

富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金  
2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>58</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	58
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>59</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>60</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	62
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>65</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	65

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>66</b>
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金
基金简称	国富健康优质生活股票
基金主代码	000761
交易代码	000761
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 23 日
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	367,963,626.86 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于有利于提升民众健康水平和能够满足人们优质生活需求的上市公司，在严格控制投资风险的基础上，力争获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金将重点关注有利于提升民众健康水平和能够提供优质生活产品和服务的行业和个股。</p> <p>1、行业配置策略</p> <p>（1）本基金的股票资产采用“核心-卫星”策略进行行业配置。本基金的核心行业配置资产将主要投资于与提升居民健康和生活品质主题直接相关的行业，投资比例不低于非现金基金资产的 80%。</p> <p>随着经济增长方式的转变和产业结构的升级，居民的需求也会发生变化，从而导致满足居民健康和优质生活需求的行业范围发生变化。本基金将通过居民需求变化和行业发展趋势的研究，适时调整健康优质生活主题所覆盖的行业范围。</p> <p>（2）本基金在具体进行行业配置时，根据宏观经济周期、国家产业政策、行业景气度和行业竞争格局等因素进行深入分析，结合行业盈利趋势预测、行业整体估值水平和市场特征等，进行综合的行业投资价值评估。</p> <p>2、个股精选策略</p> <p>本基金将采用“自下而上”精选个股策略，紧密围绕健康优质生活的投资主题，从主题、行业地位、公司发展战略、核心竞争力、公司治理结构和管理层分析、估值水平等方面进行综合评价，精选优质股票构建投资组合。</p>

	<p>3、债券投资策略</p> <p>本基金通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究，结合新券发行情况，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略，把握债券市场投资机会，以获取稳健的投资收益。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时，将通过权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型确定其合理估值水平，谨慎地进行投资，在控制下跌风险、实现保值的前提下，追求较为稳定的增值收益。</p>
业绩比较基准	85% × 沪深 300 指数收益率 + 15% × 中债国债总指数收益率（全价）
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于证券投资基金中的较高风险品种，其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国海富兰克林基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉
	联系电话	021-3855 5555
	电子邮箱	service@ftsfund.com
客户服务电话	400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555	95566
传真	021-6888 3050	010-6659 4942
注册地址	广西南宁市西乡塘区总部 路 1 号中国-东盟科技企业	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	孵化基地一期 A-13 栋三层 306 号房	
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 9 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	吴显玲	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国海富兰克林基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 8 号国金 中心二期 9 层



### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	38,426.28
本期利润	1,123,677.42
加权平均基金份额本期利润	0.0763
本期加权平均净值利润率	7.03%
本期基金份额净值增长率	18.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	40,709,595.05
期末可供分配基金份额利润	0.1106
期末基金资产净值	408,673,221.91
期末基金份额净值	1.111
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	11.10%

注：

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

#### 3.2 基金净值表现

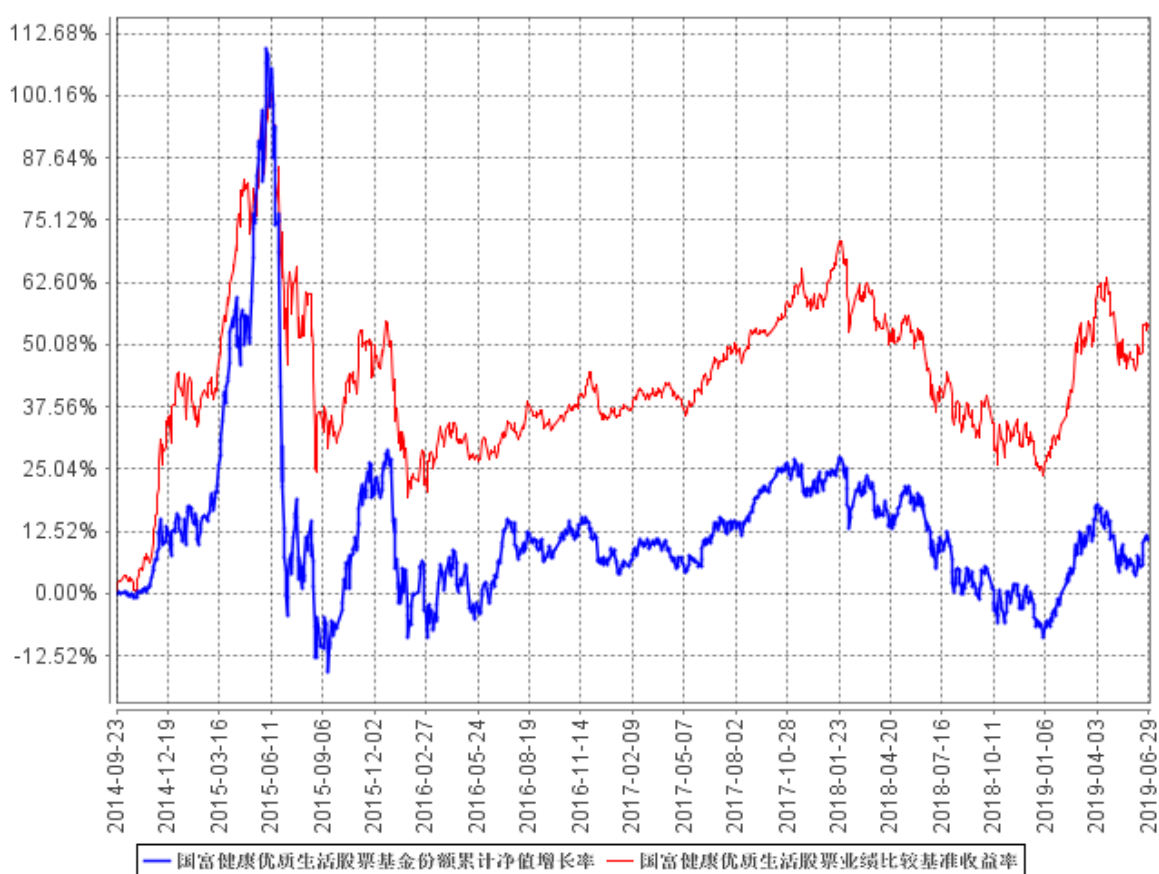
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.71%	1.03%	4.65%	0.98%	0.06%	0.05%
过去三个月	-3.48%	1.38%	-1.10%	1.29%	-2.38%	0.09%

过去六个月	18.57%	1.37%	22.72%	1.31%	-4.15%	0.06%
过去一年	0.45%	1.41%	8.26%	1.30%	-7.81%	0.11%
过去三年	4.61%	1.11%	18.28%	0.94%	-13.67%	0.17%
自基金合同生效起至今	11.10%	1.84%	53.95%	1.36%	-42.85%	0.48%

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

国富健康优质生活股票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 2014 年 9 月 23 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

本公司具有丰富的管理基金经验。自 2005 年 6 月第一只基金成立开始，截至本报告期末，本公司旗下运作 32 只基金产品。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王晓宁	公司研究分析部副总经理、国富策略回报混合基金及国富健康优质生活股票基金的基金经理	2014 年 9 月 23 日	-	15 年	王晓宁先生，中央财经大学学士。历任万家基金管理有限公司研究员、研究总监助理、基金经理助理，国海富兰克林基金管理有限公司行业研究主管、国富潜力组合混合基金、国富成长动力混合基金及国富策略回报混合基金的基金经理助理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部副总经理、国富策略回报混合基金及国富健康优质生活股票基金的基金经理。

注：

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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《富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

报告期内公司不存在投资组合之间发生的同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

体下降，信用分化加剧。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会（简称“估值委员会”），并已制订了《公允估值管理办法》。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。

报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由总经理或其任命者负责，成员包括投研、风险控制、监察稽核、交易、基金核算方面的部门主管，相关人员均具有丰富的证券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。

#### **4.7 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的利润。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

报告期内，本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。本报告期内本基金管理人积极开展持续营销，努力落实解决方案。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	182,072,136.03	1,263,772.41
结算备付金		13,901.20	19,695.11
存出保证金		3,640.53	13,244.62
交易性金融资产	6.4.7.2	382,943,674.25	7,162,647.00
其中：股票投资		382,943,674.25	7,162,647.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	279,332.55
应收利息	6.4.7.5	15,455.80	321.24
应收股利		-	-
应收申购款		124.83	10,134.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		565,048,932.64	8,749,147.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		155,894,347.21	-
应付赎回款		9,917.34	-
应付管理人报酬		60,286.09	11,619.00
应付托管费		10,047.66	1,936.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	362,336.33	9,880.32



应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	38,776.10	132,000.00
负债合计		156,375,710.73	155,435.79
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	367,963,626.86	9,175,287.22
未分配利润	6.4.7.10	40,709,595.05	-581,575.27
所有者权益合计		408,673,221.91	8,593,711.95
负债和所有者权益总计		565,048,932.64	8,749,147.74

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

## 6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		1,737,165.63	-2,878,979.30
1.利息收入		20,071.16	33,611.03
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,071.16	31,201.14
债券利息收入		-	2,409.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		629,333.89	-140,027.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	344,539.36	-338,459.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	6,622.24
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	284,794.53	191,809.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,085,251.14	-2,837,092.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,509.44	64,529.71
<b>减：二、费用</b>		613,488.21	775,305.00

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	118,502.08	359,358.73
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,750.36	59,893.08
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	425,007.99	273,330.45
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.17
7. 其他费用	6.4.7.19	50,227.78	82,722.57
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,123,677.42	-3,654,284.30
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,123,677.42	-3,654,284.30

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	9,175,287.22	-581,575.27	8,593,711.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,123,677.42	1,123,677.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	358,788,339.64	40,167,492.90	398,955,832.54
其中：1.基金申购款	360,213,837.27	40,314,323.55	400,528,160.82
2.基金赎回款	-1,425,497.63	-146,830.65	-1,572,328.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	367,963,626.86	40,709,595.05	408,673,221.91

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	11,326,639.73	2,582,731.72	13,909,371.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,654,284.30	-3,654,284.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	14,210,346.24	3,777,179.81	17,987,526.05
其中：1.基金申购款	37,200,618.50	8,459,241.89	45,659,860.39
2.基金赎回款	-22,990,272.26	-4,682,062.08	-27,672,334.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	25,536,985.97	2,705,627.23	28,242,613.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
林勇	林勇	龚黎
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]第 1648 号《关于核准富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金募集的批复》注册,由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 295,831,329.11 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 560 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基

金基金合同》于 2014 年 9 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 295,887,926.59 份。本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 56,597.48 元。在本基金成立后，其中 56,597.48 元折算为 56,597.48 份基金份额，划入基金份额持有人账户。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 80%-95%，其中投资于与提升居民健康和生活品质主题直接相关行业的股票比例不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具投资比例为基金资产的 5%-20%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×85%+中债国债总指数（全价）收益率×15%。

本财务报表由本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于 2019 年 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金报告期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日期间经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让

2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	182,072,136.03
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	182,072,136.03

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	383,096,781.82	382,943,674.25	-153,107.57

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	383,096,781.82	382,943,674.25	-153,107.57

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	7,448.88
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5.52
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	7,999.96
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.44
合计	15,455.80

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	362,336.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	362,336.33

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	23.32
审计费	29,752.78
账户维护费	9,000.00
合计	38,776.10

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,175,287.22	9,175,287.22
本期申购	360,213,837.27	360,213,837.27
本期赎回(以“-”号填列)	-1,425,497.63	-1,425,497.63
本期末	367,963,626.86	367,963,626.86

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,765,520.68	-3,347,095.95	-581,575.27
本期利润	38,426.28	1,085,251.14	1,123,677.42
本期基金份额交易产生的变动数	111,009,118.45	-70,841,625.55	40,167,492.90
其中：基金申购款	111,453,354.36	-71,139,030.81	40,314,323.55
基金赎回款	-444,235.91	297,405.26	-146,830.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	113,813,065.41	-73,103,470.36	40,709,595.05



**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	11,824.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	188.83
其他	8,057.64
合计	20,071.16

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	14,381,600.01
减：卖出股票成本总额	14,037,060.65
买卖股票差价收入	344,539.36

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	284,794.53
基金投资产生的股利收益	-
合计	284,794.53

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	1,085,251.14
——股票投资	1,085,251.14
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	1,085,251.14

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	2,507.78
转换费收入	1.66
合计	2,509.44

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	425,007.99
银行间市场交易费用	-
合计	425,007.99

### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	-
账户维护费	18,000.00
银行汇划费用	1,875.00
其他手续费	600.00
合计	50,227.78

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 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。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
国海证券股份有限公司(“国海证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

### 6.4.10.1.2 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。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	118,502.08	359,358.73
其中：支付销售机构的客户维护费	31,563.48	39,556.05

注：支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,750.36	59,893.08

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

1. 基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

2. 本报告期和上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

1. 本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
2. 本报告期末和上年度末（2018 年 12 月 31 日）除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	182,072,136.03	11,824.69	4,964,562.65	29,367.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配情况。

#### 6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于债券型基金，谋求稳定和可持续的长期收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险控制部负责投资风险管理与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能

性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2018 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证

券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。



## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	182,072,136.03	-	-	-	182,072,136.03
结算备付金	13,901.20	-	-	-	13,901.20
存出保证金	3,640.53	-	-	-	3,640.53
交易性金融资产	-	-	-	382,943,674.25	382,943,674.25
应收利息	-	-	-	15,455.80	15,455.80
应收申购款	-	-	-	124.83	124.83
资产总计	182,089,677.76	-	-	382,959,254.88	565,048,932.64
负债					
应付证券清算款	-	-	-	155,894,347.21	155,894,347.21
应付赎回款	-	-	-	9,917.34	9,917.34
应付管理人报酬	-	-	-	60,286.09	60,286.09
应付托管费	-	-	-	10,047.66	10,047.66
应付交易费用	-	-	-	362,336.33	362,336.33
其他负债	-	-	-	38,776.10	38,776.10
负债总计	-	-	-	156,375,710.73	156,375,710.73
利率敏感度缺口	182,089,677.76	-	-	226,583,544.15	408,673,221.91
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,263,772.41	-	-	-	1,263,772.41
结算备付金	19,695.11	-	-	-	19,695.11
存出保证金	13,244.62	-	-	-	13,244.62
交易性金融资产	-	-	-	7,162,647.00	7,162,647.00
应收证券清算款	-	-	-	279,332.55	279,332.55
应收利息	-	-	-	321.24	321.24
应收申购款	-	-	-	10,134.81	10,134.81
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,296,712.14	-	-	7,452,435.60	8,749,147.74
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	11,619.00	11,619.00
应付托管费	-	-	-	1,936.47	1,936.47
应付交易费用	-	-	-	9,880.32	9,880.32
其他负债	-	-	-	132,000.00	132,000.00
负债总计	-	-	-	155,435.79	155,435.79

利率敏感度缺口	1,296,712.14	-	-	7,296,999.81	8,593,711.95
---------	--------------	---	---	--------------	--------------

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2018 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 80%-95%，其中投资于与提升居民健康和生活品质主题直接相关行业的股票比例不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具投资比例为基金资产的 5%-20%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)

指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	382,943,674.25	93.70	7,162,647.00	83.35
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	382,943,674.25	93.70	7,162,647.00	83.35

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 1,988	增加约 47
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 1,988	减少约 47	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 382,943,674.25 元，无属于第二层次及第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 7,162,647.00 元，无第二或第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	382,943,674.25	67.77
	其中：股票	382,943,674.25	67.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	182,086,037.23	32.22
8	其他各项资产	19,221.16	0.00
9	合计	565,048,932.64	100.00

注：鉴于部分资产占基金总资产的比例过于微小，四舍五入后无法通过小数点后两位数据加以列示，故标注为“0.00”。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,582,364.03	1.37
B	采矿业	12,311,248.00	3.01
C	制造业	149,449,679.29	36.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,711,494.00	2.13
E	建筑业	11,636,248.00	2.85

F	批发和零售业	5,533,727.00	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	11,593,725.00	2.84
H	住宿和餐饮业	179,800.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,247,742.25	3.49
J	金融业	136,415,594.00	33.38
K	房地产业	17,235,562.00	4.22
L	租赁和商务服务业	5,331,074.00	1.30
M	科学研究和技术服务业	260,040.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	451,041.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,026,630.68	0.50
R	文化、体育和娱乐业	1,977,705.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	382,943,674.25	93.70

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未通过港股通交易机制投资港股。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	313,400	27,770,374.00	6.80
2	600519	贵州茅台	15,300	15,055,200.00	3.68
3	600036	招商银行	417,700	15,028,846.00	3.68
4	601166	兴业银行	473,800	8,665,802.00	2.12
5	000651	格力电器	152,300	8,376,500.00	2.05
6	000333	美的集团	142,452	7,387,560.72	1.81
7	000858	五粮液	58,400	6,888,280.00	1.69
8	600276	恒瑞医药	95,400	6,296,400.00	1.54
9	600887	伊利股份	187,200	6,254,352.00	1.53
10	600030	中信证券	237,000	5,642,970.00	1.38
11	601939	建设银行	695,000	5,170,800.00	1.27
12	601328	交通银行	843,700	5,163,444.00	1.26
13	000001	平安银行	368,400	5,076,552.00	1.24
14	600016	民生银行	765,500	4,860,925.00	1.19

15	601398	工商银行	814,000	4,794,460.00	1.17
16	601288	农业银行	1,187,900	4,276,440.00	1.05
17	600000	浦发银行	362,900	4,238,672.00	1.04
18	000002	万科A	150,300	4,179,843.00	1.02
19	300498	温氏股份	114,100	4,091,626.00	1.00
20	601668	中国建筑	649,500	3,734,625.00	0.91
21	600900	长江电力	205,000	3,669,500.00	0.90
22	601601	中国太保	97,500	3,559,725.00	0.87
23	600837	海通证券	246,600	3,499,254.00	0.86
24	002415	海康威视	120,400	3,320,632.00	0.81
25	600048	保利地产	219,600	2,802,096.00	0.69
26	600104	上汽集团	108,700	2,771,850.00	0.68
27	601169	北京银行	458,900	2,712,099.00	0.66
28	002304	洋河股份	22,200	2,698,632.00	0.66
29	601888	中国国旅	29,800	2,641,770.00	0.65
30	603288	海天味业	24,580	2,580,900.00	0.63
31	601211	国泰君安	137,700	2,526,795.00	0.62
32	600585	海螺水泥	60,800	2,523,200.00	0.62
33	000725	京东方A	726,300	2,498,472.00	0.61
34	601688	华泰证券	110,800	2,473,056.00	0.61
35	601766	中国中车	299,300	2,421,337.00	0.59
36	600009	上海机场	28,900	2,421,242.00	0.59
37	300059	东方财富	176,415	2,390,423.25	0.58
38	600031	三一重工	182,100	2,381,868.00	0.58
39	000063	中兴通讯	70,600	2,296,618.00	0.56
40	600028	中国石化	413,600	2,262,392.00	0.55
41	601012	隆基股份	92,200	2,130,742.00	0.52
42	600340	华夏幸福	64,600	2,104,022.00	0.51
43	601088	中国神华	102,700	2,093,026.00	0.51
44	600309	万华化学	47,900	2,049,641.00	0.50
45	601229	上海银行	170,000	2,014,500.00	0.49
46	600690	海尔智家	112,000	1,936,480.00	0.47
47	002142	宁波银行	79,300	1,922,232.00	0.47
48	601818	光大银行	496,700	1,892,427.00	0.46
49	000338	潍柴动力	148,400	1,823,836.00	0.45
50	600019	宝钢股份	273,400	1,777,100.00	0.43
51	002475	立讯精密	71,200	1,765,048.00	0.43
52	600050	中国联通	281,900	1,736,504.00	0.42
53	601857	中国石油	250,300	1,722,064.00	0.42

54	000568	泸州老窖	21,100	1,705,513.00	0.42
55	002027	分众传媒	317,800	1,681,162.00	0.41
56	601989	中国重工	289,200	1,607,952.00	0.39
57	600919	江苏银行	214,700	1,558,722.00	0.38
58	601933	永辉超市	149,200	1,523,332.00	0.37
59	601009	南京银行	183,600	1,516,536.00	0.37
60	002202	金风科技	122,000	1,516,460.00	0.37
61	601390	中国中铁	232,500	1,515,900.00	0.37
62	601006	大秦铁路	186,700	1,510,403.00	0.37
63	001979	招商蛇口	72,250	1,510,025.00	0.37
64	600999	招商证券	88,100	1,505,629.00	0.37
65	002230	科大讯飞	45,100	1,499,124.00	0.37
66	002714	牧原股份	25,357	1,490,738.03	0.36
67	601628	中国人寿	50,700	1,435,824.00	0.35
68	600406	国电南瑞	76,400	1,424,096.00	0.35
69	000661	长春高新	4,200	1,419,600.00	0.35
70	002594	比亚迪	27,800	1,410,016.00	0.35
71	601186	中国铁建	141,700	1,409,915.00	0.34
72	000166	申万宏源	278,200	1,393,782.00	0.34
73	601336	新华保险	25,300	1,392,259.00	0.34
74	601899	紫金矿业	366,900	1,383,213.00	0.34
75	002024	苏宁易购	114,600	1,315,608.00	0.32
76	600570	恒生电子	19,200	1,308,480.00	0.32
77	000538	云南白药	15,400	1,284,668.00	0.31
78	000776	广发证券	90,700	1,246,218.00	0.30
79	601669	中国电建	235,000	1,243,150.00	0.30
80	600352	浙江龙盛	76,000	1,198,520.00	0.29
81	300015	爱尔眼科	38,044	1,178,222.68	0.29
82	600958	东方证券	109,600	1,170,528.00	0.29
83	601225	陕西煤业	123,400	1,140,216.00	0.28
84	000100	TCL 集团	335,700	1,117,881.00	0.27
85	000876	新希望	63,800	1,108,206.00	0.27
86	300142	沃森生物	38,600	1,094,696.00	0.27
87	600436	片仔癀	9,200	1,059,840.00	0.26
88	600741	华域汽车	49,000	1,058,400.00	0.26
89	600588	用友网络	38,700	1,040,256.00	0.25
90	601155	新城控股	26,100	1,039,041.00	0.25
91	600271	航天信息	44,300	1,021,115.00	0.25
92	002736	国信证券	74,300	977,788.00	0.24



93	600660	福耀玻璃	42,800	972,844.00	0.24
94	600547	山东黄金	23,200	955,144.00	0.23
95	601377	兴业证券	140,000	943,600.00	0.23
96	600010	包钢股份	558,300	943,527.00	0.23
97	000157	中联重科	156,800	942,368.00	0.23
98	000783	长江证券	120,100	937,981.00	0.23
99	600795	国电电力	356,800	906,272.00	0.22
100	600705	中航资本	166,400	901,888.00	0.22
101	002008	大族激光	26,013	894,326.94	0.22
102	601111	中国国航	91,800	878,526.00	0.21
103	000069	华侨城 A	125,200	870,140.00	0.21
104	600111	北方稀土	66,700	856,428.00	0.21
105	600011	华能国际	137,300	855,379.00	0.21
106	600703	三安光电	75,700	853,896.00	0.21
107	002044	美年健康	68,200	848,408.00	0.21
108	603993	洛阳钼业	213,300	844,668.00	0.21
109	600089	特变电工	115,300	835,925.00	0.20
110	601108	财通证券	75,800	832,284.00	0.20
111	600383	金地集团	69,700	831,521.00	0.20
112	600438	通威股份	58,700	825,322.00	0.20
113	600886	国投电力	105,700	821,289.00	0.20
114	601800	中国交建	70,800	801,456.00	0.20
115	601985	中国核电	143,400	797,304.00	0.20
116	002422	科伦药业	26,800	796,764.00	0.19
117	600029	南方航空	103,100	795,932.00	0.19
118	002236	大华股份	54,600	792,792.00	0.19
119	601600	中国铝业	201,200	788,704.00	0.19
120	002001	新 和 成	40,600	783,174.00	0.19
121	600196	复星医药	30,700	776,710.00	0.19
122	002007	华兰生物	25,400	774,446.00	0.19
123	601555	东吴证券	74,100	759,525.00	0.19
124	600606	绿地控股	111,000	758,130.00	0.19
125	600115	东方航空	120,900	758,043.00	0.19
126	002311	海大集团	24,500	757,050.00	0.19
127	000895	双汇发展	30,300	754,167.00	0.18
128	300122	智飞生物	17,100	737,010.00	0.18
129	300003	乐普医疗	31,900	734,338.00	0.18
130	600109	国金证券	75,000	729,000.00	0.18
131	600221	海航控股	356,300	723,289.00	0.18

132	600061	国投资本	51,200	717,312.00	0.18
133	300124	汇川技术	30,900	707,919.00	0.17
134	600177	雅戈尔	107,700	683,895.00	0.17
135	000963	华东医药	26,300	682,748.00	0.17
136	601788	光大证券	59,700	681,774.00	0.17
137	600487	亨通光电	40,600	680,456.00	0.17
138	601618	中国中冶	223,800	680,352.00	0.17
139	000413	东旭光电	132,200	679,508.00	0.17
140	000768	中航飞机	43,100	678,825.00	0.17
141	600637	东方明珠	64,300	677,722.00	0.17
142	600332	白云山	16,500	676,005.00	0.17
143	002410	广联达	20,500	674,245.00	0.16
144	600100	同方股份	73,600	666,080.00	0.16
145	600018	上港集团	97,000	661,540.00	0.16
146	002508	老板电器	24,000	651,360.00	0.16
147	000425	徐工机械	144,800	645,808.00	0.16
148	601607	上海医药	35,300	640,695.00	0.16
149	300033	同花顺	6,500	639,340.00	0.16
150	002352	顺丰控股	18,800	638,448.00	0.16
151	600893	航发动力	28,100	638,151.00	0.16
152	300017	网宿科技	58,800	633,864.00	0.16
153	300408	三环集团	31,100	604,895.00	0.15
154	601919	中远海控	120,300	603,906.00	0.15
155	600176	中国巨石	63,330	603,534.90	0.15
156	002271	东方雨虹	26,600	602,756.00	0.15
157	601877	正泰电器	26,000	600,340.00	0.15
158	601727	上海电气	111,200	598,256.00	0.15
159	600498	烽火通信	21,400	596,204.00	0.15
160	600004	白云机场	32,000	582,400.00	0.14
161	600867	通化东宝	37,300	574,420.00	0.14
162	600023	浙能电力	129,000	570,180.00	0.14
163	601998	中信银行	94,900	566,553.00	0.14
164	000423	东阿阿胶	14,100	561,462.00	0.14
165	002460	赣锋锂业	23,821	558,126.03	0.14
166	600489	中金黄金	54,300	557,661.00	0.14
167	601018	宁波港	122,000	535,580.00	0.13
168	600809	山西汾酒	7,734	534,032.70	0.13
169	600068	葛洲坝	85,400	532,042.00	0.13
170	600066	宇通客车	40,800	531,216.00	0.13

171	600170	上海建工	141,000	530,160.00	0.13
172	600926	杭州银行	63,500	528,955.00	0.13
173	603899	晨光文具	12,000	527,640.00	0.13
174	002673	西部证券	52,200	526,176.00	0.13
175	002466	天齐锂业	20,800	525,824.00	0.13
176	002179	中航光电	15,700	525,322.00	0.13
177	601997	贵阳银行	60,400	522,460.00	0.13
178	300024	机器人	34,300	522,389.00	0.13
179	002602	世纪华通	47,700	520,884.00	0.13
180	002081	金螳螂	50,400	519,624.00	0.13
181	600219	南山铝业	227,900	515,054.00	0.13
182	002241	歌尔股份	57,100	507,619.00	0.12
183	600362	江西铜业	31,600	497,384.00	0.12
184	601021	春秋航空	11,000	495,000.00	0.12
185	600398	海澜之家	54,500	494,315.00	0.12
186	603156	养元饮品	13,300	493,164.00	0.12
187	600085	同仁堂	17,000	493,000.00	0.12
188	300144	宋城演艺	21,300	492,882.00	0.12
189	000630	铜陵有色	200,200	492,492.00	0.12
190	000961	中南建设	56,800	491,888.00	0.12
191	601198	东兴证券	41,300	490,644.00	0.12
192	002739	万达电影	26,500	488,660.00	0.12
193	601838	成都银行	55,300	488,299.00	0.12
194	002146	荣盛发展	52,000	488,280.00	0.12
195	000786	北新建材	26,900	487,697.00	0.12
196	600674	川投能源	54,700	486,830.00	0.12
197	000728	国元证券	52,900	485,093.00	0.12
198	600482	中国动力	20,300	479,486.00	0.12
199	600297	广汇汽车	103,900	463,394.00	0.11
200	601881	中国银河	37,700	461,825.00	0.11
201	000703	恒逸石化	33,800	461,708.00	0.11
202	002493	荣盛石化	37,600	453,456.00	0.11
203	601138	工业富联	37,500	451,875.00	0.11
204	000629	攀钢钒钛	133,100	451,209.00	0.11
205	300070	碧水源	57,900	451,041.00	0.11
206	603986	兆易创新	5,200	450,840.00	0.11
207	002555	三七互娱	33,200	449,860.00	0.11
208	600535	天士力	27,100	448,505.00	0.11
209	002050	三花智控	42,090	444,049.50	0.11

210	603799	华友钴业	19,800	421,938.00	0.10
211	600663	陆家嘴	27,200	421,600.00	0.10
212	603833	欧派家居	3,900	419,718.00	0.10
213	300296	利亚德	53,100	415,773.00	0.10
214	000596	古井贡酒	3,500	414,785.00	0.10
215	600369	西南证券	83,600	412,984.00	0.10
216	002624	完美世界	16,000	412,960.00	0.10
217	000627	天茂集团	63,600	412,764.00	0.10
218	000656	金科股份	68,300	411,849.00	0.10
219	002065	东华软件	58,800	411,012.00	0.10
220	600118	中国卫星	18,200	410,410.00	0.10
221	600516	XR 方大炭	32,200	395,738.00	0.10
222	300136	信维通信	15,800	386,310.00	0.09
223	601992	金隅集团	101,900	383,144.00	0.09
224	600153	建发股份	42,900	380,952.00	0.09
225	600027	华电国际	100,600	379,262.00	0.09
226	000625	长安汽车	57,200	379,236.00	0.09
227	002032	苏泊尔	5,000	379,150.00	0.09
228	000709	河钢股份	126,300	377,637.00	0.09
229	600760	中航沈飞	13,000	377,390.00	0.09
230	600583	海油工程	67,200	376,320.00	0.09
231	603160	汇顶科技	2,700	374,760.00	0.09
232	600038	中直股份	9,100	373,282.00	0.09
233	601117	中国化学	61,200	368,424.00	0.09
234	600977	中国电影	22,300	349,218.00	0.09
235	002153	石基信息	9,600	347,424.00	0.09
236	002558	巨人网络	18,800	341,596.00	0.08
237	600688	上海石化	66,200	341,592.00	0.08
238	600415	小商品城	82,300	339,076.00	0.08
239	600816	安信信托	67,000	338,350.00	0.08
240	000671	阳光城	52,200	338,256.00	0.08
241	601066	中信建投	15,500	326,740.00	0.08
242	600298	安琪酵母	10,000	316,300.00	0.08
243	601238	广汽集团	28,200	308,226.00	0.08
244	000402	金融街	38,900	304,976.00	0.07
245	601633	长城汽车	36,700	303,509.00	0.07
246	601319	中国人保	31,900	302,731.00	0.07
247	600188	兖州煤业	27,700	301,099.00	0.07
248	600704	物产中大	55,500	300,810.00	0.07

249	002310	东方园林	50,100	300,600.00	0.07
250	002294	信立泰	13,400	299,892.00	0.07
251	300072	三聚环保	37,700	298,961.00	0.07
252	600566	济川药业	9,900	298,089.00	0.07
253	002601	龙蟠佰利	20,100	298,083.00	0.07
254	002010	传化智联	39,500	297,435.00	0.07
255	300413	芒果超媒	6,500	266,825.00	0.07
256	002120	韵达股份	8,600	265,052.00	0.06
257	601898	中煤能源	55,000	264,000.00	0.06
258	601360	三六零	12,200	260,836.00	0.06
259	002773	康弘药业	7,900	260,068.00	0.06
260	603259	药明康德	3,000	260,040.00	0.06
261	000898	鞍钢股份	66,250	251,087.50	0.06
262	601228	广州港	55,500	231,990.00	0.06
263	002411	延安必康	13,300	231,420.00	0.06
264	002468	申通快递	9,100	226,954.00	0.06
265	600998	九州通	18,300	226,188.00	0.06
266	000938	紫光股份	8,300	226,175.00	0.06
267	600372	中航电子	15,200	225,568.00	0.06
268	600025	华能水电	55,400	225,478.00	0.06
269	000415	渤海租赁	57,300	224,616.00	0.05
270	600339	中油工程	53,000	223,660.00	0.05
271	000681	视觉中国	10,000	193,800.00	0.05
272	601808	中海油服	19,500	187,785.00	0.05
273	300251	光线传媒	27,400	186,320.00	0.05
274	600258	首旅酒店	10,000	179,800.00	0.04
275	601162	天风证券	14,300	155,012.00	0.04
276	600390	五矿资本	15,900	149,937.00	0.04
277	300433	蓝思科技	21,500	149,855.00	0.04
278	000553	安道麦 A	13,900	149,008.00	0.04
279	002925	盈趣科技	3,800	148,238.00	0.04
280	600233	圆通速递	12,000	147,960.00	0.04
281	000408	藏格控股	17,800	147,206.00	0.04
282	601828	XD 美凯龙	12,100	147,015.00	0.04
283	603260	合盛硅业	3,100	145,886.00	0.04
284	601298	青岛港	14,000	117,460.00	0.03
285	601577	长沙银行	11,800	112,572.00	0.03
286	600299	安迪苏	10,700	110,959.00	0.03
287	600015	华夏银行	9,100	70,070.00	0.02

288	601901	方正证券	6,000	42,660.00	0.01
289	600522	中天科技	3,600	33,012.00	0.01
290	002456	欧菲光	2,700	21,168.00	0.01
291	600346	恒力石化	1,500	18,240.00	0.00
292	601878	浙商证券	1,900	17,670.00	0.00
293	601216	君正集团	5,000	16,450.00	0.00
294	603858	步长制药	600	15,462.00	0.00
295	002252	上海莱士	2,200	15,290.00	0.00
296	002938	鹏鼎控股	300	8,808.00	0.00
297	002945	华林证券	400	7,400.00	0.00
298	002939	长城证券	400	6,676.00	0.00
299	601212	白银有色	1,300	5,707.00	0.00
300	002625	光启技术	600	5,574.00	0.00

注：鉴于部分股票占基金资产净值的比例过于微小，四舍五入后无法通过小数点后两位数据加以列示，故标注为“0.00”。

## 7.4 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	601318	中国平安	27,561,551.25	320.72
2	600519	贵州茅台	15,120,505.00	175.95
3	600036	招商银行	14,607,772.76	169.98
4	601166	兴业银行	8,681,968.00	101.03
5	000651	格力电器	8,389,731.76	97.63
6	000333	美的集团	7,380,256.13	85.88
7	000858	五粮液	6,817,114.58	79.33
8	600276	恒瑞医药	6,347,561.20	73.86
9	600887	伊利股份	6,189,111.30	72.02
10	600030	中信证券	5,662,839.00	65.90
11	601328	交通银行	5,163,600.00	60.09
12	601939	建设银行	5,163,348.00	60.08
13	000001	平安银行	5,058,067.00	58.86
14	600016	民生银行	4,868,212.00	56.65
15	601398	工商银行	4,799,344.00	55.85

16	601288	农业银行	4,304,318.00	50.09
17	600000	浦发银行	4,236,409.00	49.30
18	000002	万科A	4,186,489.00	48.72
19	300498	温氏股份	4,094,079.28	47.64
20	601668	中国建筑	3,813,105.00	44.37
21	600900	长江电力	3,652,093.00	42.50
22	601601	中国太保	3,548,067.00	41.29
23	600837	海通证券	3,496,302.00	40.68
24	600104	上汽集团	3,214,876.00	37.41
25	002415	海康威视	3,203,303.00	37.27
26	601688	华泰证券	2,970,785.00	34.57
27	601888	中国国旅	2,888,125.00	33.61
28	600048	保利地产	2,813,379.00	32.74
29	002304	洋河股份	2,778,873.00	32.34
30	601169	北京银行	2,707,237.00	31.50
31	603288	海天味业	2,570,378.80	29.91
32	601211	国泰君安	2,512,259.00	29.23
33	000725	京东方A	2,504,828.00	29.15
34	600585	海螺水泥	2,500,262.00	29.09
35	600009	上海机场	2,471,014.00	28.75
36	601766	中国中车	2,433,771.00	28.32
37	300059	东方财富	2,410,315.00	28.05
38	600031	三一重工	2,367,613.37	27.55
39	000063	中兴通讯	2,305,696.00	26.83
40	600028	中国石化	2,258,425.00	26.28
41	601012	隆基股份	2,129,852.18	24.78
42	601818	光大银行	2,120,083.00	24.67
43	601088	中国神华	2,091,590.00	24.34
44	600309	万华化学	2,061,773.00	23.99
45	601229	上海银行	2,018,770.00	23.49
46	600690	海尔智家	1,938,220.00	22.55
47	002142	宁波银行	1,902,356.00	22.14
48	600340	华夏幸福	1,857,367.00	21.61
49	000338	潍柴动力	1,831,716.00	21.31
50	002230	科大讯飞	1,798,305.00	20.93
51	600019	宝钢股份	1,789,392.00	20.82

52	002475	立讯精密	1,761,066.00	20.49
53	600050	中国联通	1,747,097.49	20.33
54	601857	中国石油	1,741,143.00	20.26
55	002027	分众传媒	1,714,637.00	19.95
56	000568	泸州老窖	1,686,412.00	19.62
57	601989	中国重工	1,620,506.00	18.86
58	600406	国电南瑞	1,573,563.92	18.31
59	600919	江苏银行	1,562,202.00	18.18
60	601009	南京银行	1,523,409.00	17.73
61	001979	招商蛇口	1,522,810.00	17.72
62	601390	中国中铁	1,519,742.00	17.68
63	600999	招商证券	1,518,031.00	17.66
64	601006	大秦铁路	1,517,068.00	17.65
65	601933	永辉超市	1,505,523.00	17.52
66	002714	牧原股份	1,475,092.86	17.16
67	601628	中国人寿	1,441,552.00	16.77
68	000661	长春高新	1,415,272.00	16.47
69	601186	中国铁建	1,407,740.00	16.38
70	000166	申万宏源	1,407,133.00	16.37
71	601336	新华保险	1,406,444.00	16.37
72	002594	比亚迪	1,405,912.00	16.36
73	601899	紫金矿业	1,379,865.00	16.06
74	600570	恒生电子	1,319,845.10	15.36
75	002024	苏宁易购	1,301,240.00	15.14
76	000538	云南白药	1,270,526.00	14.78
77	601669	中国电建	1,257,253.00	14.63
78	000776	广发证券	1,253,309.00	14.58
79	600271	航天信息	1,234,927.00	14.37
80	600352	浙江龙盛	1,187,469.00	13.82
81	600958	东方证券	1,182,553.00	13.76
82	300015	爱尔眼科	1,181,095.76	13.74
83	601225	陕西煤业	1,153,385.00	13.42
84	002202	金风科技	1,106,878.00	12.88
85	000100	TCL 集团	1,105,598.00	12.87
86	000876	新希望	1,087,155.00	12.65
87	300142	沃森生物	1,074,251.08	12.50



88	600436	片仔癀	1,064,837.00	12.39
89	600741	华域汽车	1,061,191.00	12.35
90	601155	新城控股	1,050,911.00	12.23
91	600588	用友网络	1,031,348.00	12.00
92	002736	国信证券	984,389.00	11.45
93	600547	山东黄金	959,170.00	11.16
94	000157	中联重科	956,272.00	11.13
95	600660	福耀玻璃	952,608.00	11.08
96	600010	包钢股份	952,292.00	11.08
97	601377	兴业证券	947,564.00	11.03
98	000783	长江证券	917,955.00	10.68
99	600795	国电电力	913,664.00	10.63
100	002008	大族激光	906,973.40	10.55
101	600705	中航资本	903,515.00	10.51
102	000069	华侨城 A	873,801.00	10.17
103	600011	华能国际	872,085.00	10.15
104	600703	三安光电	870,717.98	10.13
105	002044	美年健康	870,500.00	10.13
106	601111	中国国航	869,806.00	10.12
107	603993	洛阳钼业	868,955.00	10.11
108	600089	特变电工	841,351.00	9.79
109	600111	北方稀土	836,950.00	9.74
110	600438	通威股份	836,407.00	9.73
111	600886	国投电力	835,519.00	9.72
112	600383	金地集团	833,270.00	9.70
113	601108	财通证券	830,765.00	9.67
114	300122	智飞生物	829,276.00	9.65
115	002001	新和成	803,430.00	9.35
116	601985	中国核电	800,373.00	9.31
117	601800	中国交建	797,991.00	9.29
118	601600	中国铝业	797,726.00	9.28
119	002422	科伦药业	796,920.00	9.27
120	600029	南方航空	795,814.00	9.26
121	600196	复星医药	793,510.00	9.23
122	002236	大华股份	791,307.00	9.21
123	600606	绿地控股	766,193.00	8.92

124	002007	华兰生物	759,801.00	8.84
125	000895	双汇发展	758,072.00	8.82
126	601555	东吴证券	757,825.00	8.82
127	600115	东方航空	756,009.00	8.80
128	002311	海大集团	746,662.00	8.69
129	600221	海航控股	723,689.00	8.42
130	300003	乐普医疗	723,280.00	8.42
131	600061	国投资本	722,303.00	8.41
132	300124	汇川技术	719,105.00	8.37
133	600109	国金证券	718,680.00	8.36
134	601618	中国中冶	685,234.00	7.97
135	601788	光大证券	683,387.00	7.95
136	000768	中航飞机	682,956.00	7.95
137	600177	雅戈尔	682,914.00	7.95
138	000963	华东医药	681,896.00	7.93
139	600637	东方明珠	681,725.00	7.93
140	000413	东旭光电	680,768.00	7.92
141	600332	白云山	680,598.00	7.92
142	600487	亨通光电	679,723.00	7.91
143	600100	同方股份	678,352.00	7.89
144	600018	上港集团	670,880.00	7.81
145	600362	江西铜业	669,267.00	7.79
146	002410	广联达	650,555.00	7.57
147	000425	徐工机械	649,288.00	7.56
148	601607	上海医药	646,145.00	7.52
149	600893	航发动力	645,823.00	7.52
150	600004	白云机场	645,463.00	7.51
151	002508	老板电器	645,443.00	7.51
152	300033	同花顺	642,678.00	7.48
153	300017	网宿科技	640,752.00	7.46
154	002352	顺丰控股	637,886.00	7.42
155	601919	中远海控	610,533.00	7.10
156	601877	正泰电器	608,201.00	7.08
157	601727	上海电气	606,128.00	7.05
158	600176	中国巨石	605,176.30	7.04
159	300408	三环集团	604,401.00	7.03

160	600498	烽火通信	603,334.00	7.02
161	002271	东方雨虹	600,695.00	6.99
162	600867	通化东宝	574,719.00	6.69
163	600023	浙能电力	572,188.00	6.66
164	601998	中信银行	570,950.00	6.64
165	002460	赣锋锂业	567,309.12	6.60
166	000423	东阿阿胶	563,673.00	6.56
167	600068	葛洲坝	533,930.00	6.21
168	002179	中航光电	533,598.00	6.21
169	002466	天齐锂业	533,583.00	6.21
170	600170	上海建工	532,982.00	6.20
171	300024	机器人	532,435.00	6.20
172	600066	宇通客车	531,466.00	6.18
173	600926	杭州银行	530,915.00	6.18
174	601997	贵阳银行	530,695.00	6.18
175	002673	西部证券	530,017.00	6.17
176	601018	宁波港	529,911.72	6.17
177	002602	世纪华通	529,707.00	6.16
178	600489	中金黄金	529,507.00	6.16
179	600219	南山铝业	527,739.00	6.14
180	002081	金螳螂	527,555.00	6.14
181	600809	山西汾酒	525,868.92	6.12
182	603156	养元饮品	498,040.60	5.80
183	601021	春秋航空	497,282.00	5.79
184	000630	铜陵有色	496,903.00	5.78
185	300144	宋城演艺	496,419.00	5.78
186	002146	荣盛发展	495,159.00	5.76
187	600085	同仁堂	494,676.00	5.76
188	000961	中南建设	494,431.00	5.75
189	002405	四维图新	494,176.00	5.75
190	601838	成都银行	493,611.00	5.74
191	600674	川投能源	493,015.00	5.74
192	601198	东兴证券	492,756.00	5.73
193	002739	万达电影	491,040.00	5.71
194	000786	北新建材	490,322.00	5.71
195	600398	海澜之家	490,134.00	5.70

196	002241	歌尔股份	489,958.00	5.70
197	600482	中国动力	488,241.00	5.68
198	000728	国元证券	487,747.00	5.68
199	600297	广汇汽车	461,142.00	5.37
200	002555	三七互娱	457,438.00	5.32
201	002493	荣盛石化	457,301.00	5.32
202	601138	工业富联	456,063.00	5.31
203	300070	碧水源	455,750.00	5.30
204	601881	中国银河	455,713.00	5.30
205	002050	三花智控	455,524.10	5.30
206	000703	恒逸石化	455,450.00	5.30
207	600535	天士力	455,289.00	5.30
208	000629	攀钢钒钛	455,193.00	5.30
209	603986	兆易创新	452,194.00	5.26
210	600298	安琪酵母	451,986.00	5.26
211	600663	陆家嘴	421,422.80	4.90
212	603799	华友钴业	420,356.00	4.89
213	300296	利亚德	418,608.00	4.87
214	002624	完美世界	418,074.00	4.86
215	000627	天茂集团	417,737.00	4.86
216	002065	东华软件	417,683.00	4.86
217	600369	西南证券	417,157.00	4.85
218	600118	中国卫星	416,214.00	4.84
219	000656	金科股份	415,013.00	4.83
220	002129	中环股份	413,756.00	4.81
221	603833	欧派家居	412,437.00	4.80
222	000596	古井贡酒	408,881.00	4.76
223	600516	方大炭素	391,240.00	4.55
224	300136	信维通信	389,923.00	4.54
225	603899	晨光文具	384,017.00	4.47
226	600153	建发股份	383,610.00	4.46
227	600583	海油工程	383,383.00	4.46
228	601992	金隅集团	382,174.00	4.45
229	000709	河钢股份	381,960.00	4.44
230	600760	中航沈飞	381,529.00	4.44
231	000625	长安汽车	380,240.00	4.42

232	600027	华电国际	380,100.00	4.42
233	600038	中直股份	379,562.00	4.42
234	002032	苏泊尔	378,931.00	4.41
235	601117	中国化学	376,804.00	4.38
236	603160	汇顶科技	373,892.00	4.35
237	600415	小商品城	342,632.00	3.99
238	600688	上海石化	341,942.00	3.98
239	000671	阳光城	340,442.00	3.96
240	002558	巨人网络	340,302.00	3.96
241	600977	中国电影	340,104.00	3.96
242	002153	石基信息	338,355.00	3.94
243	600816	安信信托	333,704.00	3.88
244	601066	中信建投	329,941.00	3.84
245	603711	香飘飘	321,209.00	3.74
246	601238	广汽集团	304,783.00	3.55
247	002294	信立泰	304,485.00	3.54
248	600188	兖州煤业	304,046.00	3.54
249	002601	龙麟佰利	303,925.00	3.54
250	002310	东方园林	303,139.00	3.53
251	002010	传化智联	303,052.00	3.53
252	601633	长城汽车	302,981.00	3.53
253	600704	物产中大	301,870.00	3.51
254	300072	三聚环保	301,259.00	3.51
255	601319	中国人保	301,174.00	3.50
256	000402	金融街	300,077.00	3.49
257	600566	济川药业	297,564.00	3.46
258	600718	东软集团	291,090.00	3.39
259	300251	光线传媒	272,771.00	3.17
260	300413	芒果超媒	268,634.00	3.13
261	601898	中煤能源	266,722.00	3.10
262	002120	韵达股份	265,454.00	3.09
263	601360	三六零	264,694.00	3.08
264	002773	康弘药业	263,487.00	3.07
265	000898	鞍钢股份	261,917.00	3.05
266	002876	三利谱	260,991.00	3.04
267	603259	药明康德	260,375.00	3.03

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

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	686,157.00	7.98
2	000902	新洋丰	536,176.00	6.24
3	000002	万科A	531,366.00	6.18
4	603711	香飘飘	507,105.00	5.90
5	300253	卫宁健康	506,064.34	5.89
6	002405	四维图新	468,337.00	5.45
7	601098	中南传媒	458,708.00	5.34
8	002129	中环股份	455,700.00	5.30
9	002876	三利谱	428,214.00	4.98
10	300296	利亚德	420,384.00	4.89
11	600104	上汽集团	411,669.00	4.79

12	002304	洋河股份	410,645.00	4.78
13	000681	视觉中国	380,245.00	4.42
14	601688	华泰证券	380,190.00	4.42
15	601888	中国国旅	379,197.00	4.41
16	002230	科大讯飞	377,000.00	4.39
17	600886	国投电力	329,337.00	3.83
18	300009	安科生物	314,313.00	3.66
19	600718	东软集团	309,500.00	3.60
20	002035	华帝股份	308,303.00	3.59
21	002341	新纶科技	278,000.00	3.23
22	002572	索菲亚	264,757.00	3.08
23	002202	金风科技	264,718.82	3.08
24	300251	光线传媒	252,500.00	2.94
25	600004	白云机场	236,033.00	2.75
26	600038	中直股份	225,099.00	2.62
27	002250	联化科技	222,425.00	2.59
28	600456	宝钛股份	219,000.00	2.55
29	002271	东方雨虹	218,000.00	2.54
30	601818	光大银行	207,500.00	2.41
31	600298	安琪酵母	203,000.00	2.36
32	002044	美年健康	201,600.00	2.35
33	300498	温氏股份	200,507.00	2.33
34	300146	汤臣倍健	188,284.00	2.19
35	600036	招商银行	187,550.00	2.18
36	300443	金雷股份	182,086.00	2.12
37	000830	鲁西化工	180,867.00	2.10
38	002415	海康威视	175,830.00	2.05

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

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

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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



### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

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

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

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

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
686	536,390.13	359,710,431.66	97.76%	8,253,195.20	2.24%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年9月23日）基金份额总额	295,887,926.59
本报告期期初基金份额总额	9,175,287.22
本报告期期间基金总申购份额	360,213,837.27
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,425,497.63
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	367,963,626.86

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### （一）基金管理人重大人事变动

经国海富兰克林基金管理有限公司第五届董事会第十七次会议审议通过，自 2019 年 6 月 24 日起，王雷先生不再担任公司副总经理。相关公告已于 2019 年 6 月 26 日在《中国证券报》和公司网站披露。

#### （二）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### （一）基金管理人及高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形：

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### （二）基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	151,973,107.77	37.70%	141,533.11	37.75%	-
中泰证券	1	110,909,042.52	27.52%	103,289.52	27.55%	-
海通证券	2	69,808,486.11	17.32%	65,012.67	17.34%	-
申万宏源	2	54,026,657.20	13.40%	50,315.32	13.42%	-
东方证券	2	6,563,010.74	1.63%	6,112.12	1.63%	-
银河证券	1	2,687,834.00	0.67%	2,503.20	0.67%	-
兴业证券	1	2,537,045.82	0.63%	2,362.71	0.63%	-
太平洋证券	1	1,916,301.85	0.48%	1,401.39	0.37%	-
国信证券	1	776,593.00	0.19%	723.25	0.19%	-
长江证券	2	724,244.00	0.18%	674.53	0.18%	-
东北证券	2	359,183.00	0.09%	262.67	0.07%	-
瑞银证券	1	303,599.00	0.08%	282.73	0.08%	-
华创证券	1	272,367.76	0.07%	253.66	0.07%	-
方正证券	2	203,000.00	0.05%	148.47	0.04%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

注：管理人对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其他相关因素后决定的。报告期内，本基金新增方正证券深圳交易单元 1 个。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 1 月 18 日
2	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金在部分销售机构开通转换业务	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 2 月 23 日

	的公告		
3	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加华宝证券有限责任公司基金申（认）购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 3 月 20 日
4	富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金 2018 年年度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 3 月 29 日
5	富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金 2018 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 3 月 29 日
6	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加交通银行手机银行、网上银行、柜台基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 3 月 30 日
7	富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 4 月 22 日
8	富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金更新招募说明书摘要（2019 年第 1 号）	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 5 月 6 日
9	富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金更新招募说明书（2019 年第 2 号）	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 5 月 6 日
10	关于增加嘉实财富管理有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 5 月 10 日
11	国海富兰克林基金管理有限公司关于开通直销网上交易快捷支付业务并进行费用优惠以及电话交易业务费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 5 月 20 日
12	关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 5 月 29 日
13	国海富兰克林基金管理有限公司关于提请投资者及时更新客户身份基本信息的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 6 月 19 日
14	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下部分基金可参与科创板	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 6 月 21 日

	投资及相关风险揭示的公告		
15	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中国银行股份有限公司基金定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 6 月 26 日



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019 年 6 月 27 日至 2019 年 6 月 30 日	-	179,855,215.83	-	179,855,215.83	48.88%
	2	2019 年 6 月 27 日至 2019 年 6 月 30 日	-	179,855,215.83	-	179,855,215.83	48.88%

#### 产品特有风险

##### 1. 流动性风险

投资者大额赎回所持有的基金份额时，为了实现基金资产的迅速变现，在基金交易过程中可能存在无法实现交易价格最优；亦或导致基金仓位调整困难，基金资产不能迅速转变成现金，产生流动性风险。

一旦引发巨额赎回，当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，可能出现比例赎回、延期支付赎回款等情形。

管理人有权根据本基金合同和招募说明书的约定，基于投资者保护原则，暂停或拒绝申购、暂停赎回。

该基金投资者集中度较高，管理人将积极通过持续营销优化持有人结构，审慎办理大额申购和赎回。

##### 2. 估值风险

投资者大额赎回所持有的基金份额时，基金份额净值可能受到尾差和部分赎回费归入基金资产的影响，从而导致非市场因素的净值异常波动。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于公司治理风险、流动性风险、退市风险、股价波动风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金招募说明书》
- 4、《富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金托管协议》
- 5、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站：[www.ftsfund.com](http://www.ftsfund.com)。

### 12.3 查阅方式

- 1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件。
- 2、登陆基金管理人网站 [www.ftsfund.com](http://www.ftsfund.com) 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

2019年8月28日