

富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金
2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 27 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国富沪深 300 指数增强
基金主代码	450008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 3 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	224,283,922.41 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数增强投资策略。通过量化风险管理方法，控制基金投资组合与标的指数构成的偏差，同时结合主动投资方法，在严格控制跟踪偏离风险的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期增值。在正常市场情况下，本基金对业绩比较基准的年跟踪误差不超过 8%。
投资策略	<p>资产配置策略：</p> <p>本基金以追求基金资产长期增长的稳定收益为宗旨，在股票市场上进行指数化被动投资的基础上，基金管理人在债券（国债为主）、股票、现金等各类资产之间仅进行适度的主动配置。通过运用深入的基本面分析及先进的数量技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。</p> <p>股票投资策略：</p> <p>本基金以指数化投资为主，以最小化跟踪误差为组合的投资控制目标，本基金所跟踪的目标指数为沪深 300 指数。</p> <p>本产品指数化投资的基础上辅以有限度的增强操作（优化调整）及一级市场股票投资。具体而言，基金将基本依据目标指数的成份股构成权重，并借助数量化投资分析技术构造和调整指数化投资组合。在投资组合建立后，基金定期对比检验组合与比较基准的偏离程度，适时对投资组合进行调整，使指数优化组合与目标指数的跟踪误差控制在限定的范围内。在正常市场情况下，本基金对业绩比较基准的年跟踪误差不超过 8%。此外，本基金将利用所持有股票市值参与一级市场股票投资，以在不增加额外风险的前提下提高收益水平，争取获得超过指数的回报。</p> <p>债券投资策略：</p> <p>本基金将在对宏观经济和资本市场进行研究的基础上，</p>

	<p>对利率结构、市场利率走势进行分析和预测，综合考虑中债国债指数各成份券种及金融债的收益率水平、流动性的好坏等因素，进行优化选样构建本基金的债券投资组合。</p> <p>本基金以富兰克林邓普顿投资集团固定收益类资产投资研究平台及本基金管理人的投资研究平台为依托，采取积极主动的投资策略，以中长期利率趋势分析为主，结合经济周期、宏观经济运行中的价格指数、资金供求分析、货币政策、财政政策研判及收益率曲线分析，在保证流动性和风险可控的前提下，实施积极的债券投资组合管理。</p>
业绩比较基准	95% × 沪深 300 指数 + 5% × 银行同业存款利率
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，属于较高风险、较高预期收益的证券投资基金。

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

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	203,604,123.23	11,419,312.55	232,887,382.28
本期利润	211,337,085.32	-16,541,542.35	68,854,719.63
加权平均基金份额本期利润	0.2556	-0.0971	0.2700
本期基金份额净值增长率	14.61%	-7.25%	8.31%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1203	0.2934	0.3939
期末基金资产净值	251,268,384.94	204,864,202.02	239,960,979.80
期末基金份额净值	1.120	1.293	1.394

注：

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

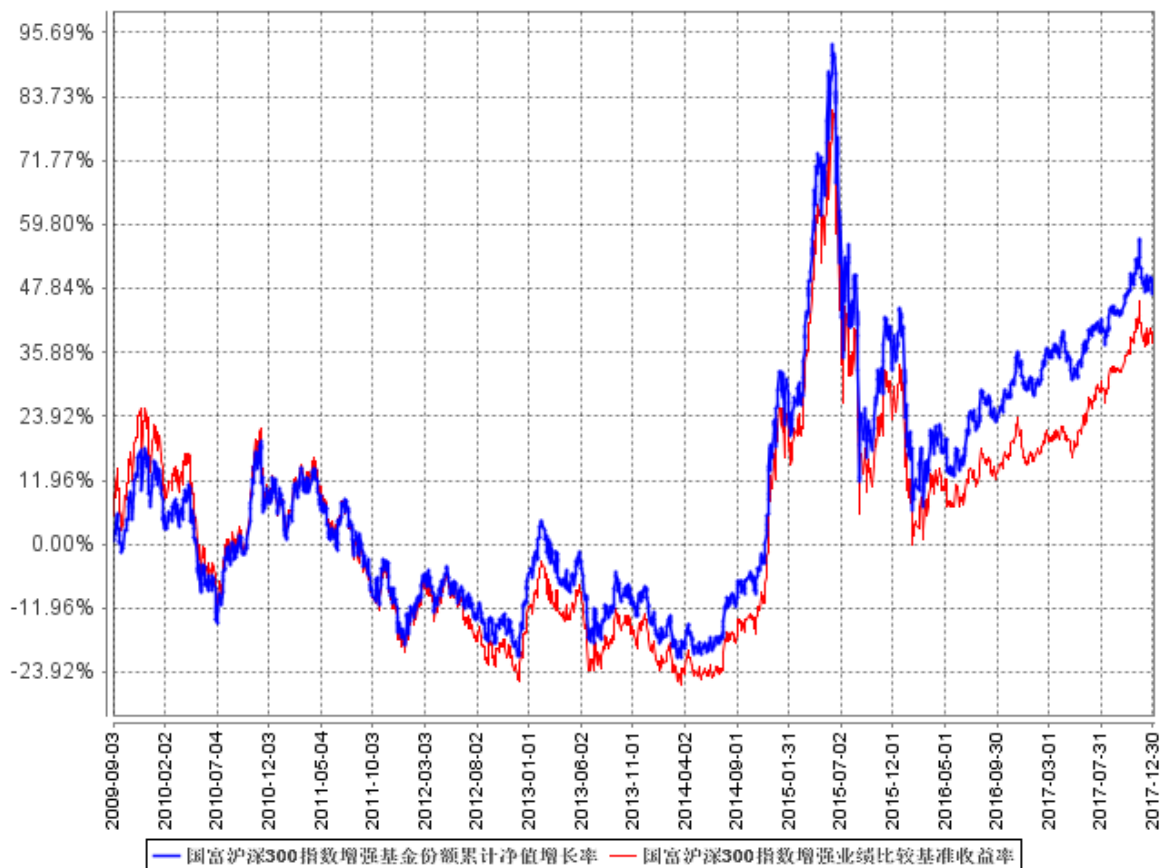
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.23%	0.76%	4.83%	0.76%	-1.60%	0.00%
过去六个月	5.92%	0.64%	9.45%	0.66%	-3.53%	-0.02%
过去一年	14.61%	0.61%	20.65%	0.60%	-6.04%	0.01%
过去三年	15.14%	1.65%	14.02%	1.60%	1.12%	0.05%
过去五年	56.65%	1.49%	57.46%	1.47%	-0.81%	0.02%
自基金合同生效起至今	48.19%	1.43%	39.08%	1.43%	9.11%	0.00%

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

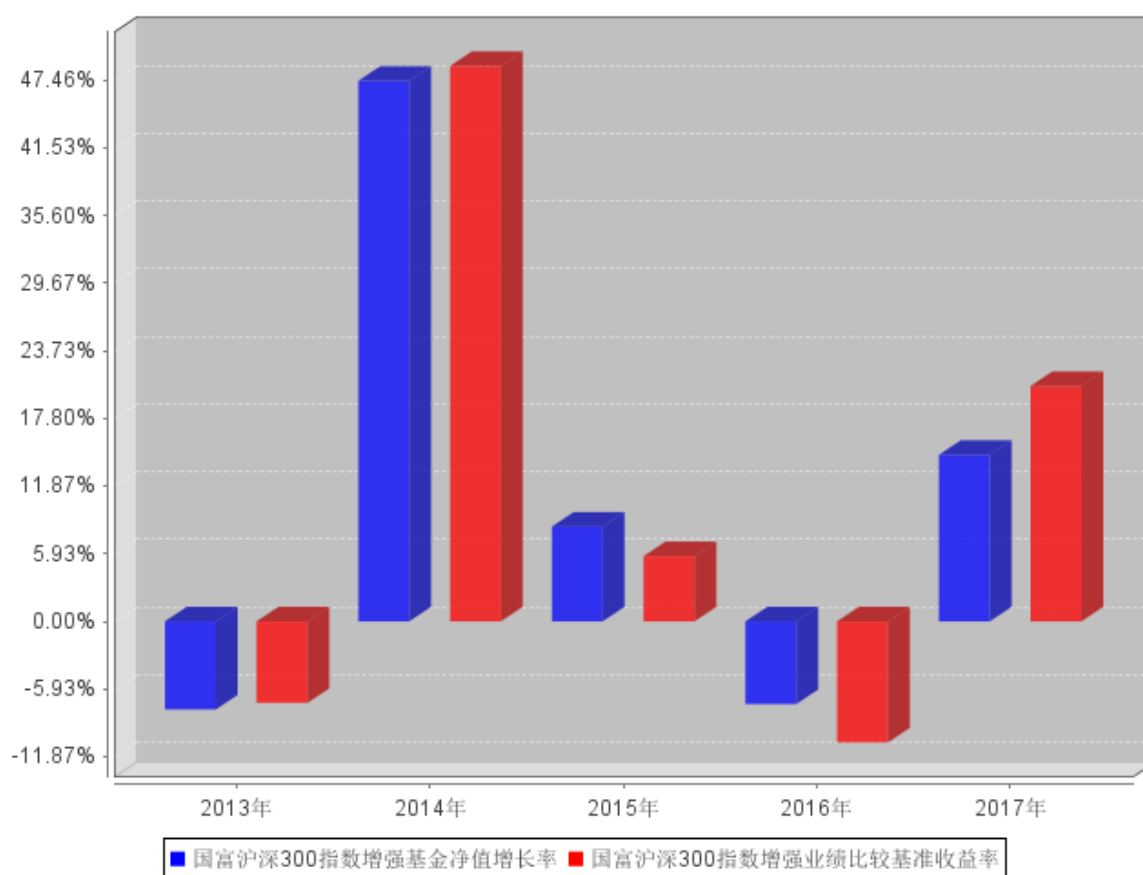
国富沪深300指数增强基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2009 年 9 月 3 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国富沪深300指数增强过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	3.4310	1,688,567,700.39	12,877,727.21	1,701,445,427.60	
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
合计	3.4310	1,688,567,700.39	12,877,727.21	1,701,445,427.60	

§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		
张志强	公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、职工监事、国富沪深 300 指数增强基金及国富中证 100 指数增强分级基金的基金经理	2013 年 3 月 21 日	-	15 年	张志强先生，CFA，纽约州立大学（布法罗）计算机科学硕士，中国科学技术大学数学专业硕士。历任美国 Enreach Technology Inc. 软件工程师、海通证券股份有限公司研究所高级研究员、友邦华泰基金管理有限公司高级数量分析师、国海富兰克林基金管理有限公司首席数量分析师、风险控制部总经理、业务发展部总经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、职工监事、国富沪深 300 指

					数增强基金及国富中证 100 指数增强分级基金的基金经理。
鲍翔	国富沪深 300 指数增强基金及国富中证 100 指数增强分级基金的基金经理兼高级数量分析师	2016 年 5 月 5 日	2017 年 9 月 19 日	8 年	鲍翔先生，英国拉夫堡大学金融数学硕士。历任浙商证券股份有限公司量化研究员及国海富兰克林基金管理有限公司高级数量分析师、基金经理。

注：

1. 表中“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，其中，首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。
2. 表中“证券从业年限”的计算标准为该名员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司建立了《公平交易管理制度》，确保公司旗下投资组合能够得到公平对待，避免各种投资组合之间的利益输送行为。我们主要从如下几个方面对公平交易进行控制：

1. 在研究信息共享方面，投资研究等部门通过定期的例会沟通机制，就相关议题进行讨论；公司建立了统一的研究平台，研究报告信息通过研究平台进行发布。
2. 建立投资对象备选库，股票及债券的入库需要由研究报告支持作为依据，并经过相关领导审批；建立研究报告的定期更新机制。
3. 在投资决策方面，公司在各类资产管理业务之间建立防火墙，确保业务隔离及人员隔离，

同时各投资组合经理投资决策保持独立。

4. 公司对所有投资组合的交易指令实行集中交易，公司在交易系统中设置公平交易功能，按照时间优先、价格优先的原则执行各账户所有指令；公司建立和完善了对债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易分配制度，以确保相关投资组合能够得到公平对待。

5. 公司建立了《同日反向交易管理办法》，通过事前审批来对反向交易进行事前控制。公司每季度对不同时间窗下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。

6. 公司定期对公平交易执行情况进行监察稽核，并在监察稽核定期报告中做专项说明。公司也会在各投资组合的定期报告中，披露公平交易制度执行情况及异常交易行为专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内公司严格执行《公平交易管理制度》，明确了公平交易的原则和目标，制订了实现公平交易的具体措施，并在技术上按照公平交易原则实现了严格的交易公平分配。

报告期末，公司共管理了三十一只公募基金及八只专户产品。统计所有投资组合分投资类别（股票、债券）过去连续 4 个季度内在不同时间窗口（T=1、T=3 和 T=5）存在同向交易价差的样本，并对差价率均值、交易价格占优比率、t 值、贡献率等指标进行分析，报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司按照《异常交易监控与报告制度》，系统划分了异常交易的类型、异常交易的界定标准、异常交易的识别程序，制订了异常交易的监控办法，并规范了异常交易的分析、报告制度。

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

报告期内，公司不同投资组合之间未发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况，经公司检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年，A 股市场总体呈现上涨态势，但结构分化明显，具备良好盈利能力和业绩增长确定性以及具备估值优势的龙头股普遍涨幅较大，而缺乏业绩支撑、估值虚高的部分中小市值股票则出现较大幅度下跌。行业方面，保险、食品饮料、家用电器等行业涨幅居前，而纺织服装、传媒、国防军工、商业贸易、轻工制造、农林牧渔、证券等行业跌幅较大。其中，沪深 300 指数全年上

涨 21.78%。

报告期内，本基金在保持均衡的组合配置以控制主动投资风险的前提下，继续使用量化选股模型精选个股及构建投资组合。虽然组合的主动风险控制较小的水平，但少量风险暴露仍然给组合带来了一定的负面影响。此外，报告期内基金遭遇较大比例申购和赎回，以及由此造成股票持仓组合中有一定比例的停牌股票，这些因素也给基金的管理和业绩带来了一些负面影响。上述负面影响导致本报告期基金表现落后于业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.120 元。本报告期，考虑到基金分红因素，基金复权单位净值上涨 14.61%，同期业绩比较基准上涨 20.65%，基金表现落后业绩基准 6.04%，期间基金年化跟踪误差为 3.20%。

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 2018 年，预测去杠杆和防范金融风险仍将是经济政策的重点，房地产和基建投资增长恐会存在下滑压力。虽然消费升级的大趋势将保持，但居民的大宗消费可能转弱，预计 2018 年消费增速将总体保持平稳。得益于全球经济复苏，进出口仍将保持增长，但考虑到复苏并不强劲，加上汇率因素，预计 2018 年进出口增速基本维持目前水平，难以有大幅上升。基于上述宏观环境，预计企业盈利增长将在目前的水平上小幅波动。流动性方面，目前中性偏紧的货币政策和较严格的金融监管政策取向预计将延续，A 股市场的流动性可能不会有显著改观。

2018 年的 A 股市场或将延续过去一年的风格，盈利能力、业绩增长确定性和估值优势仍将是选股的主要标准，个股表现仍将呈现结构分化的特征，但分化程度预计将下降。此外，A 股纳入“MSCI 新兴市场指数”等事件，以及 5G、国企改革等主题也可能在 2018 年带来一些阶段性或局部的投资机会。

本基金将遵循基金合同的要求，将在保持对业绩基准的跟踪、控制主动投资风险的基础上，借助量化选股策略，力争取得较好的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，严格开展对基金相关法律文件和对外宣传资料的合规审核，积极加强对各部门、各主要运作环节的风险监控，并通过定期稽核和专项稽核，及时发现需要完善的业务环节，并落实措施。报告期内，本基金管理人特别关注基金投资研究交易、市场销售以及运营的合法合规和风险控制，对保护投资者利益涉及

的各业务环节以及信息技术安全开展了专项自查和采取控制措施。同时，本基金管理人开展多层次的员工合规教育和日常提示等措施，强化员工风控意识，努力营造合规经营文化。此外，本基金管理人依照规定，及时向监管部门、董事会报送监察稽核报告。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将继续深入分析和识别市场变化和潜在风险，积极采取措施，加强事前、事中和事后的内部控制，提高监察稽核工作的科学性和有效性。

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

本基金的基金管理人于 2017 年 7 月 15 日宣告分红，向截至 2017 年 7 月 19 日止在本基金注册登记人国海富兰克林基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 3.431 元。

本基金本报告期所实现的利润分配情况符合基金合同要求。

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 12 月 31 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国海富兰克林基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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 审计报告

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	12,372,708.12	12,542,443.25
结算备付金	5,810,079.17	815,594.17
存出保证金	1,441,835.26	52,707.79
交易性金融资产	235,643,617.29	192,371,977.95
其中：股票投资	235,643,617.29	192,371,977.95
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	331,683.97	208,096.29
应收利息	11,162.78	2,909.24
应收股利	-	-
应收申购款	243,207.79	847.67
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	255,854,294.38	205,994,576.36
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 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	-	-
应付赎回款	174,337.37	209,951.29
应付管理人报酬	304,614.25	150,647.44
应付托管费	53,755.47	26,584.87
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,559,323.04	310,973.50
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	493,879.31	432,217.24
负债合计	4,585,909.44	1,130,374.34
所有者权益：		
实收基金	224,283,922.41	158,390,048.09
未分配利润	26,984,462.53	46,474,153.93
所有者权益合计	251,268,384.94	204,864,202.02
负债和所有者权益总计	255,854,294.38	205,994,576.36

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.120 元，基金份额总额 224,283,922.41 份。

7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	234,856,481.55	-10,505,217.98
1.利息收入	1,974,479.88	108,878.51
其中：存款利息收入	1,088,218.05	108,833.74
债券利息收入	-	44.77
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	886,261.83	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	217,996,995.88	17,312,767.54
其中：股票投资收益	205,738,364.42	13,534,854.03
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	9,073.06
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	12,258,631.46	3,768,840.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,732,962.09	-27,960,854.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7,152,043.70	33,990.87
减：二、费用	23,519,396.23	6,036,324.37
1. 管理人报酬	7,880,246.34	1,760,818.62

2. 托管费	1,390,631.83	310,732.69
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	13,667,232.18	3,381,039.57
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	581,285.88	583,733.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	211,337,085.32	-16,541,542.35
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	211,337,085.32	-16,541,542.35

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	158,390,048.09	46,474,153.93	204,864,202.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	211,337,085.32	211,337,085.32
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）	65,893,874.32	1,470,618,650.88	1,536,512,525.20
其中：1. 基金申购款	5,275,877,561.26	2,014,424,779.44	7,290,302,340.70
2. 基金赎回款	-5,209,983,686.94	-543,806,128.56	-5,753,789,815.50
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）	-	-1,701,445,427.60	-1,701,445,427.60
五、期末所有者权益（基金净值）	224,283,922.41	26,984,462.53	251,268,384.94
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益	172,150,203.46	67,810,776.34	239,960,979.80

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-16,541,542.35	-16,541,542.35
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)	-13,760,155.37	-4,795,080.06	-18,555,235.43
其中:1.基金申购款	25,779,180.44	4,734,994.61	30,514,175.05
2.基金赎回款	-39,539,335.81	-9,530,074.67	-49,069,410.48
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)	158,390,048.09	46,474,153.93	204,864,202.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>林勇</u>	<u>胡昕彦</u>	<u>龚黎</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金(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[2009]第 652 号《关于核准富兰克林国海沪深 300 指数增强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《富兰克林国海沪深 300 指数增强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 2,423,482,243.08 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(2009)第 153 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2009 年 9 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,423,832,173.19 份基金份额,其中认购资金利息折合 349,930.11 份基金份额。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海沪深 300 指数增强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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证

监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 85%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-15%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证占基金资产净值的比例不高于 3%。本基金除投资于目标指数的成份股票，包括沪深 300 指数的成份股和备选成份股以外，还可适当投资一级市场申购的股票(包括新股与增发)，以在不增加额外风险的前提下提高收益水平。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

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 2018 年 3 月 23 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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的说明。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，本基金自2017年12月25日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。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。

(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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
国海证券股份有限公司（“国海证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
邓普顿国际股份有限公司（Templeton International, Inc.）	基金管理人的股东
国海富兰克林资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国海证券	578,185,057.57	6.38%	85,487,483.15	3.83%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国海证券	538,420.64	6.53%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国海证券	77,904.88	3.78%	-	-

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年 12月31日	2016年1月1日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,880,246.34	1,760,818.62
其中：支付销售机构的客户维护费	561,756.28	351,214.33

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 0.85% 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 0.85% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年 12月31日	2016年1月1日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,390,631.83	310,732.69

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 0.15% 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 0.15% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用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 12 月 31 日）基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国农业银行	12,372,708.12	893,847.08	12,542,443.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600664	哈药股份	2017 年 9 月 28 日	重大资产重组停牌	6.11	2018 年 2 月 27 日	6.00	2,151,860	12,575,320.00	13,147,864.60	-
600332	白云山	2017 年 10 月 31 日	重大资产重组停牌	32.14	2018 年 1 月 8 日	30.15	329,061	8,890,419.30	10,576,020.54	-
002470	金正大	2017 年 10 月 25 日	重大事项停牌	8.52	2018 年 2 月 9 日	8.24	1,085,987	8,940,145.47	9,252,609.24	-
601600	中国铝业	2017 年 9 月 12 日	重大资产重组停牌	6.64	2018 年 2 月 26 日	7.28	942,300	6,119,156.17	6,256,872.00	-
000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	重大资产重组停牌	7.35	-	-	610,600	4,117,440.84	4,487,910.00	-

000900	现代投资	2017年10月27日	重大资产重组停牌	6.25	-	-	431,057	2,634,090.70	2,694,106.25	-
300116	坚瑞沃能	2017年12月18日	重大资产重组停牌	7.62	-	-	319,266	3,077,660.31	2,432,806.92	-
600309	万华化学	2017年12月5日	重大资产重组停牌	37.94	-	-	60,240	2,175,533.86	2,285,505.60	-
300159	新研股份	2017年11月23日	重大资产重组停牌	10.40	2018年3月22日	9.36	95,917	1,170,056.55	997,536.80	-
300104	乐视网	2017年4月17日	重大资产重组停牌	3.91	2018年1月24日	13.80	199,000	3,245,483.00	778,090.00	-
300109	新开源	2017年3月27日	重大资产重组停牌	46.46	2018年1月12日	48.88	10,466	445,959.56	486,250.36	-
300730	科创信息	2017年12月25日	股票交易异常波动停牌	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	股票交易异常波动停牌	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 182,168,840.77 元，属于第二层次的余额为 52,696,686.52 元，属于第三层次的余额为 778,090.00 元(2016 年 12 月 31 日：第一层次 184,729,118.02 元，第二层次 7,642,859.93 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

交易性金融资产 股票投资

2017 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层	1,556,180.00
转出第三层	-
当期利得或损失总额	-778,090.00
计入损益的利得或损失	-778,090.00

2017 年 12 月 31 日	778,090.00
2017 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2017 年度损益的未实现利得或损失的变动 ——公允价值变动损益	-2,330,887.00

计入损益的损失为计入利润表中的公允价值变动损益项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

	2017 年 12 月 31 日公允价值	估值技术	名称	不可观察输入值	
				范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产——					
股票投资	778,090.00	市场法	市销率	3-5.5	正相关
			市盈率	15	正相关
			对最近融资价格的调整系数	30%	正相关

本基金上年末无第三层次公允价值余额，上年度可比期间无变动金额。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (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，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。

根据财政部、国家税务总局于 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	235,643,617.29	92.10
	其中：股票	235,643,617.29	92.10
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	18,182,787.29	7.11
7	其他各项资产	2,027,889.80	0.79
8	合计	255,854,294.38	100.00

注：本基金未通过港股通交易机制投资港股。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	539,172.00	0.21
B	采矿业	4,240,788.16	1.69
C	制造业	90,299,553.99	35.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,075,574.34	1.62
E	建筑业	7,357,267.80	2.93
F	批发和零售业	2,199,632.12	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	4,311,480.00	1.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,419,162.72	2.16
J	金融业	70,714,431.01	28.14
K	房地产业	10,643,931.30	4.24
L	租赁和商务服务业	2,904,511.80	1.16
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	1,015,353.06	0.40
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	203,720,858.30	81.08

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,035,336.37	10.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	474,719.00	0.19
F	批发和零售业	458,275.44	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	2,712,064.19	1.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	812,202.55	0.32
J	金融业	621,210.24	0.25
K	房地产业	792,808.00	0.32
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	31,922,758.99	12.70

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未通过港股通交易机制投资港股。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	206,162	14,427,216.76	5.74
2	600332	白云山	329,061	10,576,020.54	4.21
3	002470	金正大	1,085,987	9,252,609.24	3.68
4	600519	贵州茅台	11,331	7,903,259.19	3.15
5	600036	招商银行	233,868	6,786,849.36	2.70
6	601600	中国铝业	942,300	6,256,872.00	2.49
7	000651	格力电器	122,642	5,359,455.40	2.13
8	000540	中天金融	610,600	4,487,910.00	1.79
9	600016	民生银行	509,355	4,273,488.45	1.70
10	601166	兴业银行	251,400	4,271,286.00	1.70

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于国海富兰克林基金管理有限公司网站的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600664	哈药股份	2,151,860	13,147,864.60	5.23
2	000900	现代投资	431,057	2,694,106.25	1.07
3	300116	坚瑞沃能	319,266	2,432,806.92	0.97
4	002636	金安国纪	84,060	1,330,669.80	0.53
5	000921	海信科龙	87,108	1,212,543.36	0.48
6	300159	新研股份	95,917	997,536.80	0.40
7	600550	保变电气	148,300	925,392.00	0.37
8	000070	特发信息	88,700	828,458.00	0.33
9	000036	华联控股	87,700	792,808.00	0.32
10	300104	乐视网	199,000	778,090.00	0.31

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于国海富兰克林基金管理有限公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	184,695,342.57	90.16
2	600519	贵州茅台	89,660,999.70	43.77
3	600036	招商银行	89,657,079.00	43.76
4	600016	民生银行	68,842,694.63	33.60
5	601166	兴业银行	64,696,838.52	31.58
6	000651	格力电器	57,762,861.90	28.20
7	601668	中国建筑	55,750,570.00	27.21
8	002415	海康威视	54,127,271.03	26.42
9	601818	光大银行	52,349,201.00	25.55
10	000725	京东方 A	51,904,080.00	25.34
11	601398	工商银行	51,732,922.02	25.25
12	600015	华夏银行	48,830,609.42	23.84
13	000333	美的集团	48,398,673.98	23.62
14	600887	伊利股份	47,691,456.17	23.28
15	601601	中国太保	46,174,277.60	22.54
16	600837	海通证券	44,722,606.84	21.83
17	600309	万华化学	42,885,105.85	20.93
18	000002	万科 A	39,426,956.07	19.25
19	600030	中信证券	39,406,037.72	19.24
20	600000	浦发银行	39,067,340.14	19.07
21	601988	中国银行	38,401,395.00	18.74
22	601211	国泰君安	37,549,702.87	18.33
23	601328	交通银行	37,044,976.00	18.08
24	601628	中国人寿	36,779,613.77	17.95
25	000776	广发证券	36,013,199.71	17.58
26	601006	大秦铁路	35,946,467.00	17.55
27	002304	洋河股份	35,630,217.36	17.39
28	600276	恒瑞医药	35,045,379.23	17.11
29	600019	宝钢股份	32,492,200.31	15.86
30	600816	安信信托	32,432,242.39	15.83
31	601766	中国中车	31,559,151.83	15.40

32	000858	五 粮 液	31,346,760.99	15.30
33	600104	上汽集团	31,297,569.62	15.28
34	601225	陕西煤业	30,798,212.35	15.03
35	000625	长安汽车	30,683,261.85	14.98
36	601688	华泰证券	30,525,316.25	14.90
37	600031	三一重工	30,420,303.41	14.85
38	600900	长江电力	30,321,755.91	14.80
39	000895	双汇发展	28,662,015.28	13.99
40	601186	中国铁建	28,215,840.68	13.77
41	600893	航发动力	27,408,720.03	13.38
42	600050	中国联通	26,858,000.00	13.11
43	002027	分众传媒	26,409,977.57	12.89
44	600048	保利地产	26,350,314.46	12.86
45	600383	金地集团	26,297,226.90	12.84
46	000001	平安银行	25,959,342.50	12.67
47	601009	南京银行	25,220,415.68	12.31
48	601169	北京银行	24,013,322.08	11.72
49	002310	东方园林	23,356,520.41	11.40
50	600518	康美药业	23,153,227.50	11.30
51	000415	渤海金控	22,342,917.00	10.91
52	600028	中国石化	21,185,874.17	10.34
53	600415	小商品城	21,168,132.40	10.33
54	601336	新华保险	20,932,202.99	10.22
55	600886	国投电力	20,505,256.44	10.01
56	600690	青岛海尔	20,400,627.00	9.96
57	600522	中天科技	20,399,971.50	9.96
58	600637	东方明珠	20,339,029.47	9.93
59	002152	广电运通	20,043,450.51	9.78
60	300072	三聚环保	20,015,974.67	9.77
61	000568	泸州老窖	19,963,210.86	9.74
62	600153	建发股份	19,803,988.57	9.67
63	601390	中国中铁	19,680,432.33	9.61
64	600674	川投能源	19,112,741.26	9.33
65	002236	大华股份	18,793,605.64	9.17
66	002636	金安国纪	18,586,536.80	9.07
67	601857	中国石油	18,357,595.00	8.96

68	601899	紫金矿业	18,256,284.69	8.91
69	300116	坚瑞沃能	17,982,718.70	8.78
70	600291	西水股份	17,910,421.22	8.74
71	601088	中国神华	17,699,025.00	8.64
72	000060	中金岭南	17,568,676.23	8.58
73	002195	二三四五	17,529,429.92	8.56
74	600068	葛洲坝	17,500,121.41	8.54
75	000069	华侨城 A	17,216,422.84	8.40
76	002142	宁波银行	16,858,160.54	8.23
77	002594	比亚迪	16,830,772.80	8.22
78	000538	云南白药	16,744,159.82	8.17
79	002146	荣盛发展	16,702,465.50	8.15
80	601607	上海医药	16,549,010.86	8.08
81	000338	潍柴动力	16,100,247.60	7.86
82	601939	建设银行	16,080,294.00	7.85
83	600705	中航资本	15,903,071.11	7.76
84	600958	东方证券	15,757,754.26	7.69
85	002024	苏宁云商	15,231,110.26	7.43
86	000963	华东医药	15,163,021.74	7.40
87	600651	飞乐音响	14,811,220.50	7.23
88	600585	海螺水泥	14,805,994.00	7.23
89	600340	华夏幸福	14,743,833.52	7.20
90	601877	正泰电器	14,461,292.11	7.06
91	600757	长江传媒	14,142,343.96	6.90
92	600999	招商证券	14,091,766.80	6.88
93	000501	鄂武商 A	14,020,792.67	6.84
94	300158	振东制药	13,746,400.60	6.71
95	600583	海油工程	13,715,745.58	6.70
96	002466	天齐锂业	13,707,367.80	6.69
97	000063	中兴通讯	13,494,634.86	6.59
98	300059	东方财富	13,493,294.04	6.59
99	002065	东华软件	13,303,488.96	6.49
100	600066	宇通客车	13,186,525.24	6.44
101	600372	中航电子	13,155,440.48	6.42
102	600688	上海石化	13,061,985.00	6.38
103	600664	哈药股份	12,997,425.00	6.34

104	000876	新希望	12,566,088.00	6.13
105	002252	上海莱士	12,061,064.60	5.89
106	600271	航天信息	12,044,525.00	5.88
107	000513	丽珠集团	11,779,729.76	5.75
108	600260	凯乐科技	11,621,961.90	5.67
109	002501	利源精制	11,239,273.20	5.49
110	601555	东吴证券	11,236,200.49	5.48
111	000166	申万宏源	11,077,352.16	5.41
112	600570	恒生电子	11,014,361.87	5.38
113	600516	方大炭素	10,931,062.00	5.34
114	002230	科大讯飞	10,895,093.00	5.32
115	002450	康得新	10,788,735.66	5.27
116	601098	中南传媒	10,728,657.76	5.24
117	001979	招商蛇口	10,658,671.24	5.20
118	600352	浙江龙盛	10,440,109.59	5.10
119	600739	辽宁成大	10,400,022.35	5.08
120	601377	兴业证券	10,397,244.70	5.08
121	600803	新奥股份	10,251,198.86	5.00
122	601888	中国国旅	10,217,465.00	4.99
123	002470	金正大	10,187,533.47	4.97
124	600010	包钢股份	10,187,258.20	4.97
125	600373	中文传媒	10,094,142.97	4.93
126	600023	浙能电力	10,093,428.35	4.93
127	600038	中直股份	9,944,228.80	4.85
128	000036	华联控股	9,867,691.00	4.82
129	601677	明泰铝业	9,824,759.80	4.80
130	002736	国信证券	9,503,794.50	4.64
131	600332	白云山	9,369,147.70	4.57
132	601669	中国电建	9,234,334.19	4.51
133	000793	华闻传媒	9,130,756.96	4.46
134	000921	海信科龙	8,982,444.54	4.38
135	000423	东阿阿胶	8,953,991.55	4.37
136	000783	长江证券	8,908,520.02	4.35
137	000425	徐工机械	8,896,721.00	4.34
138	600582	天地科技	8,771,330.45	4.28
139	600312	平高电气	8,731,104.00	4.26

140	600009	上海机场	8,664,556.72	4.23
141	000528	柳 工	8,546,983.39	4.17
142	002673	西部证券	8,533,553.38	4.17
143	300033	同花顺	8,453,147.00	4.13
144	601788	光大证券	8,450,342.00	4.12
145	601985	中国核电	8,340,173.38	4.07
146	601992	金隅股份	8,188,255.00	4.00
147	600029	南方航空	8,093,504.00	3.95
148	600219	南山铝业	8,037,304.00	3.92
149	000400	许继电气	8,015,429.94	3.91
150	000936	华西股份	8,012,894.79	3.91
151	600741	华域汽车	7,845,309.42	3.83
152	300144	宋城演艺	7,766,086.00	3.79
153	600089	特变电工	7,759,875.44	3.79
154	600073	上海梅林	7,667,649.58	3.74
155	601800	中国交建	7,652,562.40	3.74
156	600208	新湖中宝	7,631,191.00	3.72
157	002008	大族激光	7,624,618.62	3.72
158	601901	方正证券	7,578,165.10	3.70
159	600297	广汇汽车	7,569,978.15	3.70
160	002241	歌尔股份	7,529,279.55	3.68
161	601198	东兴证券	7,525,848.23	3.67
162	600061	国投资本	7,515,401.77	3.67
163	600835	上海机电	7,425,613.33	3.62
164	002456	欧菲科技	7,270,932.00	3.55
165	600685	中船防务	7,267,271.33	3.55
166	600115	东方航空	7,249,951.80	3.54
167	000070	特发信息	7,246,963.00	3.54
168	002202	金风科技	7,236,751.20	3.53
169	600606	绿地控股	7,211,001.00	3.52
170	000951	中国重汽	7,100,560.40	3.47
171	000789	万年青	6,902,096.98	3.37
172	600642	申能股份	6,812,417.93	3.33
173	000059	华锦股份	6,775,061.22	3.31
174	601229	上海银行	6,747,173.00	3.29
175	601618	中国中冶	6,746,321.20	3.29

176	601600	中国铝业	6,713,796.00	3.28
177	600801	华新水泥	6,708,972.62	3.27
178	000917	电广传媒	6,615,193.54	3.23
179	000623	吉林敖东	6,585,541.40	3.21
180	600362	江西铜业	6,521,066.16	3.18
181	000959	首钢股份	6,462,477.54	3.15
182	601155	新城控股	6,440,541.90	3.14
183	600118	中国卫星	6,394,127.48	3.12
184	002500	山西证券	6,393,137.00	3.12
185	600079	人福医药	6,292,047.30	3.07
186	600660	福耀玻璃	6,220,071.70	3.04
187	600230	沧州大化	6,134,010.00	2.99
188	600535	天士力	6,116,991.37	2.99
189	600487	亨通光电	6,109,189.00	2.98
190	600018	上港集团	6,027,811.00	2.94
191	000540	中天金融	5,977,805.00	2.92
192	600100	同方股份	5,968,606.00	2.91
193	002049	紫光国芯	5,910,067.47	2.88
194	600420	现代制药	5,893,176.00	2.88
195	000630	铜陵有色	5,874,306.00	2.87
196	600196	复星医药	5,839,548.10	2.85
197	600183	生益科技	5,804,409.91	2.83
198	601727	上海电气	5,729,292.50	2.80
199	300133	华策影视	5,724,304.00	2.79
200	002174	游族网络	5,684,959.06	2.77
201	600039	四川路桥	5,603,756.00	2.74
202	600588	用友网络	5,564,566.60	2.72
203	600548	深高速	5,502,917.42	2.69
204	600111	北方稀土	5,462,050.00	2.67
205	601111	中国国航	5,434,294.00	2.65
206	000826	启迪桑德	5,321,862.32	2.60
207	600177	雅戈尔	5,306,668.15	2.59
208	000671	阳光城	5,292,758.00	2.58
209	300287	飞利信	5,279,779.83	2.58
210	601099	太平洋	5,236,963.00	2.56
211	002558	巨人网络	5,217,675.80	2.55

212	600550	保变电气	5,204,332.00	2.54
213	600483	福能股份	5,201,913.01	2.54
214	600547	山东黄金	5,168,039.00	2.52
215	601118	海南橡胶	5,106,777.00	2.49
216	600369	西南证券	5,083,909.00	2.48
217	601018	宁波港	5,025,878.00	2.45
218	002555	三七互娱	4,977,532.86	2.43
219	600406	国电南瑞	4,971,592.00	2.43
220	000008	神州高铁	4,959,120.63	2.42
221	000719	大地传媒	4,935,884.44	2.41
222	300017	网宿科技	4,888,625.57	2.39
223	300085	银之杰	4,865,645.91	2.38
224	600703	三安光电	4,743,013.40	2.32
225	600350	山东高速	4,736,913.00	2.31
226	000718	苏宁环球	4,732,651.00	2.31
227	000686	东北证券	4,663,910.50	2.28
228	600109	国金证券	4,532,614.00	2.21
229	002424	贵州百灵	4,530,073.00	2.21
230	300168	万达信息	4,485,314.00	2.19
231	601998	中信银行	4,477,402.10	2.19
232	600098	广州发展	4,467,819.37	2.18
233	601633	长城汽车	4,386,880.00	2.14
234	300393	中来股份	4,349,628.00	2.12
235	000728	国元证券	4,284,901.00	2.09
236	000738	航发控制	4,193,061.00	2.05

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	232,172,663.67	113.33
2	600519	贵州茅台	100,512,950.97	49.06
3	600036	招商银行	89,976,377.50	43.92
4	000725	京东方 A	69,418,681.00	33.89
5	601166	兴业银行	67,968,416.93	33.18

6	600016	民生银行	65,739,748.75	32.09
7	000651	格力电器	63,022,661.16	30.76
8	002415	海康威视	56,428,790.65	27.54
9	601398	工商银行	53,613,245.80	26.17
10	000333	美的集团	52,775,258.42	25.76
11	600887	伊利股份	52,483,189.04	25.62
12	600015	华夏银行	50,492,399.71	24.65
13	601668	中国建筑	50,222,450.00	24.51
14	601818	光大银行	50,030,957.00	24.42
15	601601	中国太保	47,951,197.66	23.41
16	002304	洋河股份	46,668,074.77	22.78
17	601988	中国银行	45,811,275.00	22.36
18	600309	万华化学	44,595,195.22	21.77
19	600030	中信证券	43,765,725.00	21.36
20	600837	海通证券	43,753,830.40	21.36
21	600000	浦发银行	42,880,724.20	20.93
22	000002	万科A	41,356,529.46	20.19
23	601628	中国人寿	38,425,429.90	18.76
24	600276	恒瑞医药	38,279,687.76	18.69
25	600019	宝钢股份	37,232,444.60	18.17
26	000858	五粮液	36,553,618.21	17.84
27	601211	国泰君安	35,958,172.66	17.55
28	000001	平安银行	35,608,389.12	17.38
29	601328	交通银行	34,406,326.32	16.79
30	601006	大秦铁路	34,278,402.67	16.73
31	000895	双汇发展	32,503,614.69	15.87
32	600816	安信信托	32,140,274.37	15.69
33	601766	中国中车	31,901,038.00	15.57
34	601688	华泰证券	31,201,887.82	15.23
35	600104	上汽集团	31,163,549.53	15.21
36	000776	广发证券	31,131,378.00	15.20
37	600031	三一重工	31,047,574.82	15.16
38	600900	长江电力	29,766,271.33	14.53
39	002027	分众传媒	29,179,040.40	14.24
40	601225	陕西煤业	28,721,168.36	14.02
41	000625	长安汽车	28,305,679.40	13.82
42	600048	保利地产	27,541,501.88	13.44
43	600050	中国联通	26,663,899.00	13.02

44	600893	航发动力	25,598,158.10	12.50
45	601186	中国铁建	25,060,956.00	12.23
46	600383	金地集团	25,045,968.69	12.23
47	600690	青岛海尔	24,524,836.12	11.97
48	002310	东方园林	24,002,014.83	11.72
49	600518	康美药业	23,899,276.33	11.67
50	601009	南京银行	23,454,336.98	11.45
51	600522	中天科技	23,441,468.31	11.44
52	601336	新华保险	22,903,732.43	11.18
53	601169	北京银行	21,350,065.63	10.42
54	000415	渤海金控	20,919,108.45	10.21
55	000568	泸州老窖	20,674,568.02	10.09
56	600886	国投电力	20,252,770.52	9.89
57	600028	中国石化	20,242,778.00	9.88
58	601390	中国中铁	19,974,988.00	9.75
59	600153	建发股份	19,594,187.55	9.56
60	600415	小商品城	18,972,703.00	9.26
61	600637	东方明珠	18,953,277.07	9.25
62	600674	川投能源	18,194,221.17	8.88
63	000069	华侨城 A	18,126,693.67	8.85
64	002636	金安国纪	18,045,587.32	8.81
65	002594	比亚迪	18,042,131.00	8.81
66	601088	中国神华	17,835,980.00	8.71
67	002236	大华股份	17,815,562.41	8.70
68	601857	中国石油	17,796,814.99	8.69
69	601899	紫金矿业	17,785,453.68	8.68
70	300072	三聚环保	17,740,109.13	8.66
71	000338	潍柴动力	17,640,104.80	8.61
72	600651	飞乐音响	17,316,338.57	8.45
73	002152	广电运通	17,032,381.49	8.31
74	002024	苏宁云商	16,886,399.96	8.24
75	601607	上海医药	16,826,429.92	8.21
76	600958	东方证券	16,750,289.64	8.18
77	000060	中金岭南	16,652,044.50	8.13
78	002142	宁波银行	16,360,571.03	7.99
79	600291	西水股份	16,334,111.00	7.97
80	601939	建设银行	16,311,716.70	7.96
81	601877	正泰电器	16,291,443.74	7.95

82	002146	荣盛发展	16,282,781.21	7.95
83	600340	华夏幸福	16,229,195.42	7.92
84	002195	二三四五	15,978,276.24	7.80
85	000538	云南白药	15,824,152.82	7.72
86	002252	上海莱士	15,749,213.80	7.69
87	600585	海螺水泥	15,498,640.06	7.57
88	600999	招商证券	15,434,191.80	7.53
89	600705	中航资本	15,371,254.37	7.50
90	300059	东方财富	15,370,733.36	7.50
91	600068	葛洲坝	15,232,132.04	7.44
92	000963	华东医药	14,954,709.52	7.30
93	000063	中兴通讯	14,819,437.09	7.23
94	000425	徐工机械	14,080,141.96	6.87
95	600583	海油工程	13,922,940.81	6.80
96	600688	上海石化	13,787,490.89	6.73
97	600757	长江传媒	13,244,818.32	6.47
98	601377	兴业证券	13,208,048.40	6.45
99	000501	鄂武商 A	13,075,323.94	6.38
100	300116	坚瑞沃能	13,035,430.77	6.36
101	000876	新希望	13,026,071.58	6.36
102	300158	振东制药	12,937,255.76	6.32
103	002466	天齐锂业	12,830,805.80	6.26
104	600271	航天信息	12,765,643.16	6.23
105	002065	东华软件	12,488,567.76	6.10
106	600570	恒生电子	12,402,181.51	6.05
107	600066	宇通客车	12,240,524.58	5.97
108	002230	科大讯飞	12,152,905.04	5.93
109	600372	中航电子	12,087,292.70	5.90
110	000513	丽珠集团	11,800,970.72	5.76
111	601555	东吴证券	11,568,716.00	5.65
112	002450	康得新	11,430,603.39	5.58
113	000166	申万宏源	11,248,968.26	5.49
114	600260	凯乐科技	11,145,368.78	5.44
115	600010	包钢股份	10,754,918.00	5.25
116	601888	中国国旅	10,736,200.10	5.24
117	600739	辽宁成大	10,668,789.64	5.21
118	002501	利源精制	10,638,883.01	5.19
119	600373	中文传媒	10,234,587.94	5.00

120	600803	新奥股份	10,203,544.22	4.98
121	002241	歌尔股份	10,173,524.00	4.97
122	600023	浙能电力	10,118,662.19	4.94
123	600352	浙江龙盛	10,034,271.98	4.90
124	001979	招商蛇口	10,007,475.94	4.88
125	601098	中南传媒	9,916,500.11	4.84
126	600038	中直股份	9,768,210.00	4.77
127	600516	方大炭素	9,609,229.00	4.69
128	002736	国信证券	9,541,824.32	4.66
129	601198	东兴证券	9,486,410.00	4.63
130	600009	上海机场	9,343,017.81	4.56
131	600061	国投资本	9,332,923.88	4.56
132	601669	中国电建	9,233,438.00	4.51
133	601677	明泰铝业	9,225,447.11	4.50
134	002008	大族激光	9,207,359.00	4.49
135	000793	华闻传媒	9,178,143.31	4.48
136	000783	长江证券	9,098,559.35	4.44
137	600606	绿地控股	8,982,720.44	4.38
138	600029	南方航空	8,769,704.00	4.28
139	601788	光大证券	8,725,568.43	4.26
140	600685	中船防务	8,719,786.33	4.26
141	000036	华联控股	8,715,147.00	4.25
142	002673	西部证券	8,663,076.14	4.23
143	600741	华域汽车	8,603,406.25	4.20
144	600835	上海机电	8,338,422.80	4.07
145	600582	天地科技	8,337,269.25	4.07
146	300144	宋城演艺	8,265,301.74	4.03
147	002202	金风科技	8,221,054.67	4.01
148	002456	欧菲科技	8,048,705.00	3.93
149	601985	中国核电	8,038,617.00	3.92
150	600089	特变电工	7,903,774.88	3.86
151	000423	东阿阿胶	7,867,989.00	3.84
152	000917	电广传媒	7,860,549.99	3.84
153	600312	平高电气	7,781,764.22	3.80
154	000528	柳工	7,739,153.34	3.78
155	600801	华新水泥	7,681,406.41	3.75
156	600487	亨通光电	7,664,362.00	3.74
157	000921	海信科龙	7,650,400.98	3.73

158	600297	广汇汽车	7,635,140.82	3.73
159	601992	金隅股份	7,597,165.00	3.71
160	600406	国电南瑞	7,535,951.00	3.68
161	600115	东方航空	7,448,473.80	3.64
162	300033	同花顺	7,405,615.00	3.61
163	600073	上海梅林	7,399,467.88	3.61
164	600219	南山铝业	7,263,955.00	3.55
165	600547	山东黄金	7,255,055.00	3.54
166	000936	华西股份	7,240,421.71	3.53
167	601800	中国交建	7,230,800.40	3.53
168	601901	方正证券	7,114,808.00	3.47
169	601155	新城控股	6,987,628.21	3.41
170	600109	国金证券	6,947,865.76	3.39
171	601618	中国中冶	6,924,980.25	3.38
172	600362	江西铜业	6,808,071.95	3.32
173	000951	中国重汽	6,787,239.50	3.31
174	002500	山西证券	6,754,221.00	3.30
175	600208	新湖中宝	6,752,501.00	3.30
176	600588	用友网络	6,738,751.39	3.29
177	000400	许继电气	6,717,440.18	3.28
178	002424	贵州百灵	6,713,864.75	3.28
179	000070	特发信息	6,685,694.00	3.26
180	000623	吉林敖东	6,682,360.90	3.26
181	600642	申能股份	6,589,546.60	3.22
182	000789	万年青	6,582,259.51	3.21
183	000686	东北证券	6,342,406.47	3.10
184	600660	福耀玻璃	6,320,162.26	3.09
185	600118	中国卫星	6,303,957.02	3.08
186	600079	人福医药	6,212,032.48	3.03
187	600196	复星医药	6,126,529.54	2.99
188	600183	生益科技	6,085,876.84	2.97
189	600535	天士力	6,078,587.46	2.97
190	600018	上港集团	5,946,635.88	2.90
191	601727	上海电气	5,853,293.57	2.86
192	600111	北方稀土	5,800,249.00	2.83
193	000059	华锦股份	5,787,220.52	2.82
194	300133	华策影视	5,770,657.50	2.82
195	600039	四川路桥	5,767,702.00	2.82

196	002049	紫光国芯	5,738,565.56	2.80
197	600230	沧州大化	5,728,452.98	2.80
198	600420	现代制药	5,634,939.11	2.75
199	000738	航发控制	5,612,644.88	2.74
200	000630	铜陵有色	5,540,522.00	2.70
201	601099	太平洋	5,537,437.00	2.70
202	600548	深高速	5,528,045.36	2.70
203	000959	首钢股份	5,513,495.88	2.69
204	600177	雅戈尔	5,478,209.84	2.67
205	601111	中国国航	5,466,392.00	2.67
206	000671	阳光城	5,406,547.00	2.64
207	002183	怡亚通	5,377,431.90	2.62
208	300287	飞利信	5,375,274.17	2.62
209	600703	三安光电	5,342,079.00	2.61
210	601018	宁波港	5,304,324.00	2.59
211	600100	同方股份	5,300,417.56	2.59
212	000826	启迪桑德	5,252,761.22	2.56
213	600256	广汇能源	5,199,131.00	2.54
214	600369	西南证券	5,165,360.76	2.52
215	601229	上海银行	5,118,059.70	2.50
216	600008	首创股份	5,077,011.00	2.48
217	002558	巨人网络	5,046,589.60	2.46
218	002174	游族网络	5,039,166.47	2.46
219	601118	海南橡胶	4,938,710.00	2.41
220	600483	福能股份	4,931,943.43	2.41
221	000008	神州高铁	4,885,272.54	2.38
222	600489	中金黄金	4,803,879.54	2.34
223	600350	山东高速	4,766,471.00	2.33
224	000728	国元证券	4,728,009.00	2.31
225	000719	大地传媒	4,644,397.52	2.27
226	600718	东软集团	4,584,509.86	2.24
227	300085	银之杰	4,564,216.87	2.23
228	002555	三七互娱	4,491,753.10	2.19
229	601998	中信银行	4,395,412.00	2.15
230	300017	网宿科技	4,381,949.03	2.14
231	300168	万达信息	4,357,952.13	2.13
232	000718	苏宁环球	4,329,203.20	2.11
233	600098	广州发展	4,328,527.60	2.11

234	601633	长城汽车	4,299,039.10	2.10
235	300393	中来股份	4,265,738.00	2.08
236	300202	聚龙股份	4,215,388.08	2.06

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,452,901,495.67
卖出股票收入（成交）总额	4,622,749,405.69

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金本期投资的前十名证券中，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。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,441,835.26
2	应收证券清算款	331,683.97
3	应收股利	-
4	应收利息	11,162.78
5	应收申购款	243,207.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,027,889.80

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600332	白云山	10,576,020.54	4.21	重大资产重组停牌
2	002470	金正大	9,252,609.24	3.68	重大事项停牌
3	601600	中国铝业	6,256,872.00	2.49	重大资产重组停牌
4	000540	中天金融	4,487,910.00	1.79	重大资产重组停牌

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600664	哈药股份	13,147,864.60	5.23	重大资产重组停牌
2	000900	现代投资	2,694,106.25	1.07	重大资产重组停牌
3	300116	坚瑞沃能	2,432,806.92	0.97	重大资产重组停牌

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (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
12,911	17,371.54	75,207,919.82	33.53%	149,076,002.59	66.47%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究 部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 9 月 3 日）基金份额总额	2,423,832,173.19
本报告期期初基金份额总额	158,390,048.09
本报告期基金总申购份额	5,275,877,561.26
减：本报告期基金总赎回份额	5,209,983,686.94
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	224,283,922.41

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(一) 基金管理人重大人事变动

1、经国海富兰克林基金管理有限公司 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，由吴显玲女士先生担任公司董事长。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。

3、原富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金及富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金的基金经理鲍翔先生自 2017 年 9 月 19 日起不再担任上述两只基金的基金经理，由共同管理上述两只基金的基金经理张志强先生单独管理。公司已办理完成上述基金经理的注销手续。

(二) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人应支付给会计师事务所的审计费用是人民币 63000.00 元，本基金自成立以来对其进行审计的均为普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

（一）基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

（二）基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
中信证券	2	1,696,853,201.60	18.71%	1,580,279.62	19.18%	-
安信证券	2	1,060,154,324.02	11.69%	983,860.38	11.94%	-
天风证券	1	978,435,846.15	10.79%	714,519.84	8.67%	-
银河证券	1	803,888,780.72	8.87%	748,661.81	9.09%	-
兴业证券	1	787,396,045.66	8.68%	733,302.25	8.90%	-
海通证券	1	713,125,236.95	7.86%	664,133.59	8.06%	-
方正证券	1	613,534,830.24	6.77%	568,419.49	6.90%	-
国海证券	2	578,185,057.57	6.38%	538,420.64	6.53%	-
国信证券	1	549,284,237.43	6.06%	511,545.66	6.21%	-
中信建投	1	537,913,745.34	5.93%	500,958.24	6.08%	-
华安证券	1	509,356,681.13	5.62%	473,460.03	5.75%	-
东兴证券	1	191,076,499.71	2.11%	177,948.92	2.16%	-
中泰证券	1	36,203,607.49	0.40%	33,716.55	0.41%	-
招商证券	1	11,748,480.13	0.13%	10,941.37	0.13%	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

第一创业	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	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：

- ① 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- ② 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；
- ③ 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；
- ④ 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；
- ⑤ 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：

- ① 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；
- ② 具有数量研究和开发能力；
- ③ 能有效组织上市公司调研；
- ④ 能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；
- ⑤ 上门路演和电话会议的质量；
- ⑥ 与我公司投资和研究人员的信息交流和沟通能力；
- ⑦ 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，本基金新增平安证券深圳及上海交易单元各 1 个，西藏东方财富证券深圳及上海交易单元各 1 个。退租中投证券深圳交易单元 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	3,500,000,000.00	57.38%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	2,600,000,000.00	42.62%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

北京高华	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017 年 11 月 22 日至 2017 年 12 月 25 日	-	265,184,895.55	265,184,895.55	-	-
	2	2017 年 12 月 26 日至 2017 年 12 月 31 日	-	61,208,540.92	-	61,208,540.92	27.29%
	3	2017 年 6 月 15 日至 2017 年 7 月 10 日	-	37,912,416.29	37,912,416.29	-	-
	4	2017 年 7 月 11 日	-	71,123,044.10	71,123,044.10	-	-
	5	2017 年 7 月 13 日至 2017 年 7 月 16 日	-	571,836,311.65	571,836,311.65	-	-
	6	2017 年 7 月 12 日	-	355,365,316.28	355,365,316.28	-	-
	7	2017 年 7 月 21 日至 2017 年 11 月 22 日	-	501,470,153.05	501,470,153.05	-	-

8	2017 年 7 月 20 日 至 2017 年 11 月 15 日	-	733,842,102.15	733,842,102.15	-	-
产品特有风险						
<p>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。</p> <p>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。</p>						

国海富兰克林基金管理有限公司

2018 年 3 月 27 日