

富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金
2018 年年度报告摘要

2018 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：2019 年 3 月 29 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 27 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 2018 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

基金名称	富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金
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	382,856,368.94 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	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。 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。
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，属于较高风险的基金品种。

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	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
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

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
----------------	-------

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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-36,009,229.64	90,285,511.52	23,759,700.04
本期利润	-65,523,239.22	96,613,268.17	39,399,595.93
加权平均基金份额本期利润	-0.1634	0.2382	0.1639
本期基金份额净值增长率	-16.72%	28.20%	2.29%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1630	0.0343	-0.1504
期末基金资产净值	320,446,596.24	425,201,677.49	327,088,201.22
期末基金份额净值	0.837	1.034	0.850
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-9.25%	8.97%	-15.00%

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

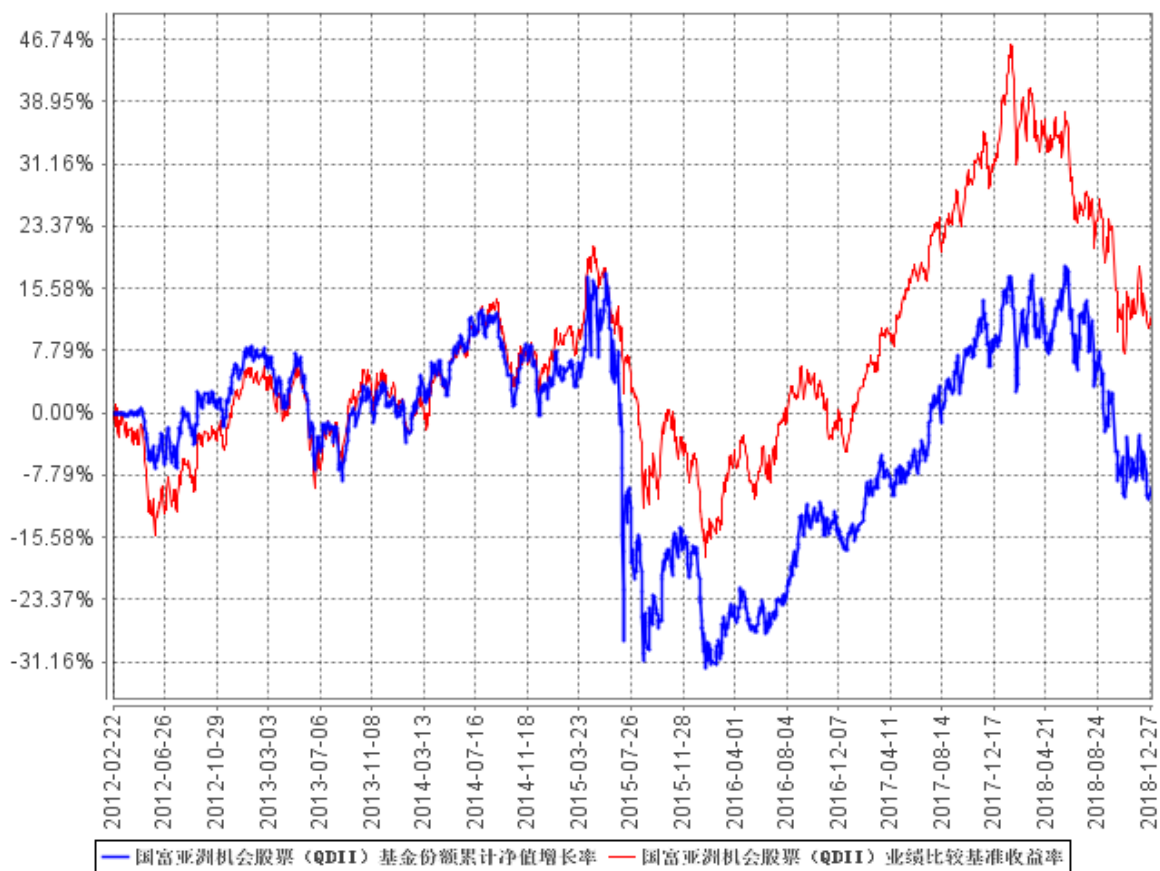
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④

	率①	准差②	率③	准差④		
过去三个月	-11.43%	1.60%	-8.96%	1.47%	-2.47%	0.13%
过去六个月	-17.29%	1.43%	-11.25%	1.17%	-6.04%	0.26%
过去一年	-16.72%	1.37%	-16.38%	1.08%	-0.34%	0.29%
过去三年	9.20%	1.15%	19.33%	0.91%	-10.13%	0.24%
过去五年	-11.03%	1.38%	8.19%	0.89%	-19.22%	0.49%
自基金合同 生效起至今	-9.25%	1.24%	12.23%	0.89%	-21.48%	0.35%

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

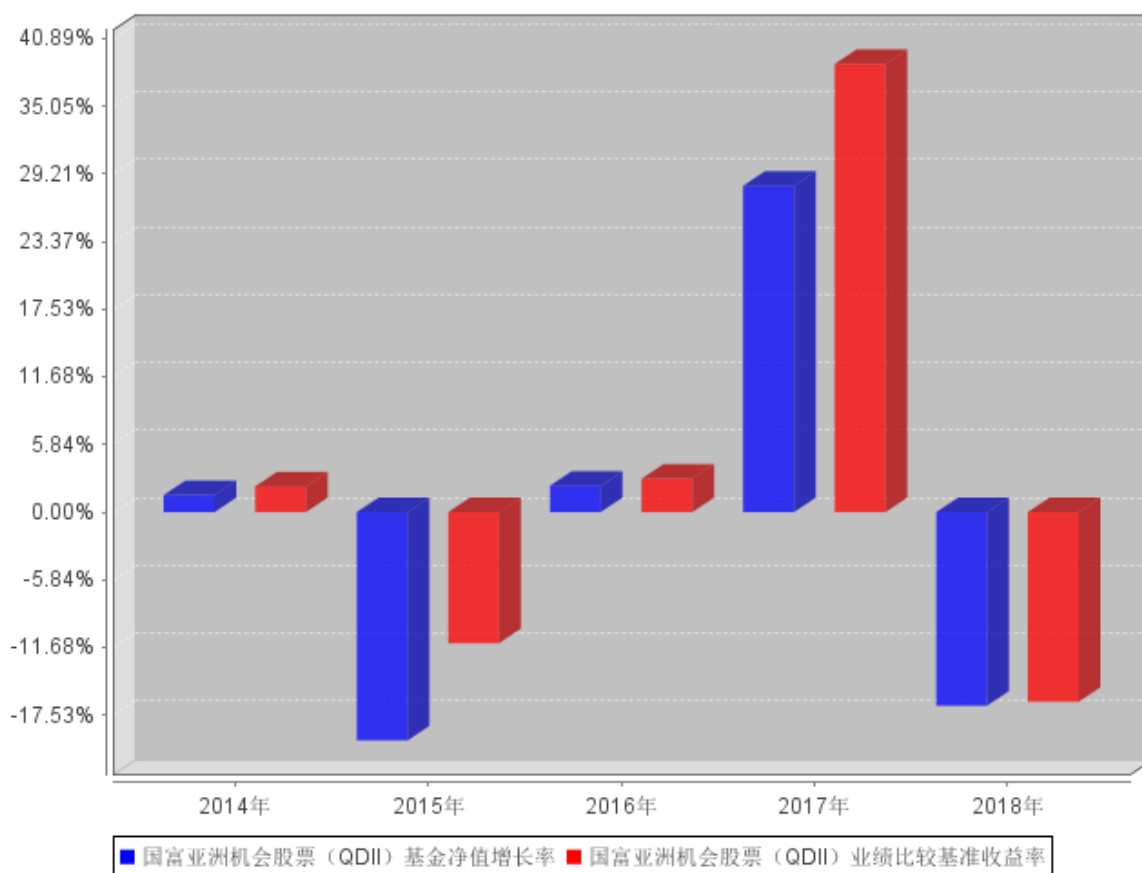
国富亚洲机会股票（QDII）基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

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

国富亚洲机会股票（QDII）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
2018	0.3000	12,053,984.75	151,677.83	12,205,662.58	
2017	0.5500	22,232,530.79	341,892.81	22,574,423.60	
2016	-	-	-	-	
合计	0.8500	34,286,515.54	493,570.64	34,780,086.18	

§ 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。

本公司具有丰富的基金管理经验。自 2005 年 6 月第一只基金成立开始，截至本报告期末，公司旗下共运作 32 只公募基金产品。

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、国富美元债定	2015 年 12 月 24 日	-	12 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、

	期债券(QDII)基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金及国富全球科技互联混合(QDII)的基金经理				国富大中华精选混合(QDII)基金、国富美元债定期债券(QDII)基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金及国富全球科技互联混合(QDII)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	33	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	27	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。

4.4.2 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，公司共管理了三十二只公募基金及六只专户产品。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。

4.4.3 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。

4.5 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

总体策略上，本基金配置优质中小市值为主，行业配置上超配互联网、科技、以及大消费等行业，上半年本基金有一定增收益。但由于下半年中国经济增速放缓以及市场对“贸易战”的担忧，科技和地产板块跌幅较大，对本基金业绩有所拖累；下半年，本基金的策略有所调整，增加了对新能源、基建、公共事业等板块的配置。

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 0.837 元，本报告期基金份额净值下跌 16.72%，业绩比较基准下跌 16.38%，跑输业绩比较基准 0.34%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，我们觉得中国经济有机会逐步企稳向好，全球市场流动性宽松的拐点可能已经出现，国内资金有望通过港股通加大对港股的配置。

我们对 2019 年的大中华地区的资本市场以及中概股持谨慎乐观的看法。市场将会有所表现。

本基金将配置有望得益于经济企稳回升的板块；继续重点研究质地好有发展潜力的公司。

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，争取未来取得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 2018 年 5 月 16 日宣告分红，向截至 2018 年 5 月 18 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基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.300 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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

会计师出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	55,241,697.43	109,189,689.70
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	272,915,126.14	344,022,367.75
其中：股票投资	272,915,126.14	344,022,367.75
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	-	-
应收利息	481.58	918.27
应收股利	953.97	-
应收申购款	13,828.45	8,253.30
递延所得税资产	-	-
其他资产	17,540,817.24	23,789,807.86
资产总计	345,712,904.81	477,011,036.88
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 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	6,706,559.86	26,267,027.60
应付赎回款	27,219.27	540,228.13
应付管理人报酬	499,181.20	647,551.97
应付托管费	97,062.98	125,912.89
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	17,936,285.26	24,228,638.80
负债合计	25,266,308.57	51,809,359.39
所有者权益：		
实收基金	382,856,368.94	411,119,535.60
未分配利润	-62,409,772.70	14,082,141.89
所有者权益合计	320,446,596.24	425,201,677.49
负债和所有者权益总计	345,712,904.81	477,011,036.88

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.837 元，基金份额总额 382,856,368.94 份。

7.2 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

	月 31 日	12 月 31 日
一、收入	-44,956,579.11	111,570,034.28
1. 利息收入	107,775.45	20,174.24
其中：存款利息收入	107,775.45	20,174.24
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）	-13,659,635.63	108,025,277.33
其中：股票投资收益	-18,640,845.42	102,706,518.32
基金投资收益	-261,759.56	-
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	5,242,969.35	5,318,759.01
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-29,514,009.58	6,327,756.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-1,904,712.69	-2,819,851.38
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	14,003.34	16,677.44
减：二、费用	20,566,660.11	14,956,766.11
1. 管理人报酬	7,153,159.59	7,109,352.79
2. 托管费	1,390,892.12	1,382,374.05
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	11,618,959.02	6,114,947.86
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	403,649.38	350,091.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-65,523,239.22	96,613,268.17
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-65,523,239.22	96,613,268.17

7.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	411,119,535.60	14,082,141.89	425,201,677.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-65,523,239.22	-65,523,239.22
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）	-28,263,166.66	1,236,987.21	-27,026,179.45
其中：1. 基金申购款	7,750,513.98	144,823.78	7,895,337.76
2. 基金赎回款	-36,013,680.64	1,092,163.43	-34,921,517.21
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	-	-12,205,662.58	-12,205,662.58

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	382,856,368.94	-62,409,772.70	320,446,596.24
项目	上年度可比期间		
	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)	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)	-	96,613,268.17	96,613,268.17
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)	26,148,207.89	-2,073,576.19	24,074,631.70
其中：1. 基金申购款	41,655,906.42	-2,668,172.15	38,987,734.27
2. 基金赎回款	-15,507,698.53	594,595.96	-14,913,102.57
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)	-	-22,574,423.60	-22,574,423.60
五、期末所有者权益(基金净值)	411,119,535.60	14,082,141.89	425,201,677.49

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：

林勇

基金管理人负责人

林勇

主管会计工作负责人

龚黎

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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 2019 年 3 月 22 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 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 2018 年度的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 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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[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》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管

产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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、基金注册登记机构、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
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
富兰克林顾问公司（Franklin Adviser, Inc.）	境外投资顾问公司
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

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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易

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。

7.4.8.2 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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,153,159.59	7,109,352.79
其中：支付销售机构的客户维护费	116,492.42	145,429.22

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。

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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付	1,390,892.12	1,382,374.05

的托管费		
------	--	--

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。

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(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（2017 年 1 月 1 日至 2017 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（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。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
	农业银行	2,101,631.62	22,092.60	4,016,805.73
摩根大通银行	53,140,065.81	85,680.80	105,172,883.97	0.13
合计	55,241,697.43	107,773.40	109,189,689.70	19,669.48

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无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（2018 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

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 2018 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 272,915,126.14 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第

一层次 344,022,367.75 元，无属于第二、三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票、债券和资产支持证券，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、债券和资产支持证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、债券和资产支持证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 2018 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(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) 其他

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。

§ 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	272,915,126.14	78.94
	其中：普通股	234,265,344.51	67.76
	存托凭证	38,649,781.63	11.18
	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	55,241,697.43	15.98
8	其他各项资产	17,556,081.24	5.08
9	合计	345,712,904.81	100.00

8.2 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	216,033,398.49	67.42
美国	42,397,981.05	13.23
台湾	9,995,159.72	3.12
韩国	4,488,586.88	1.40
合计	272,915,126.14	85.17

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。

8.3 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	13,817,759.00	4.31
电信服务	4,746,620.74	1.48
信息技术	86,612,911.00	27.03
非必需消费品	21,849,613.64	6.82
必需消费品	13,351,272.74	4.17
能源	15,762,072.20	4.92
保健	6,826,964.87	2.13
金融	45,466,447.34	14.19
工业	42,339,154.60	13.21
公用事业	22,142,310.01	6.91
合计	272,915,126.14	85.17

注：以上分类采用 GICS 行业分类标准。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	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(%)
----	----------	----------	------	--------	----------	-------	------	--------------

				场				
1	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	BBG006G2JVL2	纽约证券交易所	美国	18,790	17,676,482.50	5.52
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	BBG000BJ35N5	香港联合交易所	香港	52,700	14,499,182.36	4.52
3	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	招金矿业	BBG000DQ77W9	香港联合交易所	香港	1,369,500	9,539,649.41	2.98
4	Xinyi Solar Holdings Ltd	信义光能	BBG001XVDJ15	香港联合交易所	香港	3,936,000	9,483,988.80	2.96
5	CRRC Corp Ltd	中国	BBG000BGGR86	香	香港	1,401,000	9,378,529.37	2.93

		中车		港 联 合 交 易 所				
6	China Jinmao Holdings Group Ltd	中国 金茂	BBG000BYML92	香 港 联 合 交 易 所	香港	2,908,000	8,968,923.39	2.80
7	Sunac China Holdings Ltd	融创 中国	BBG000PZ8SG7	香 港 联 合 交 易 所	香港	400,000	8,937,240.00	2.79
8	China Resources Power Holdings Co Ltd	华润 电力	BBG000C1DC75	香 港 联 合 交 易 所	香港	660,000	8,709,077.52	2.72
9	58.com Inc	58 同 城	BBG005CBLQR0	纽 约 证	美国	23,294	8,666,627.55	2.70

				券 交 易 所				
10	Huadian Power International Corp Ltd	华电 国际 电力 股份	BBG000D3FXL6	香 港 联 合 交 易 所	香 港	2,780,000	8,598,501.08	2.68
11	China Overseas Property Holdings Ltd	中海 物业	BBG009K6PSX9	香 港 联 合 交 易 所	香 港	4,285,000	8,597,843.93	2.68
12	China Vanke Co Ltd	万科 集团	BBG006KY4KF4	香 港 联 合 交 易 所	香 港	354,900	8,271,625.91	2.58
13	China Suntien Green Energy Corp Ltd	新天 绿色 能源	BBG001657YZ9	香 港 联 合 交 易 所	香 港	4,650,800	8,231,562.54	2.57

				易 所				
14	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd	中車 時代 電氣	BBG000C6Z021	香 港 联 合 交 易 所	香港	198,500	7,548,375.38	2.36
15	China Everbright Greentech L	中国 光大 绿色 环保	BBG00D2SB834	香 港 联 合 交 易 所	香港	1,543,000	7,530,509.66	2.35
16	Logan Property Holdings Co Ltd	龙光 地产	BBG005P687B1	香 港 联 合 交 易 所	香港	846,000	7,271,811.61	2.27
17	Weibo Corp	新浪 微博	BBG0065XPGX9	纳 斯 达 克	美国	17,300	6,937,590.22	2.16
18	China State Construction International	中国 建筑 国际	BBG000BL9KF0	香 港 联	香港	1,216,000	6,627,156.22	2.07

	Holdings Ltd			合 交 易 所				
19	Greentown Service Group Co Ltd	绿城 服务	BBG00BS2BVW4	香 港 联 合 交 易 所	香 港	1,192,000	6,266,582.40	1.96
20	China Resources Beer Holdings Co Ltd	华润 啤酒	BBG000BKWM80	香 港 联 合 交 易 所	香 港	256,000	6,134,801.92	1.91
21	Huanxi Media Group Ltd	欢喜 传媒	BBG000BGDN51	香 港 联 合 交 易 所	香 港	4,250,000	6,032,637.00	1.88
22	Kingdee International Software Group Co Ltd	金蝶 国际	BBG000FQH8C6	香 港 联 合 交 易 所	香 港	948,000	5,748,012.19	1.79

				易 所				
23	Autohome Inc	汽车 之家	BBG005JYTDQ5	纽 约 证 券 交 易 所	美国	10,000	5,369,081.36	1.68
24	China Railway Construction Corp Ltd	中国 铁建	BBG000QNN9H7	香 港 联 合 交 易 所	香港	548,500	5,219,269.30	1.63
25	Land Mark Optoelectronics Corp	联亚 光电	BBG006RZZ2N1	台 湾 证 券 交 易 所	台湾	101,000	5,093,098.62	1.59
26	Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd	上海 君实	BBG00MP13070	香 港 联 合 交 易 所	香港	233,000	4,940,541.32	1.54

27	Haier Electronics Group Co Ltd	海尔 电器	BBG000BXJK0	香 港 联 合 交 易 所	香 港	291,000	4,910,803.09	1.53
28	Chipbond Technology Corp	颀邦 科技	BBG000LZJG20	台 湾 证 券 交 易 所	台 湾	352,000	4,902,061.10	1.53
29	Huaneng Power International Inc	华能 国际	BBG000JNXM58	香 港 联 合 交 易 所	香 港	1,108,000	4,834,731.41	1.51
30	China Communications Services Corp Ltd	中国 通信 服务	BBG000BHXR94	香 港 联 合 交 易 所	香 港	836,000	4,746,620.74	1.48
31	Samsung SDI Co Ltd	三星 SDI	BBG000BCY0Q4	韩 国	韩 国	3,318	4,488,586.88	1.40

				证 券 交 易 所				
32	Xinyi Glass Holdings Ltd	信義 玻璃	BBG000LG6G08	香 港 联 合 交 易 所	香港	582,000	4,416,153.14	1.38
33	COFCO Meat Holdings Ltd	中粮 肉食	BBG00FORD0D7	香 港 联 合 交 易 所	香港	3,368,000	4,279,010.32	1.34
34	Shandong Gold Mining Co Ltd	山东 黄金	BBG00LZGWB81	香 港 联 合 交 易 所	香港	255,900	4,278,109.59	1.34
35	China Railway Group Ltd	中国 中铁	BBG000TTDDN6	香 港 联 合 交 易 所	香港	678,200	4,236,922.93	1.32

				交 易 所				
36	Lumentum Holdings Inc	卢蒙 特控 股	BBG0073F9RT7	纳 斯 达 克	美国	13,000	3,748,199.42	1.17
37	CIFI Holdings Group Co Ltd	旭辉 集团	BBG003MHHV68	香 港 联 合 交 易 所	香港	938,000	3,419,002.50	1.07
38	China Meidong Auto Holdings Ltd	美东 汽车	BBG005MDCCJ5	香 港 联 合 交 易 所	香港	1,316,000	3,413,114.43	1.07
39	Wynn Macau Ltd	永利 澳门	BBG000PF3781	香 港 联 合 交 易 所	香港	205,600	3,076,905.98	0.96
40	China Conch Venture	中国 海螺	BBG005NL89F2	香 港	香港	150,000	3,062,319.00	0.96

	Holdings Ltd	创业		联合交易所				
41	Health and Happiness H&H International Holdings Ltd	健合集团	BBG0019R2RP9	香港联合交易所	香港	75,000	2,937,460.50	0.92
42	Bei Gene Ltd	百济神州	BBG00LLCFBZ4	香港联合交易所	香港	25,600	1,886,423.55	0.59

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。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 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	Alibaba Group	BBG006G2JVL2	83,547,854.15	19.65

	Holding Ltd			
2	Tencent Holdings Ltd	BBG000BJ35N5	66,588,279.85	15.66
3	China Jinmao Holdings Group Ltd	BBG000BYML92	59,951,552.24	14.10
4	CIFI Holdings Group Co Ltd	BBG003MHHV68	53,344,366.16	12.55
5	58.com Inc	BBG005CBLQR0	52,165,690.34	12.27
6	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	BBG000C16952	50,386,408.07	11.85
7	China Construction Bank Corp	BBG000NW2S18	44,685,643.91	10.51
8	China National Building Material Co Ltd	BBG000BLBWT6	42,967,354.72	10.11
9	Future Land Development Holdings Ltd	BBG003MJZ5R8	41,468,292.61	9.75
10	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	BBG000GD4N44	37,892,462.78	8.91
11	China Pacific Insurance Group Co Ltd	BBG000KVB7C7	36,875,556.17	8.67
12	China Vanke Co Ltd	BBG006KY4KF4	35,540,525.95	8.36

13	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	BBG002ZFX5C2	35,373,287.57	8.32
14	China Merchants Bank Co Ltd	BBG000DVPPK1	33,805,431.19	7.95
15	Bizlink Holding Inc	BBG001M8XY86	33,195,442.02	7.81
16	Country Garden Holdings Co Ltd	BBG000QQCY41	32,567,004.26	7.66
17	Kingdee International Software Group Co Ltd	BBG000FQH8C6	31,937,630.04	7.51
18	Baozun Inc	BBG008HNS333	31,822,392.00	7.48
19	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	BBG000Q16VR4	31,719,083.20	7.46
20	Bank of Communications Co Ltd	BBG000FTZ082	31,666,252.02	7.45
21	Chinasoft International Ltd	BBG000KVJJD2	30,741,206.70	7.23
22	China Mobile Ltd	BBG000BZWNT2	30,302,671.28	7.13
23	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	BBG000BY28H4	30,084,108.44	7.08
24	Geely Automobile Holdings Ltd	BBG000BZ3PX4	29,269,701.89	6.88

25	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd	BBG0018HRM67	29,255,056.88	6.88
26	Largan Precision Co Ltd	BBG000HLSVV1	27,102,582.29	6.37
27	China Overseas Land & Investment Ltd	BBG000BGD8W4	26,919,885.75	6.33
28	China Railway Construction Corp Ltd	BBG000QNN9H7	26,614,492.57	6.26
29	Xinyi Glass Holdings Ltd	BBG000LG6G08	25,681,056.58	6.04
30	NetEase Inc	BBG000BX72V8	25,006,856.10	5.88
31	Fosun International Ltd	BBG000RJJ5Z8	24,665,368.66	5.80
32	China Everbright Ltd	BBG000BBZJX6	24,254,100.29	5.70
33	Hiwin Technologies Corp	BBG000RGDQY5	24,166,698.24	5.68
34	Logan Property Holdings Co Ltd	BBG005P687B1	23,102,781.76	5.43
35	China Resources Power Holdings Co Ltd	BBG000C1DC75	23,013,359.35	5.41
36	Advanced Micro Devices Inc	BBG000BBQCY0	22,802,945.67	5.36

37	Anhui Conch Cement Co Ltd	BBG000BVKWW0	22,668,531.19	5.33
38	Huaneng Power International Inc	BBG000JNXM58	22,449,611.86	5.28
39	A-Living Services Co Ltd	BBG00HPYZKT6	21,883,086.73	5.15
40	China CITIC Bank Corp Ltd	BBG000J7DX33	21,813,010.66	5.13
41	Autohome Inc	BBG005JYTDQ5	21,592,305.70	5.08
42	New Oriental Education & Technology Group Inc	BBG000PTRRM5	21,571,500.19	5.07
43	China Education Group Holdings Ltd	BBG00JDXTJX2	21,296,060.93	5.01
44	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	BBG000DQ77W9	21,137,093.61	4.97
45	Huadian Power International Corp Ltd	BBG000D3FXL6	20,019,678.31	4.71
46	Li Ning Co Ltd	BBG000PTX047	19,769,522.35	4.65
47	China Eastern Airlines Corp Ltd	BBG000BP6D06	19,669,761.59	4.63
48	Land Mark Optoelectronics Corp	BBG006RZZ2N1	19,554,324.04	4.60

49	China Resources Land Ltd	BBG000HPNDX5	19,420,600.36	4.57
50	KWG Property Holding Ltd	BBG000Q71X74	19,370,176.79	4.56
51	China Conch Venture Holdings Ltd	BBG005NL89F2	18,864,207.46	4.44
52	Baidu Inc/China	BBG000QXWRM9	18,802,910.76	4.42
53	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	BBG000V4VOW6	18,398,116.95	4.33
54	Parade Technologies Ltd	BBG0021GYN91	18,240,588.59	4.29
55	AAC Technologies Holdings Inc	BBG000HS6QD1	18,084,178.09	4.25
56	Haier Electronics Group Co Ltd	BBG000BXJJK0	17,976,384.07	4.23
57	Hua Hong Semiconductor Ltd	BBG0078Q6BC4	17,116,337.62	4.03
58	Health and Happiness H&H International Holdings Ltd	BBG0019R2RP9	17,108,318.18	4.02
59	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd	BBG000C6Z021	17,080,853.63	4.02
60	China Railway Group Ltd	BBG000TTDDN6	16,842,383.15	3.96

61	Bilibili Inc	BBG00K7T3037	16,256,923.92	3.82
62	PetroChina Co Ltd	BBG000BFNTD0	16,073,633.46	3.78
63	China Longyuan Power Group Corp Ltd	BBG000P2MRM9	16,041,650.64	3.77
64	China Everbright Bank Co Ltd	BBG001ROMC06	16,001,654.11	3.76
65	Guotai Junan International Holdings Ltd	BBG000R4B7S3	15,616,427.11	3.67
66	Sinopharm Group Co Ltd	BBG000VWV3Z5	15,394,420.64	3.62
67	Shimao Property Holdings Ltd	BBG000C0T6W5	15,326,566.07	3.60
68	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd	BBG000BGW354	15,080,243.42	3.55
69	Angang Steel Co Ltd	BBG000BJV769	15,048,027.16	3.54
70	GF Securities Co Ltd	BBG007WL04J3	14,867,590.08	3.50
71	Weibo Corp	BBG0065XPGX9	13,834,406.66	3.25
72	China New Higher Education Group Ltd	BBG00GD9JFB4	13,550,936.96	3.19
73	Shanghai Jin Jiang International	BBG000BSMSW4	13,021,228.43	3.06

	Hotels Group Co Ltd			
74	Xinyi Solar Holdings Ltd	BBG001XVDJ15	13,010,639.71	3.06
75	Microsoft Corp	BBG000BPH459	12,239,123.06	2.88
76	Far East Horizon Ltd	BBG001KKX325	12,196,650.71	2.87
77	Kunlun Energy Co Ltd	BBG000BDW4H6	12,135,110.85	2.85
78	China BlueChemical Ltd	BBG000PTRPT2	12,073,715.43	2.84
79	MediaTek Inc	BBG000JLDX96	12,053,413.37	2.83
80	China Gas Holdings Ltd	BBG000C2ZS65	11,852,700.96	2.79
81	Shandong Gold Mining Co Ltd	BBG00LZGWB81	11,582,462.98	2.72
82	WH Group Ltd	BBG00699M8Q7	11,548,044.27	2.72
83	Greentown Service Group Co Ltd	BBG00BS2BVW4	11,500,270.74	2.70
84	Great Wall Motor Co Ltd	BBG000CYZ1K8	11,319,252.80	2.66
85	Haitong International Securities Group Ltd	BBG000C313X5	11,285,566.40	2.65
86	Lonking Holdings Ltd	BBG000BKSZ59	11,226,958.46	2.64
87	Taiwan Union	BBG000LLH1T7	11,211,664.45	2.64

	Technology Corp			
88	China Suntien Green Energy Corp Ltd	BBG001657YZ9	11,203,329.88	2.63
89	Sunac China Holdings Ltd	BBG000PZ8SG7	11,105,341.32	2.61
90	Lumentum Holdings Inc	BBG0073F9RT7	10,939,208.17	2.57
91	China State Construction International Holdings Ltd	BBG000BL9KF0	10,868,167.73	2.56
92	Semiconductor Manufacturing International Corp	BBG000LB4NH8	10,676,670.17	2.51
93	ENN Energy Holdings Ltd	BBG000N6X3L4	10,564,346.12	2.48
94	Merry Electronics Co Ltd	BBG000F83RG5	10,380,055.25	2.44
95	Haitong Securities Co Ltd	BBG0029103Q8	10,220,152.20	2.40
96	China Overseas Property Holdings Ltd	BBG009K6PSX9	10,046,612.97	2.36
97	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	BBG000BP9KK5	9,575,710.09	2.25

98	China Oriental Group Co Ltd	BBG000KVJ7T1	9,562,786.46	2.25
99	CRRC Corp Ltd	BBG000BGGR86	9,499,527.92	2.23
100	New China Life Insurance Co Ltd	BBG0028VY3J4	9,445,925.72	2.22
101	CNOOC Ltd	BBG000DCXP06	9,440,417.17	2.22
102	Orient Securities Co Ltd/China	BBG00D5Z9RW4	9,348,006.48	2.20
103	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	BBG000BPMDN3	9,265,914.29	2.18
104	TAL Education Group	BBG0016XJ8S0	9,227,542.95	2.17
105	Precision Tsugami China Corp Ltd	BBG00HP95036	9,135,246.12	2.15
106	Longfor Properties Co Ltd	BBG000CHNH78	9,011,634.66	2.12
107	China Communications Services Corp Ltd	BBG000BXHR94	8,909,270.96	2.10
108	Win Semiconductors Corp	BBG000W1CHV6	8,772,456.82	2.06
109	3SBio Inc	BBG009BKGLS9	8,751,086.10	2.06
110	Tsingtao Brewery	BBG000BHWDF9	8,742,948.04	2.06

	Co Ltd			
111	Nintendo Co Ltd	BBG000BLCPP4	8,674,344.35	2.04
112	Globalwafers Co Ltd	BBG007D2WSJ8	8,637,188.24	2.03
113	Beijing Capital International Airport Co Ltd	BBG000C709H2	8,536,907.25	2.01
114	China Traditional Chinese Medicine Co Ltd	BBG000BDKMV3	8,510,331.91	2.00

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。

8.5.2 累计卖出金额超初期基金资产净值 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	Alibaba Group Holding Ltd	BBG006G2JVL2	80,651,611.35	18.97
2	Tencent Holdings Ltd	BBG000BJ35N5	75,194,888.51	17.69
3	CIFI Holdings Group Co Ltd	BBG003MHHV68	64,880,136.47	15.26
4	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	BBG000Q16VR4	60,571,066.29	14.25
5	China Jinmao Holdings Group Ltd	BBG000BYML92	47,505,215.50	11.17

6	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	BBG000GD4N44	47,254,325.87	11.11
7	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	BBG000C16952	47,039,192.35	11.06
8	China Construction Bank Corp	BBG000NW2S18	44,644,438.52	10.50
9	China National Building Material Co Ltd	BBG000BLBWT6	42,416,139.32	9.98
10	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	BBG000BY28H4	42,360,368.68	9.96
11	China CITIC Bank Corp Ltd	BBG000J7DX33	41,687,699.79	9.80
12	58.com Inc	BBG005CBLQR0	41,138,963.06	9.68
13	Future Land Development Holdings Ltd	BBG003MJZ5R8	40,899,558.88	9.62
14	Chinasoft International Ltd	BBG000KVJJD2	38,684,685.21	9.10
15	Kingdee International Software Group Co Ltd	BBG000FQH8C6	36,792,721.80	8.65
16	China Merchants Bank Co Ltd	BBG000DVPPK1	35,029,809.48	8.24

17	China Pacific Insurance Group Co Ltd	BBG000KVB7C7	34,813,763.44	8.19
18	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	BBG002ZFX5C2	31,727,294.94	7.46
19	Country Garden Holdings Co Ltd	BBG000QQCY41	31,283,827.84	7.36
20	Advanced Micro Devices Inc	BBG000BBQCY0	30,948,217.34	7.28
21	Bank of Communications Co Ltd	BBG000FTZ082	30,862,285.54	7.26
22	China Mobile Ltd	BBG000BZWNT2	30,438,857.41	7.16
23	Baozun Inc	BBG008HNS333	30,436,167.45	7.16
24	China Vanke Co Ltd	BBG006KY4KF4	29,860,355.28	7.02
25	Bizlink Holding Inc	BBG001M8XY86	29,443,278.63	6.92
26	Largan Precision Co Ltd	BBG000HLSVV1	28,918,513.04	6.80
27	New Oriental Education & Technology Group Inc	BBG000PTRRM5	28,447,100.17	6.69
28	Hiwin Technologies Corp	BBG000RGDQY5	28,434,317.33	6.69

29	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd	BBG0018HRM67	28,106,202.06	6.61
30	China Eastern Airlines Corp Ltd	BBG000BP6D06	27,904,045.56	6.56
31	Huaneng Renewables Corp Ltd	BBG0019PDFM0	26,364,863.05	6.20
32	Geely Automobile Holdings Ltd	BBG000BZ3PX4	26,290,491.26	6.18
33	China Overseas Land & Investment Ltd	BBG000BGD8W4	25,898,088.44	6.09
34	NetEase Inc	BBG000BX72V8	25,751,191.97	6.06
35	China Conch Venture Holdings Ltd	BBG005NL89F2	25,364,081.41	5.97
36	Fosun International Ltd	BBG000RJJ5Z8	23,840,659.44	5.61
37	China Everbright Ltd	BBG000BBZJX6	23,835,137.11	5.61
38	New China Life Insurance Co Ltd	BBG0028VY3J4	23,489,843.32	5.52
39	China BlueChemical Ltd	BBG000PTRPT2	23,330,636.93	5.49
40	China Railway Construction Corp Ltd	BBG000QNN9H7	22,779,023.61	5.36

41	Sina Corp/China	BBG000CJZ2W6	22,723,411.53	5.34
42	China Education Group Holdings Ltd	BBG00JDXTJX2	22,627,318.64	5.32
43	Anhui Conch Cement Co Ltd	BBG000BVKWW0	22,328,686.48	5.25
44	Li Ning Co Ltd	BBG000PTX047	22,041,149.78	5.18
45	A-Living Services Co Ltd	BBG00HPYZKT6	20,597,255.27	4.84
46	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	BBG001XVDW70	20,548,882.65	4.83
47	Land Mark Optoelectronics Corp	BBG006RZZ2N1	19,773,792.52	4.65
48	China Resources Land Ltd	BBG000HPNDX5	19,371,095.20	4.56
49	Minth Group Ltd	BBG000GYFYN1	19,201,225.43	4.52
50	Xinyi Glass Holdings Ltd	BBG000LG6G08	19,101,169.88	4.49
51	Microport Scientific Corp	BBG0015NVM80	18,539,569.47	4.36
52	Parade Technologies Ltd	BBG0021GYN91	18,278,607.24	4.30
53	Baidu Inc/China	BBG000QXWRM9	18,174,621.27	4.27
54	Huaneng Power International Inc	BBG000JNXM58	17,119,538.69	4.03
55	KWG Property	BBG000Q71X74	16,849,272.55	3.96

	Holding Ltd			
56	GF Securities Co Ltd	BBG007WL04J3	16,377,999.62	3.85
57	AAC Technologies Holdings Inc	BBG000HS6QD1	15,864,882.28	3.73
58	Hua Hong Semiconductor Ltd	BBG0078Q6BC4	15,779,480.10	3.71
59	PetroChina Co Ltd	BBG000BFNTD0	15,727,092.13	3.70
60	Shimao Property Holdings Ltd	BBG000C0T6W5	15,655,795.60	3.68
61	Autohome Inc	BBG005JYTDQ5	15,585,029.10	3.67
62	Sinopharm Group Co Ltd	BBG000VWV3Z5	15,543,615.02	3.66
63	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	BBG000V4V0W6	15,525,082.83	3.65
64	Logan Property Holdings Co Ltd	BBG005P687B1	14,756,046.35	3.47
65	China Longyuan Power Group Cor	BBG000P2MRM9	14,641,746.22	3.44
66	China Resources Power Holdings	BBG000C1DC75	14,626,336.10	3.44
67	China Southern Airlines Co Ltd	BBG000BY1DP5	14,587,490.18	3.43
68	China Everbright Bank Co Ltd	BBG001ROMC06	14,443,747.44	3.40
69	Bilibili Inc	BBG00K7T3037	14,279,053.12	3.36

70	Guotai Junan International Hol	BBG000R4B7S3	14,035,974.94	3.30
71	Kunlun Energy Co Ltd	BBG000BDW4H6	13,845,011.92	3.26
72	Angang Steel Co Ltd	BBG000BJV769	13,796,538.48	3.24
73	Airtac International Group	BBG0014M8L81	13,658,163.35	3.21
74	Hong Kong Exchanges and Cleari	BBG000BGW354	13,539,799.83	3.18
75	China Gas Holdings Ltd	BBG000C2ZS65	13,421,613.65	3.16
76	China Railway Group Ltd	BBG000TTDDN6	13,323,078.64	3.13
77	Health and Happiness H&H Inter	BBG0019R2RP9	13,311,302.16	3.13
78	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	BBG000DQ77W9	12,713,879.96	2.99
79	Nexteer Automotive Group Ltd	BBG004Q13M26	12,686,926.19	2.98
80	Microsoft Corp	BBG000BPH459	12,493,721.08	2.94
81	Far East Horizon Ltd	BBG001KKX325	11,907,865.38	2.80
82	ENN Energy	BBG000N6X3L4	11,827,926.39	2.78

	Holdings Ltd			
83	Haitong International Securiti	BBG000C313X5	11,777,197.15	2.77
84	Shanghai Jin Jiang Internation	BBG000BSMSW4	11,741,308.30	2.76
85	Haier Electronics Group Co Ltd	BBG000BXJJK0	11,449,763.28	2.69
86	China New Higher Education Gro	BBG00GD9JFB4	11,318,889.81	2.66
87	Huadian Power International Co	BBG000D3FXL6	11,121,938.97	2.62
88	MediaTek Inc	BBG000JLDX96	11,046,880.79	2.60
89	Taiwan Union Technology Corp	BBG000LLH1T7	10,492,352.34	2.47
90	TAL Education Group	BBG0016XJ8S0	10,429,400.46	2.45
91	Great Wall Motor Co Ltd	BBG000CYZ1K8	10,414,621.01	2.45
92	WH Group Ltd	BBG00699M8Q7	10,337,656.61	2.43
93	Win Semiconductors Corp	BBG000W1CHV6	10,246,948.34	2.41
94	Haitong Securities Co Ltd	BBG0029103Q8	10,237,087.71	2.41
95	China Overseas	BBG009K6PSX9	10,044,412.09	2.36

	Property Holdin			
96	CNOOC Ltd	BBG000DCXP06	9,706,103.13	2.28
97	Orient Securities Co Ltd/China	BBG00D5Z9RW4	9,647,298.13	2.27
98	Longfor Properties Co Ltd	BBG000CHNH78	9,469,988.42	2.23
99	Semiconductor Manufacturing In	BBG000LB4NH8	9,438,379.52	2.22
100	Globalwafers Co Ltd	BBG007D2WSJ8	9,349,091.10	2.20
101	Tsingtao Brewery Co Ltd	BBG000BHWF9	9,277,870.67	2.18
102	Merry Electronics Co Ltd	BBG000F83RG5	9,173,868.99	2.16
103	China Traditional Chinese Medi	BBG000BDKMW3	9,110,585.30	2.14
104	Broadcom Ltd	BBG00KHY5S69	8,902,388.87	2.09
105	3SBio Inc	BBG009BKGLS9	8,774,145.38	2.06
106	Zhuzhou CRRC Times Electric Co	BBG000C6Z021	8,625,280.46	2.03
107	Lee & Man Paper Manufacturing	BBG000BP9KK5	8,569,157.72	2.02

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。

8.5.3 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	2,737,852,935.70
卖出收入（成交）总额	2,726,456,454.81

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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	-
3	应收股利	953.97
4	应收利息	481.58
5	应收申购款	13,828.45
6	其他应收款	17,540,817.24
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,556,081.24

8.11.4 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债。

8.11.5 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。

§ 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
1,580	242,314.16	369,794,214.45	96.59%	13,062,154.49	3.41%

9.2 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	6,236.52	0.001629%

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（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	411,119,535.60
本报告期期间基金总申购份额	7,750,513.98
减：本报告期期间基金总赎回份额	36,013,680.64
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	382,856,368.94

§ 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第五届董事会第十一次会议审议通过，自 2018 年 11 月 20 日起，胡昕彦女士不再担任公司副总经理。相关公告已于 2018 年 11 月 17 日在《中国证券报》和公司网站披露。

（二）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人总行聘任刘琳同志、李智同志为托管业务部高级专家。

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 72,000.00 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	
Credit Suisse(Hong kong) Limited		1783,798,909.18	14.42%	781,081.38	12.09%	-
China everbrilght securities(HK) securities		1316,744,296.48	5.83%	475,116.46	7.35%	-
NOMURA INTERNATIONAL Plc		2388,193,326.11	7.14%	590,110.61	9.13%	-
Goldman Sachs(Asia) LLC		2460,159,681.25	8.47%	686,309.96	10.62%	-
CLSA Limited		1401,622,229.34	7.39%	659,188.80	10.20%	-
Daiw Capital Markets Hongkong Limited		2928,208,769.47	17.08%	647,450.07	10.02%	-
Haitong International Securities Company Limited		2480,825,827.79	8.85%	507,689.72	7.86%	-
Jefferies Hongkong Limited		1307,208,572.30	5.65%	460,812.83	7.13%	-

Morgan Stanley & Co. International plc	2	38,567,887.85	0.71%	53,536.34	0.83%	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	2	542,381,075.69	9.98%	542,370.81	8.39%	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	2	203,341,035.36	3.74%	323,939.17	5.01%	-
Core Pacific-Yamaichi International (H.K.) Ltd.	1	7,709,585.74	0.14%	7,709.59	0.12%	-
CMB International Securities Limited	1	1,927,099.29	0.04%	2,890.65	0.04%	-
Masterlink Securities	1	63,247,794.42	1.16%	126,489.19	1.96%	-
Macquarie Capital Asia Limited	1	294,999,708.93	5.43%	373,036.24	5.77%	-
Cathay Securities (HK) Limited	1	18,497,295.65	0.34%	20,347.01	0.31%	-

Cathay Securities	1	59,131,031.30	1.09%	65,044.22	1.01%	-
YUANTA SECURITIES CO., LTD.	1	138,642,991.70	2.55%	138,643.89	2.15%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL	1	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein (HK) Limited	1	-	-	-	-	-
Ccb International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
KGI Securities Co. Ltd	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
DAEWOO SECURITIES CO. LTD	1	-	-	-	-	-
DAISHIN SECURITIES-KOREA	1	-	-	-	-	-
BNP Paribas	1	-	-	-	-	-
Zhongtai International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Bank of China(HK)	1	-	-	-	-	-
BOC	1	-	-	-	-	-

International						
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	1	-	-	-	-	-
JPMorgan Chase & Co.	1	-	-	-	-	-
China Securities International	1	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	1	-	-	-	-	-
BOCOM International Holdings Company Limited	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

民族证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
Bank of America Merrill Lynch	2	-	-	-	-	-

注：

管理人对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其他相关因素后决定的。报告期内证券公司基金专用交易单元的变更情况：

报告期内，本基金新增法国巴黎银行(BNP Paribas)交易单元 1 个，交银国际(BOCOM International Holdings Company Limited) 交易单元 1 个，京华山一 (Core Pacific-Yamaichi International (H.K.) Ltd.) 交易单元 1 个，招银国际 (CMB International Securities Limited) 交易单元 1 个，国泰君安香港 (Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited) 交易单元 1 个，中信建投国际 (China Securities International) 交易单元 1 个，摩根大通银行 (JPMorgan Chase & Co.) 交易单元 1 个，海通国际 (Haitong International Securities Company Limited) 交易单元 1 个，美银美林 (Bank of America Merrill Lynch) 交易单元 1 个，中信香港(CITIC Securities Brokerage (HK) Limited)交易单元 1 个，中金公司 (China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited) 交易单元 1 个，高盛 (Goldman Sachs(Asia) LLC) 交易单元 1 个，摩根士丹利 (Morgan Stanley & Co. International plc) 交易单元 1 个，中银国际 (BOC International) 交易单元 1 个，华泰金融 (Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited) 交易单元 1 个，中银香港 (Bank of China (HK)) 交易单元 1 个，大和资本 (Daiw Capital Markets Hongkong Limited) 交易单元 1 个，中泰国际 (Zhongtai International Securities Limited) 交易单元 1 个，野村国际(Nomura International Plc)交易单元 1 个，元大证券(Yuanta Securities

Co.,Ltd.) 交易单元 1 个, 盛博香港有限公司(Sanford C. Bernstein (HK) Limited)交易单元 1 个。华泰证券上海及深圳交易单元各 1 个, 兴业证券上海交易单元 1 个, 申万宏源上海交易单元 1 个, 海通证券上海交易单元 1 个, 招商证券上海交易单元 1 个, 国信证券上海交易单元 1 个, 北京高华上海交易单元 1 个, 中泰证券上海交易单元 1 个, 中信证券上海及深圳交易单元各 1 个, 银河证券上海交易单元 1 个, 中金公司上海及深圳交易单元各 1 个, 安信证券上海及深圳交易单元各 1 个, 东兴证券上海交易单元 1 个, 第一创业证券上海交易单元 1 个, 西藏东方财富证券上海及深圳交易单元各 1 个, 平安证券上海及深圳交易单元各 1 个, 国金证券上海交易单元 1 个, 国盛证券上海交易单元 1 个, 国泰君安深圳交易单元 1 个, 天风证券深圳交易单元 1 个, 民族证券深圳交易单元 1 个, 方正证券深圳交易单元 1 个, 东北证券深圳交易单元 1 个, 华安证券深圳交易单元 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		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
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China everbrilght securities (HK) securities	-	-	-	-	-	-	-	-
NOMURA INTERNATIONAL	-	-	-	-	-	-	-	-

Plc								
Goldman Sachs (Asia) LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Daiw Capital Markets Hongkong Limited	-	-	-	-	-	-14,202,684.64	100.00%	
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Jefferies Hongkong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International plc	-	-	-	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Core Pacific-Yamaichi International (H.K.) Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-

CMB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Masterlink Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Macquarie Capital Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Cathay Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Cathay Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
YUANTA SECURITIES CO., LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Ccb International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI Securities Co. Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-

DAEWOO SECURITIES CO. LTD	-	-	-	-	-	-	-	-
DAISHIN SECURITIES-KOREA	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas	-	-	-	-	-	-	-	-
Zhongtai International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Bank of China(HK)	-	-	-	-	-	-	-	-
BOC International	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
JPMorgan Chase & Co.	-	-	-	-	-	-	-	-
China Securities International	-	-	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCOM International Holdings Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Bank of America Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-

§ 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	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	368,441,188.29	-	22,000,000.00	346,441,188.29	90.49%
产品特有风险							
<p>1. 流动性风险</p> <p>投资者大额赎回所持有的基金份额时，为了实现基金资产的迅速变现，在基金交易过程中可能存在无法实现交易价格最优；亦或导致基金仓位调整困难，基金资产不能迅速转变成现金，产生流动性风险。</p> <p>一旦引发巨额赎回，当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，可能出现比例赎回、延期支付赎回款等情形。</p> <p>管理人有权根据本基金合同和招募说明书的约定，基于投资者保护原则，暂停或拒绝申购、暂停赎回。</p> <p>该基金投资者集中度较高，管理人将积极通过持续营销优化持有人结构，审慎办理大额申购和赎回。</p> <p>2. 估值风险</p> <p>投资者大额赎回所持有的基金份额时，基金份额净值可能受到尾差和部分赎回费归入基金资产的影响，从而导致非市场因素的净值异常波动。</p>							

国海富兰克林基金管理有限公司

2019 年 3 月 29 日