Huadian Fuxin Energy Corp Ltd	BBG0033JQ2C2	16,167,291.72	4.94
5	Win Semiconductors Corporation	BBG000W1CHV6	14,851,156.53	4.54
6	TravelSky Technology Ltd	BBG000FDK190	14,548,181.56	4.45
7	YY Inc	BBG003H0XV18	14,407,831.22	4.41
8	China Yongda Automobiles Services Holding Ltd	BBG002ZFX5C2	14,270,053.79	4.36
9	China Longyuan Power Group Corporation	BBG000P2MRM9	14,050,659.66	4.30
10	Weichai Power Co Ltd	BBG000L8BY83	14,000,858.94	4.28
11	TPK Holding Co Ltd	BBG0017RZ591	12,317,003.44	3.77
12	United Laboratories International Holdings Ltd	BBG000JZ6DW1	10,004,258.95	3.06
13	Ctrip.com International Ltd	BBG000CWMB24	9,999,027.72	3.06
14	Grand Baoxin Auto Group Ltd	BBG0029CPT53	9,316,005.92	2.85
15	Tianneng Power International Ltd	BBG000JSJ8J9	9,168,071.30	2.80
16	Poly Culture Group Corp	BBG00611PVR7	8,759,973.04	2.68

	Ltd			
17	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Ltd	BBG000BD90Z0	8,175,461.74	2.50
18	Cogobuy Group	BBG006S5M116	8,032,703.25	2.46
19	NetEase Inc	BBG000BX72V8	8,018,835.55	2.45
20	Beijing Enterprises Water Group	BBG000BDW6Y2	7,923,177.44	2.42

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	474,463,701.18
卖出收入（成交）总额	384,231,444.28

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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	9,789,024.59
3	应收股利	1,598,123.13
4	应收利息	197.75
5	应收申购款	44,019.98
6	其他应收款	9,773,603.90
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,204,969.35

7.11.4 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换债券。

7.11.5 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
1,690	242,319.88	391,878,214.54	95.69%	17,642,390.02	4.31%

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	10,041.03	0.002452%

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（2012年2月22日）基金份额总额	327,738,555.14
本报告期期初基金份额总额	384,971,327.71
本报告期基金总申购份额	33,544,601.14
减：本报告期基金总赎回份额	8,995,324.29
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	409,520,604.56

§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

1、经国海富兰克林基金管理有限公司 2017 年股东会第四次会议审议通过，自 2017 年 6 月 21 日起，Gregory E. McGowan 不再担任公司董事长，由吴显玲女士担任公司董事长。相关公告已于 2017 年 6 月 24 日在《中国证券报》和公司网站披露。

2、经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第三十二次会议审议通过，自 2017 年 6 月 21 日起，吴显玲女士不再担任公司总经理，由林勇先生担任公司总经理。相关公告已于 2017 年 6 月 24 日在《中国证券报》和公司网站披露。

（二）基金托管人重大人事变动

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

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为普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

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	
Cathay Securities	1	43,988,944.30	4.98%	48,446.62	4.03%	
MorganStanley	1	124,528,216.38	14.10%	197,782.37	16.46%	
GoldmanSachs	1	104,507,155.91	11.84%	156,605.34	13.03%	
Jefferies	1	24,034,228.16	2.72%	36,051.35	3.00%	
Instinet	1	155,299,652.59	17.59%	232,947.84	19.39%	
Daiwa Capital Markets Hongkong Limited	1	169,188,423.16	19.16%	121,345.98	10.10%	
CLSA Limited	1	124,401,849.18	14.09%	195,340.54	16.26%	
China Everbright Securities	1	95,126,477.76	10.77%	142,689.69	11.88%	
中信建投	1	20,242.41	0.00%	14.35	0.00%	
KGI Securities	1	34,563,296.20	3.91%	62,213.25	5.18%	
Huatai Financial Holdings (Hong Kong)	1	3,800,539.16	0.43%	3,800.54	0.32%	
Cathay Securities (Hong Kong)	1	3,562,611.66	0.40%	4,275.13	0.36%	
国海证券	2	-	-	-	-	
建银国际证券	1	-	-	-	-	
Bank of America/Merrill Lynch	1	-	-	-	-	
Macquarie Capital Securities	1	-	-	-	-	
China International Capital Corporation	1	-	-	-	-	

Haitong International Securities Company	1	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---

注：

1. 专用交易单元的选择标准和程序

1) 选择代理基金证券买卖的证券经营机构的标准

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，并租用其交易单元作为基金的专用交易单元。选择的标准是：

- A 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- B 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚；
- C 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- D 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- E 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2) 公司基金交易佣金分配依据券商提供的研究报告和服务质量，评判标准包括但不限于：

- A 全面及时向公司提供高质量的关于宏观、行业和市场的研究报告；
- B 具有数量研究和开发能力；
- C 能有效组织上市公司调研；
- D 能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；
- E 上门路演和电话会议的质量；
- F 与我公司投资和研究人员的信息交流和沟通能力；
- G 其他与投资相关的服务和支持。

3) 租用基金专用交易单元的程序

(1) 基金管理人根据上述标准考察证券经营机构，考察结果经公司领导审批后，我司与被选中的证券经营机构签订《券商交易单元租用协议》和《研究服务协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。

(2) 之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选

择标准细化的评价体系，每季度对签约证券经营机构的服务进行一次综合评价：

- A 提供的研究报告质量和数量；
- B 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；
- C 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；
- D 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；
- E 其他可评价的量化标准。

经过评价，对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。

(3) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

2、报告期内证券公司基金专用交易单元的变更情况

报告期内，本基金新增中金香港(China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited)交易单元 1 个，华泰金控(Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited) 交易单元 1 个，海通国际(Haitong International Securities Company Limited) 交易单元 1 个，凯基证券(KGI Securities Co. Ltd) 交易单元 1 个。国泰香港(Cathay Securities (HK) Limited) 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Cathay Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
MorganStanley	-	-	-	-	-	-	-	-
GoldmanSachs	-	-	-	-	-	-	-	-
Jefferies	-	-	-	-	-	-	-	-
Instinet	-	-	-	-	-	-	-	-

Daiwa Capital Markets Hongkong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
China Everbright Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cathay Securities (Hong Kong)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Bank of America/Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Macquarie Capital Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company	-	-	-	-	-	-	-	-	-

§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	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	341,060,027.28	27,381,161.01	-	368,441,188.29	89.97%

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。

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。

国海富兰克林基金管理有限公司

2017 年 8 月 25 日