富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金
2018年半年度报告摘要

2018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：2018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。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2018年8月22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2018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	国富中证100指数增强分级		
基金主代码	164508		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年3月26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	62,811,179.10份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	国富中证100指数增强分级A	国富中证100指数增强分级B	国富中证100指数增强分级
下属分级基金的交易代码	150135	150136	164508
报告期末下属分级基金份额总额	9,483,858.00份	9,483,859.00份	43,843,462.10份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金。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，同时采取适当的增强策略，在严格控制跟踪误差风险的基础上，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，本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。
投资策略	本基金基于被动复制的指数化投资方法，在严格控制跟踪误差风险的基础上，适度运用资产配置调整、行业配置调整、指数成份股权重优化等主动增强策略，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。 1、资产配置策略 本基金采取指数增强策略。为控制基金的跟踪误差风险，本基金的资产配置将保持与业绩比较基准基本一致，只在股票、债券（主要是国债）、现金等各大类资产间进行小幅度的主动调整，追求适度超越业绩比较基准的收益目标。 2、股票投资策略 为严格控制跟踪误差风险，本基金的股票投资以被动复制跟踪标的指数为主，辅以适度 的增强策略。 3、债券投资策略 本基金债券投资的主要目的是在保证基金资产流动性的前提下，提高基金资产的投资收益。本基金主要投资于信用等级高、流动性好的政府债券、金融债、企业债等。

	本基金在进行债券组合管理中，将基于对国内外宏观经济形势、国家财政货币政策动向、市场资金流动性等方面的分析，对利率、信用利差变化的趋势进行判断，综合考察债券的投资价值和流动性等因素，构建和调整债券投资组合。 4、股指期货投资策略 本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与股指期货交易，以提高投资管理效率，降低跟踪误差风险。		
业绩比较基准	中证100指数收益率*95%+银行同业存款利率*5%		
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，属于高风险的证券投资品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。在本基金分级运作期内，从本基金所分离出来的两类基金份额来看，由于基金收益分配的安排，国富中证100 A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征；国富中证100 B份额则表现出高风险、收益相对较高的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	国富中证100A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征。	国富中证100B份额则表现出高风险、收益相对较高的特征。	本基金为股票指数增强型基金，属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	6,287,242.58
本期利润	-5,617,223.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0823
本期基金份额净值增长率	-10.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0070
期末基金资产净值	58,244,028.72
期末基金份额净值	0.927

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

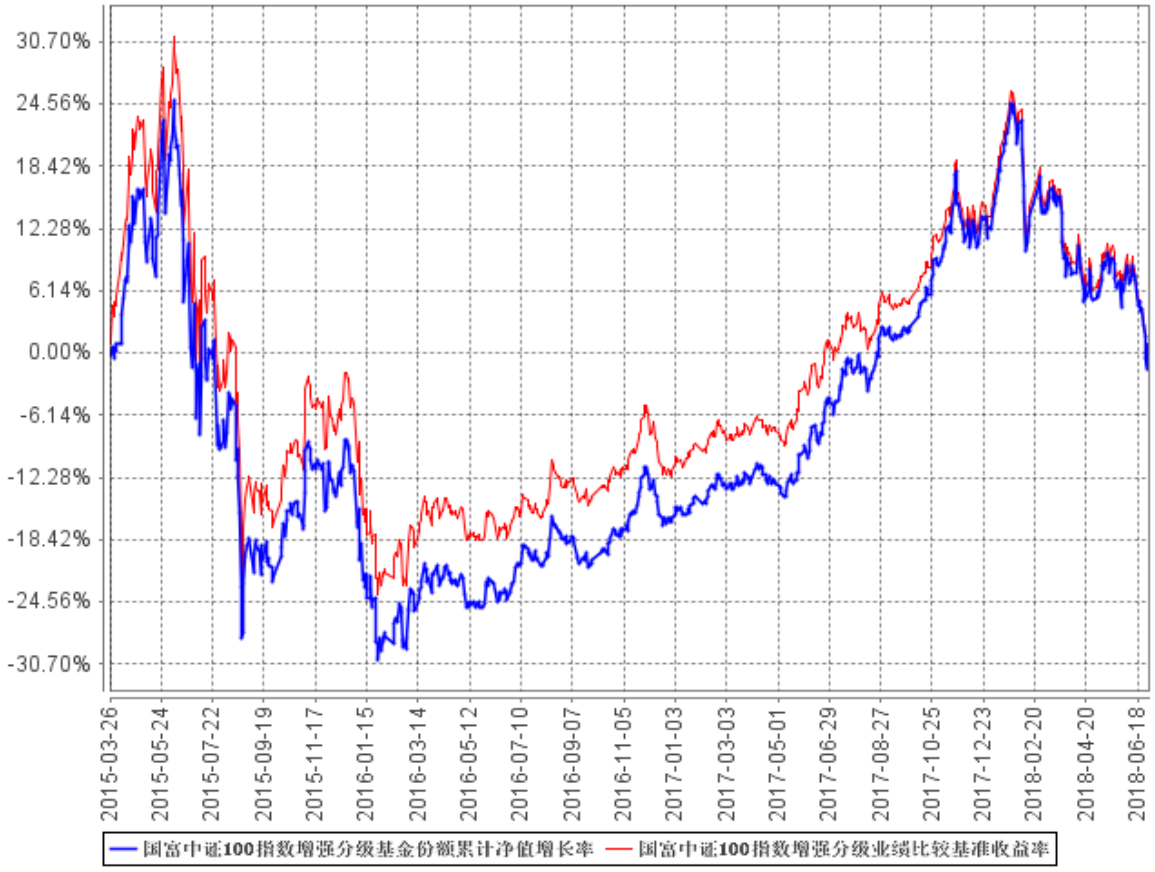
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.79%	1.19%	-6.40%	1.19%	0.61%	0.00%
过去三个月	-7.58%	1.13%	-8.22%	1.12%	0.64%	0.01%
过去六个月	-10.36%	1.17%	-11.16%	1.16%	0.80%	0.01%
过去一年	5.61%	0.98%	-0.11%	0.96%	5.72%	0.02%
过去三年	-4.09%	1.40%	-9.85%	1.36%	5.76%	0.04%
自基金合同	0.61%	1.51%	0.85%	1.48%	-0.24%	0.03%

生效起至今						

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

国富中证100指数增强分级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 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。

3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（ 2018 年 1 月 1 日 －2018 年 6 月 30 日 ）
中证 100A 与中证 100B 基金份额配比	1:1
期末中证 100A 份额参考净值	1.025
期末中证 100A 份额累计参考净值	1.171
期末中证 100B 份额参考净值	0.829
期末中证 100B 份额累计参考净值	0.829
中证 100A 的预计年收益率	5.00%

§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33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	2015年3月26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。

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《富兰克林国海中证100指数增强分级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

2018年上半年，A股市场震荡下行，所有宽基指数均有不同幅度的下跌，大盘蓝筹股票和创业板龙头股票表现略好。行业方面，仅休闲服务、医药生物、食品饮料行业取得小幅度上涨，通信、电气设备、机械设备、有色金属、建筑装饰、国防军工、证券、传媒、电子、公用事业等行业均下跌超过20%。上半年，中证100指数下跌了11.77%。

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。报告期内，所用模型表现一般，取得了一定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日，本基金份额净值为0.927元。本报告期，份额净值下跌10.36%，同期业绩比较基准下跌11.16%，基金表现超越业绩基准0.80%，期间基金年化跟踪误差为1.08%。

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年下半年，伴随全球贸易摩擦的不断演化，中国经济转型加速进入后半程，其迫切性和不确定性都在增加。在继续推进防风险、去杠杆的同时，为避免对实体经济产生不可控的负面影响，预计在具体执行上将延续近期相对具有弹性的特点，包括维持适当的社会融资水平、维护市场流动性的基本稳定、加速推进个税改革等促进消费升级和扩大内需的政策等。同时，对于先进制造业和高新技术产业，预计将出台更多促进政策，加速先进产业的追赶和产业结构升级。

对A股市场而言，目前股票价格水平已经比较充分地反映了投资者对于实体经济增长进一步放缓和中美贸易摩擦升温的预期，以及在资管新规约束下股票市场流动性偏紧的预期。展望2018年下半年，这些负面因素依然存在。同时，今后一段时期，A股质押平仓风险爆发、信用债市场的风险事件等负面事件预计仍将不时发生。结合目前的市场状态和上述因素，预计下半年的市场将保持震荡态势。

投资策略方面，下半年仍将保持均衡配置，控制主动投资风险。同时，力争通过选股和其它有效策略获取超额收益。

本基金将继续按照基金合同及相关法律法规要求，努力做好基金投资工作，争取未来更好的

长期投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会（简称"估值委员会"），并已制订了《公允估值管理办法》。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由总经理或其任命者负责，成员包括投研、风险控制、监察稽核、交易、基金核算方面的部门主管，相关人员均具有丰富的证券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

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在对富兰克林国海中证100指数增强分级证券投资基金（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：富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金

报告截止日： 2018年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产：		
银行存款	4,389,355.54	5,694,753.86
结算备付金	-	18,758.30
存出保证金	23,838.32	71,035.53
交易性金融资产	54,140,897.53	82,214,565.03
其中：股票投资	54,140,897.53	82,214,565.03
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	483,801.47	-
应收利息	786.22	1,124.12
应收股利	-	-
应收申购款	42,559.27	25,213.66
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	59,081,238.35	88,025,450.50
负债和所有者权益	**本期末 2018年6月30日**	**上年度末 2017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	496,784.92	-
应付赎回款	76,217.15	239,861.41
应付管理人报酬	50,313.61	77,863.37
应付托管费	11,068.99	17,129.93
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,243.29	38,346.76

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	195,581.67	370,119.08
负债合计	837,209.63	743,320.55
所有者权益：		
实收基金	57,803,854.36	77,713,814.32
未分配利润	440,174.36	9,568,315.63
所有者权益合计	58,244,028.72	87,282,129.95
负债和所有者权益总计	59,081,238.35	88,025,450.50

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额总额62,811,179.10份。其中国富中证100指数增强分级的份额总额为43,843,462.10份，基金份额净值0.927元；国富中证100指数增强分级A份额总额为9,483,858.00份，基金份额参考净值1.025元；国富中证100指数增强分级B份额总额为9,483,859.00份，基金份额参考净值0.829元。

6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
一、收入	-4,854,623.60	22,897,156.33
1.利息收入	17,430.88	51,084.15
其中：存款利息收入	17,430.88	51,073.89
债券利息收入	-	10.26
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）	6,985,595.78	2,415,384.04
其中：股票投资收益	6,285,102.65	882,280.29
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	3,417.84
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	700,493.13	1,529,685.91

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-11,904,466.23	20,304,941.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	46,815.97	125,746.79
减：二、费用	762,600.05	2,715,935.78
1．管理人报酬	349,062.99	903,435.88
2．托管费	76,793.81	198,755.93
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	89,349.19	1,302,503.71
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7．其他费用	247,394.06	311,240.26
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）	-5,617,223.65	20,181,220.55
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-5,617,223.65	20,181,220.55

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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）	77,713,814.32	9,568,315.63	87,282,129.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,617,223.65	-5,617,223.65
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）	-19,909,959.96	-3,510,917.62	-23,420,877.58
其中：1.基金申购款	16,144,756.48	2,706,928.27	18,851,684.75
2.基金赎回款	-36,054,716.44	-6,217,845.89	-42,272,562.33

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）	57,803,854.36	440,174.36	58,244,028.72
项目	**上年度可比期间 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）	89,368,415.30	-14,624,690.52	74,743,724.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,181,220.55	20,181,220.55
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）	85,991,398.87	-13,713,657.42	72,277,741.45
其中：1.基金申购款	203,086,964.81	-27,704,694.91	175,382,269.90
2.基金赎回款	-117,095,565.94	13,991,037.49	-103,104,528.45
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）	175,359,814.17	-8,157,127.39	167,202,686.78

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	胡昕彦	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

富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金(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[2012]第426号《关于核准富兰克林国海中证100指数增强型分级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《富兰克林国海中证100指数增强型分级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675,295,672.74元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第231号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》于2015年3月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为675,455,568.42份基金份额，其中认购资金利息折合159,895.68份基金份额。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》和《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金的基金份额包括确认为富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金之基础份额(以下简称“国富中证100份额”)，富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“国富中证100A份额”)及富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“国富中证100B份额”)。其中，国富中证100A份额、国富中证100B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。本基金净资产优先确保国富中证100A份额的本金及国富中证100A份额累计约定日应得收益，即国富中证100A份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额；本基金在优先确保国富中证100A份额的本金及累计约定日应得收益后的剩余净资产计为国富中证100B份额的净资产，即国富中证100B份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额。基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为国富中证100份额；场内认购的全部份额将按1:1的比例确认为国富中证100A份额与国富中证100B份额。本基金基金合同生效后，国富中证100份额与国富中证100A份额、国富中证100B份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。基金份额的分拆，指基金份额持有人将其持有的国富中证100份额按照2份场内国富中证100份额对应1份国富中证100A份额与1份国富中证100B份额的比例进行转换的行为；基金份额的合并，指基金份额持有人将其持有的国富中证100A份额与国富中证100B份额按照国富中证100A份额与1份国富中证100B份额对应2份场内国富中证100份额的比例进行转换的行为。

合同生效后，国富中证100份额可办理场外与场内申购和赎回，但不上市交易；国富中证100 A份额、国富中证100 B份额只上市交易，不可单独申购和赎回。本基金的分级运作期为五年(含五年)，分级运作期满后，满足基金合同约定的存续条件，本基金无需召开基金份额持有人大会，国富中证100 A 份额和国富中证100 B份额以各自的份额净值为基础，按照国富中证

100份额的份额净值自动转换为上市开放式基金(LOF)，基金名称为“富兰克林国海中证100指数增强型证券投资基金(LOF)”。本基金转为上市开放式基金(LOF)后，投资者可通过场内、场外进行基金份额的申购、赎回。

本基金在存续期内的每个会计年度(基金合同生效日所在会计年度除外)第一个工作日对登记在册的国富中证100份额、国富中证100 A份额进行基金的定期份额折算。国富中证100 A份额和国富中证100 B份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算，对国富中证100 A份额的应得收益进行定期份额折算，每2份国富中证100份额将按1份国富中证100 A份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，国富中证100 A份额和国富中证100 B份额的份额配比保持1:1的比例。对于国富中证100 A份额的约定年化应得收益，即国富中证100 A份额每个会计年度12月31日份额净值超过1.000元的部分，将折算为场内国富中证100份额分配给国富中证100 A份额持有人。当国富中证100份额的基金份额净值达到2.000元或国富中证100 B份额的基金份额参考净值达到0.250元时，本基金即可确定折算基准日，进行不定期份额折算。在折算基准日，本基金将对登记在册的国富中证100份额、国富中证100 A份额和国富中证100 B份额分别进行折算。份额折算后本基金将确保国富中证100 A份额和国富中证100 B份额的比例为1:1；份额折算后国富中证100份额的基金份额净值、国富中证100 A份额和国富中证100 B份额的参考净值均调整为1.000元。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]第122号文审核同意，投资者场内认购的全部国富中证100份额按1:1比例自动分拆成的国富中证100 A份额和国富中证100 B份额于2015年4月10日在深圳证券交易所上市。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金作为指数型基金，采用被动复制策略，跟踪标的指数市场表现，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。本基金资产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、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如果法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产净值的比例为90%-95%，其中投资于股票资产的比例不低于基金资产净值的90%，投资于中证100指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产净值的80%；债券、现金以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为5%-10%。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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金投资组合的业绩比较基准为中证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

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》、《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018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

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行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、桂财综[2011]13号《关于调整我区地方教育附加征收标准有关问题的通知》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。

(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)本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	-	-	100,495,041.07	11.42%

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

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	93,090.94	11.41%	-	-

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。

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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	349,062.99	903,435.88
其中：支付销售机构的客户维护费	92,996.95	122,860.70

注：

1.支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%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 1.00% / 当年天数。

2.本基金分级运作期届满转换为上市开放式基金(LOF)后，管理人报酬的年费率将调整为0.85%，计提方式不变。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	76,793.81	198,755.93

注：

1.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0.22%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 0.22% / 当年天数。

2.本基金分级运作期届满转换为上市开放式基金(LOF)后，托管费的年费率将调整为0.15%，计提方式不变。

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发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 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（2017年1月1日至2017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（2017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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,389,355.54	17,015.88	10,535,278.10	42,808.26

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（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股未上市	9.00	9.00	1,000	9,000.00	9,000.00	-

6.4.9.2 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
601390	中国中铁	2018年5月	重大资	7.47	2018年8月	7.25	54,900	482,829.19	410,103.00	-

		7日	产重组停牌		20日					
002739	万达电影	2017年7月4日	重大资产重组停牌	38.03	-	-	8,900	491,051.55	338,467.00	-
601727	上海电气	2018年6月6日	重大事项停牌	6.34	2018年8月7日	5.71	13,900	139,850.81	88,126.00	-

注：本基金截至2018年6月30日止持有以上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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 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2018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53,295,201.53元，第二层次的余额为845,696.00元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次81,713,730.58元，第二层次：500,052.45元，第三层：782.00 元)。

(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

2018年1月1日	782.00
购买	-
出售	782.00
转入第三层级	-
转出第三层级	-
当期损失总额	-
- 计入损益的损失	-
2018年6月30日	-
2018年6月30日仍持有的资产计入2018年度损益的未实现利得或损失的变动 ——公允价值变动损益	-

本基金上年末第三层次公允价值余额为782.00，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2018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(2017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	54,140,897.53	91.64
	其中：股票	54,140,897.53	91.64
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	4,389,355.54	7.43
7	其他各项资产	550,985.28	0.93
8	合计	59,081,238.35	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,831,967.00	3.15
C	制造业	19,452,130.16	33.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,697,860.88	2.92
E	建筑业	2,064,973.40	3.55
F	批发和零售业	616,202.88	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,419,783.00	2.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,013,509.60	1.74
J	金融业	22,685,734.45	38.95
K	房地产业	2,611,166.60	4.48
L	租赁和商务服务业	400,102.56	0.69
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	53,793,430.53	92.36

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,000.00	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	338,467.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	347,467.00	0.60

7.2.3 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。

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

7.3.1 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	85,300	4,996,874.00	8.58
2	600519	贵州茅台	3,977	2,909,016.42	4.99
3	000651	格力电器	44,300	2,088,745.00	3.59
4	600036	招商银行	73,100	1,932,764.00	3.32
5	601166	兴业银行	118,100	1,700,640.00	2.92
6	600016	民生银行	223,300	1,563,100.00	2.68
7	000333	美的集团	29,600	1,545,712.00	2.65
8	600276	恒瑞医药	17,681	1,339,512.56	2.30
9	601288	农业银行	361,200	1,242,528.00	2.13
10	000858	五 粮 液	14,921	1,133,996.00	1.95
11	600030	中信证券	66,500	1,101,905.00	1.89
12	600104	上汽集团	31,271	1,094,172.29	1.88
13	600887	伊利股份	38,808	1,082,743.20	1.86
14	600900	长江电力	65,700	1,060,398.00	1.82
15	000002	万　科A	42,100	1,035,660.00	1.78
16	002415	海康威视	27,325	1,014,577.25	1.74
17	601668	中国建筑	175,840	960,086.40	1.65
18	601169	北京银行	152,400	918,972.00	1.58
19	600000	浦发银行	89,530	855,906.80	1.47
20	601601	中国太保	26,100	831,285.00	1.43
21	600028	中国石化	114,500	743,105.00	1.28
22	601398	工商银行	137,600	732,032.00	1.26
23	601818	光大银行	187,200	685,152.00	1.18
24	000725	京东方A	186,200	659,148.00	1.13
25	600019	宝钢股份	78,500	611,515.00	1.05
26	600048	保利地产	48,763	594,908.60	1.02
27	002304	洋河股份	4,513	593,910.80	1.02
28	600837	海通证券	60,801	575,785.47	0.99
29	601006	大秦铁路	68,300	560,743.00	0.96
30	600690	青岛海尔	28,488	548,678.88	0.94
31	000001	平安银行	60,312	548,236.08	0.94
32	600585	海螺水泥	16,300	545,724.00	0.94

33	600309	万华化学	11,900	540,498.00	0.93
34	601211	国泰君安	35,200	518,848.00	0.89
35	600518	康美药业	22,000	503,360.00	0.86
36	000538	云南白药	4,606	492,657.76	0.85
37	603288	海天味业	5,900	434,476.00	0.75
38	601328	交通银行	75,600	433,944.00	0.75
39	601390	中国中铁	54,900	410,103.00	0.70
40	001979	招商蛇口	21,300	405,765.00	0.70
41	600015	华夏银行	54,140	403,343.00	0.69
42	002027	分众传媒	41,808	400,102.56	0.69
43	300059	东方财富	29,520	389,073.60	0.67
44	002024	苏宁易购	27,486	387,002.88	0.66
45	600703	三安光电	19,900	382,478.00	0.66
46	600050	中国联通	77,500	381,300.00	0.65
47	601766	中国中车	49,280	379,456.00	0.65
48	000776	广发证券	27,900	370,233.00	0.64
49	601229	上海银行	23,300	367,208.00	0.63
50	601688	华泰证券	24,200	362,274.00	0.62
51	000895	双汇发展	12,900	340,689.00	0.58
52	601009	南京银行	43,120	333,317.60	0.57
53	601186	中国铁建	37,200	320,664.00	0.55
54	600919	江苏银行	48,300	309,603.00	0.53
55	000568	泸州老窖	5,000	304,300.00	0.52
56	600999	招商证券	21,300	291,384.00	0.50
57	601628	中国人寿	12,900	290,508.00	0.50
58	601088	中国神华	14,400	287,136.00	0.49
59	601225	陕西煤业	34,600	284,412.00	0.49
60	000069	华侨城A	39,300	284,139.00	0.49
61	601989	中国重工	66,000	266,640.00	0.46
62	002142	宁波银行	16,230	264,386.70	0.45
63	601336	新华保险	6,000	257,280.00	0.44
64	600958	东方证券	25,800	235,554.00	0.40
65	601933	永辉超市	30,000	229,200.00	0.39
66	600009	上海机场	3,900	216,372.00	0.37
67	601899	紫金矿业	58,600	211,546.00	0.36
68	600115	东方航空	31,500	208,530.00	0.36
69	600340	华夏幸福	7,200	185,400.00	0.32
70	600795	国电电力	70,320	184,238.40	0.32
71	002736	国信证券	19,868	180,798.80	0.31

72	601857	中国石油	22,200	171,162.00	0.29
73	000166	申万宏源	37,900	165,623.00	0.28
74	002594	比亚迪	3,400	162,112.00	0.28
75	002558	巨人网络	6,700	159,326.00	0.27
76	601669	中国电建	29,100	155,976.00	0.27
77	600893	航发动力	6,900	154,008.00	0.26
78	601018	宁波港	36,500	153,665.00	0.26
79	601985	中国核电	27,000	152,550.00	0.26
80	600011	华能国际	23,800	151,368.00	0.26
81	603993	洛阳钼业	21,400	134,606.00	0.23
82	601998	中信银行	21,600	134,136.00	0.23
83	601800	中国交建	11,200	127,568.00	0.22
84	600018	上港集团	19,000	113,240.00	0.19
85	600606	绿地控股	16,100	105,294.00	0.18
86	601633	长城汽车	10,500	103,110.00	0.18
87	600023	浙能电力	20,428	95,194.48	0.16
88	601618	中国中冶	27,200	90,576.00	0.16
89	601727	上海电气	13,900	88,126.00	0.15
90	601111	中国国航	9,700	86,233.00	0.15
91	601360	三六零	2,900	83,810.00	0.14
92	601881	中国银河	10,100	82,113.00	0.14
93	002352	顺丰控股	1,800	81,000.00	0.14
94	600010	包钢股份	50,440	78,182.00	0.13
95	601238	广汽集团	4,900	54,586.00	0.09
96	600025	华能水电	17,800	54,112.00	0.09

7.3.2 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	002739	万达电影	8,900	338,467.00	0.58
2	603693	江苏新能	1,000	9,000.00	0.02

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600703	三安光电	843,376.00	0.97
2	000651	格力电器	831,501.00	0.95
3	000895	双汇发展	827,030.00	0.95
4	600887	伊利股份	559,216.00	0.64
5	601328	交通银行	553,600.00	0.63
6	601229	上海银行	550,186.00	0.63
7	600309	万华化学	523,996.00	0.60
8	600519	贵州茅台	514,667.00	0.59
9	000001	平安银行	435,880.00	0.50
10	603288	海天味业	425,176.00	0.49
11	601688	华泰证券	376,180.00	0.43
12	600919	江苏银行	337,700.00	0.39
13	601601	中国太保	335,511.00	0.38
14	000568	泸州老窖	334,987.00	0.38
15	600276	恒瑞医药	309,462.00	0.35
16	600958	东方证券	293,940.00	0.34
17	600036	招商银行	275,448.00	0.32
18	002027	分众传媒	267,840.00	0.31
19	601288	农业银行	261,612.00	0.30
20	601225	陕西煤业	259,802.00	0.30

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	601318	中国平安	1,948,287.00	2.23
2	600036	招商银行	1,897,770.00	2.17
3	600519	贵州茅台	1,751,615.00	2.01
4	000001	平安银行	1,319,370.00	1.51
5	601398	工商银行	1,293,999.00	1.48
6	000651	格力电器	1,243,734.00	1.42
7	600887	伊利股份	1,226,844.00	1.41
8	000333	美的集团	1,123,113.00	1.29

9	600016	民生银行	925,553.00	1.06
10	601166	兴业银行	890,360.00	1.02
11	601601	中国太保	739,945.00	0.85
12	000895	双汇发展	732,299.00	0.84
13	601668	中国建筑	713,423.00	0.82
14	600030	中信证券	706,697.00	0.81
15	600104	上汽集团	624,826.00	0.72
16	000002	万　科A	580,435.00	0.67
17	600000	浦发银行	551,159.00	0.63
18	000725	京东方A	534,108.00	0.61
19	002415	海康威视	515,980.00	0.59
20	601009	南京银行	504,105.00	0.58

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	14,651,006.22
卖出股票收入（成交）总额	37,105,310.14

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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，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、处罚的证券如下：

兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）于2018年5月4日收到中国银行保险监

督管理委员会（以下简称“中国银保监会”）出具的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监银罚决字〔2018〕1号）》，就兴业银行主要违法违规事实公告如下:（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。

中国银保监会处以罚款人民币5,870万元。

本基金对兴业银行投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件仅对兴业银行短期经营有一定影响，不改变长期投资价值。同时由于本基金看好银行整体的长期发展前景，因此买入兴业银行。本基金管理人对该股的投资决策遵循公司的投资决策制度。

招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）于2018年5月4日收到中国银行保险监督管理委员会（以下简称“中国银保监会”）出具的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银监罚决字〔2018〕1号）》，就招商银行主要违法违规事实公告如下:（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。

中国银保监会对招商银行做出如下行政处罚:没收违法所得人民币3.024万元，处以罚款人民币6,570万元，罚没合计人民币6,573.024万元。

本基金对招商银行投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件仅对招商银行短期经营有一定影响，不改变长期投资价值。同时由于本基金看好银行的长期发展前景，因此买入招商银行。本基金管理人对该股的投资决策遵循公司的投资决策制度。

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	23,838.32
2	应收证券清算款	483,801.47
3	应收股利	-
4	应收利息	786.22
5	应收申购款	42,559.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	550,985.28

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 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	002739	万达电影	338,467.00	0.58	重大资产重组停牌
2	603693	江苏新能	9,000.00	0.02	新股未上市

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国富中证100指数增强分级A	64	148,185.28	2,480,197.00	26.15%	7,003,661.00	73.85%
国富中证100指数增强分级B	330	28,738.97	20,300.00	0.21%	9,463,559.00	99.79%
国富中证100指数增强分级	2,792	15,703.25	650,128.00	1.48%	43,193,334.10	98.52%
合计	3,186	19,714.75	3,150,625.00	5.02%	59,660,554.10	94.98%

8.2 期末上市基金前十名持有人

国富中证100指数增强分级A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	梁小红	3,297,110.00	34.77%
2	泰康人寿保险有限责任公司-分红-个人分红-019L-FH002深	2,068,860.00	21.81%
3	乔传雄	702,400.00	7.41%
4	沈芳	521,151.00	5.50%
5	张诗琮	473,500.00	4.99%
6	闫改英	467,733.00	4.93%
7	梁志云	325,878.00	3.44%
8	王之凡	315,800.00	3.33%
9	中国太平洋财产保险-传统-普通保险产品-013C-CT001深	166,700.00	1.76%

10	石如英	160,200.00	1.69%

国富中证100指数增强分级B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	项燕	1,794,517.00	18.92%
2	张卫国	768,900.00	8.11%
3	任爱	519,000.00	5.47%
4	张玲	504,300.00	5.32%
5	梁志云	360,678.00	3.80%
6	曾庆梅	333,400.00	3.52%
7	林少逸	320,906.00	3.38%
8	肖华	257,000.00	2.71%
9	邹木兰	172,400.00	1.82%
10	邓义勇	170,000.00	1.79%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国富中证100指数增强分级A	0
	国富中证100指数增强分级B	0
	国富中证100指数增强分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国富中证100指数增强分级A	0
	国富中证100指数增强分级B	0
	国富中证100指数增强分级	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富中证100指数增强分级A	国富中证100指数增强分级B	国富中证100指数增强分级
基金合同生效日（2015年3月26日）基金份额总额	117,906,583.00	117,906,584.00	439,642,401.42
本报告期期初基金份额总额	10,919,465.00	10,919,466.00	60,643,021.38
本报告期基金总申购份额	-	-	17,541,244.06
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	39,176,354.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-1,435,607.00	-1,435,607.00	4,835,550.66
本报告期期末基金份额总额	9,483,858.00	9,483,859.00	43,843,462.10

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及定期折算份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

（二）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

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	
国信证券	1	10,736,633.00	20.96%	9,999.00	20.96%	-
银河证券	1	10,563,823.80	20.62%	9,838.14	20.62%	-
中信证券	1	9,750,596.69	19.04%	9,080.75	19.04%	-
东方证券	2	4,938,032.94	9.64%	4,598.86	9.64%	-
兴业证券	1	4,898,870.00	9.56%	4,562.35	9.56%	-
广发证券	2	4,071,544.00	7.95%	3,791.80	7.95%	-
光大证券	2	2,626,757.70	5.13%	2,446.28	5.13%	-
华创证券	1	1,799,133.00	3.51%	1,675.58	3.51%	-
海通证券	2	1,339,414.61	2.62%	1,247.41	2.62%	-
长江证券	2	494,290.00	0.97%	460.33	0.97%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	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，本基金新增太平洋证券上海交易单元1个，方正证券上海交易单元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
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

国海富兰克林基金管理有限公司

2018年8月25日