富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金
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

§1 重要提示及目录.....2

1.1 重要提示.....2

1.2 目录.....3

§2 基金简介.....6

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

§3 主要财务指标和基金净值表现.....9

3.1 主要会计数据和财务指标.....9

3.2 基金净值表现.....9

3.3 其他指标.....10

§4 管理人报告.....12

4.1 基金管理人及基金经理情况.....12

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....13

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....13

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.....14

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....14

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....15

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....15

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.....15

§5 托管人报告.....16

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....16

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.....16

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.....16

§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....17

6.1 资产负债表.....17

6.2 利润表.....18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....19
6.4 报表附注.....20
§7 投资组合报告.....42
7.1 期末基金资产组合情况.....42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....42
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.....44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....48
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.....48
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.....49
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.....49
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.....49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....49
7.12 投资组合报告附注.....50
§8 基金份额持有人信息.....51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....51
8.2 期末上市基金前十名持有人.....51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....52
§9 开放式基金份额变动.....54
§10 重大事件揭示.....55
10.1 基金份额持有人大会决议.....55
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.....55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....55
10.4 基金投资策略的改变.....55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....55
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.....55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....56
10.8 其他重大事件.....57

§11 影响投资者决策的其他重要信息.....60

11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....60

§12 备查文件目录.....61

12.1 备查文件目录.....61

12.2 存放地点.....61

12.3 查阅方式.....61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金		
基金简称	国富中证100指数增强分级		
基金主代码	164508		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年3月26日		
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	54,971,144.92份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	国富中证100指数增强分级A	国富中证100指数增强分级B	国富中证100指数增强分级
下属分级基金的交易代码	150135	150136	164508
报告期末下属分级基金份额总额	7,345,576.00份	7,345,577.00份	40,279,991.92份

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国海富兰克林基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	王永民
	联系电话	021-3855 5555	010-6659 4896
	电子邮箱	service@ftsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680和021－38789555	95566
传真		021-6888 3050	010-6659 4942
注册地址		广西南宁市西乡塘区总部路1号中国-东盟科技企业孵化基地一期A-13栋三层306号房	北京市西城区复兴门内大街1号
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	上海证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街27号投资广场23 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	3,259,148.61
本期利润	15,853,644.90
加权平均基金份额本期利润	0.2633
本期加权平均净值利润率	27.43%
本期基金份额净值增长率	30.98%
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	8,874,586.51
期末可供分配基金份额利润	0.1614
期末基金资产净值	57,920,787.91
期末基金份额净值	1.054
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	18.07%

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

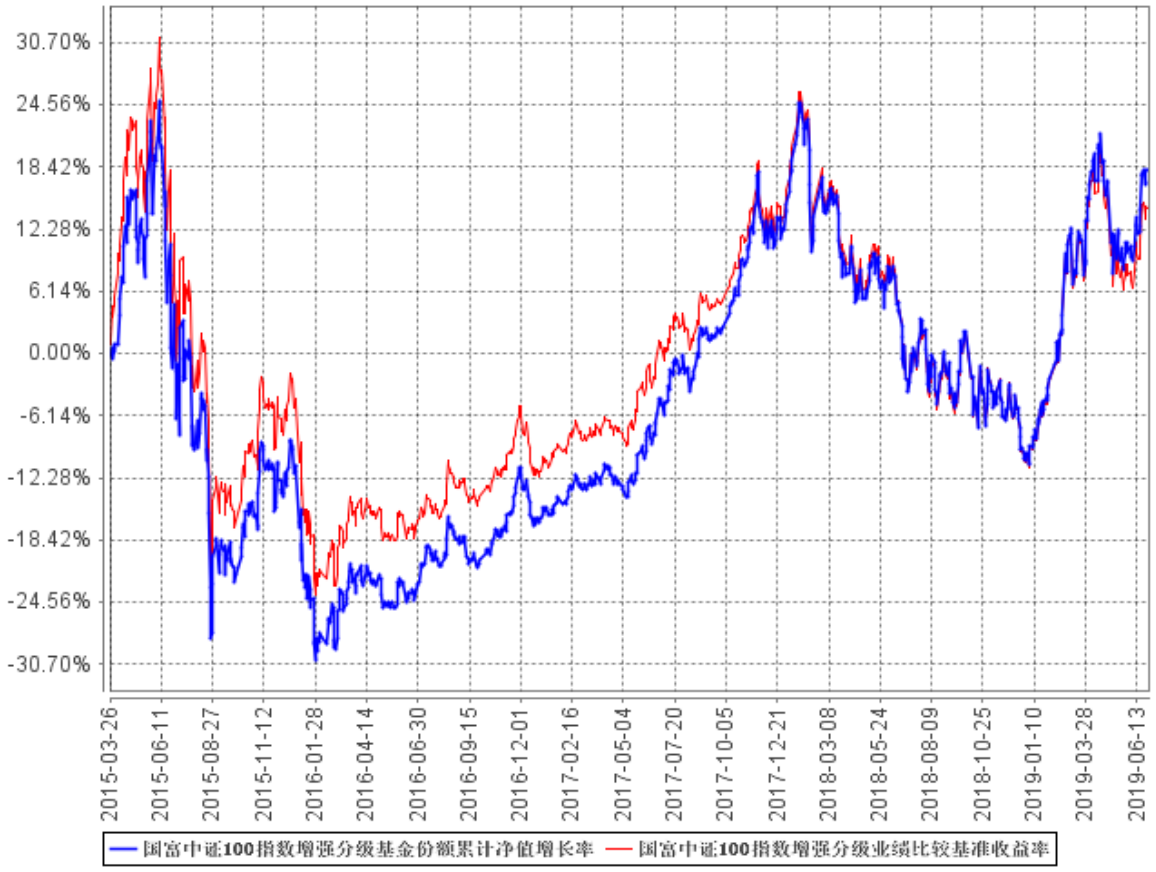
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.33%	1.10%	6.25%	1.12%	1.08%	-0.02%

过去三个月	4.46%	1.42%	1.83%	1.44%	2.63%	-0.02%
过去六个月	30.98%	1.45%	27.30%	1.47%	3.68%	-0.02%
过去一年	17.28%	1.43%	13.42%	1.45%	3.86%	-0.02%
过去三年	52.85%	1.07%	36.85%	1.07%	16.00%	0.00%
自基金合同生效起至今	18.07%	1.49%	14.38%	1.47%	3.69%	0.02%

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

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



注：本基金的基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（ 2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日 ）

中证 100A 与中证 100B 基金份额配比	1:1
期末中证 100A 份额参考净值	1.025
期末中证 100A 份额累计参考净值	1.220
期末中证 100B 份额参考净值	1.083
期末中证 100B 份额累计参考净值	1.083
中证 100A 的预计年收益率	5.00%

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

本公司具有丰富的管理基金经验。自2005年6月第一只基金成立开始，截至本报告期末，本公司旗下运作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		
张志强	公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、职工监事、国富沪深300指数增强基金及国富中证100指数增强分级基金的基金经理	2015年3月26日	-	16年	张志强先生，CFA，纽约州立大学（布法罗）计算机科学硕士，中国科学技术大学数学专业硕士。历任美国Enreach Technology Inc.软件工程师、海通证券股份有限公司研究所高级研究员、友邦华泰基金管理有限公司高级数量分析师、国海富兰克林基金管理有限公司首席数量分析师、风险控制部总经理、业务发展部总经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管

					理有限公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、职工监事、国富沪深300指数增强基金及国富中证100指数增强分级基金的基金经理。

注：

1. 表中“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，其中，首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。

2. 表中“证券从业年限”的计算标准为该名员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海中证 100 指数增强分级证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年，A股市场前涨后跌，全期间仍取得了较大幅度上涨，大盘蓝筹风格表现较好。所有行业均取得正收益，其中食品饮料、非银金融、农林牧渔、家用电器、计算机等行业涨幅居前，而建筑装饰、钢铁、传媒、纺织服装、汽车、公用事业等行业表现落后。上半年，中证 100 指数上涨了28.81%。

报告期内，本基金在保持均衡的组合配置以控制主动投资风险的前提下，继续使用量化选股模型精选个股及构建投资组合，取得了预期的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年6月30日，本基金份额净值为1.054元。本报告期，份额净值上涨30.98%，同期业绩比较基准上涨27.30%，基金表现超越业绩基准3.68%，期间基金年化跟踪误差为1.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国采购经理人 PMI 指数从去年底的 49.4%上升到一季度末的 50.5%，然后二季度末又回到49.4%，显示经济增长的下行压力比较大。展望下半年，内外需求疲弱、经济增长乏力的趋势预计将持续。相应地，财政政策和货币政策可能继续加码，尤其是美联储明确进入降息周期后，国内货币政策空间比较大，预计流动性将超出合理充裕的水平。政策方面，随着股指期货交易放松和科创板高效率推出，证券市场迎来了政策友好期。前期一些影响A股市场的其它重要因素对于市场的影响力在逐步下降。中美贸易摩擦方面，短期内亢奋悲观快速转换的阶段已经过去了，进入了持久战时期。信用事件仍然会不断发生，但市场反应更加平和。

对A股市场而言，后续起决定作用的将是经济基本面和上市公司盈利基本面的边际改善。在经济增长预期、上市公司盈利增长预期没有改善前，市场将在各种短期因素作用下，维持震荡状态。

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施分配的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在对富兰克林国海中证 100 指数增强分级证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金

报告截止日： 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
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,683,023.56	5,184,695.48
结算备付金		1,541.95	4,716.94
存出保证金		6,087.07	1,163.61
交易性金融资产	6.4.7.2	54,721,475.43	47,698,335.80
其中：股票投资		54,721,475.43	47,698,335.80
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	685.67	1,007.82
应收股利		-	-
应收申购款		73,906.47	8,684.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		58,486,720.15	52,898,603.73
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2019年6月30日**	**上年度末 2018年12月31日**
负 债：			
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		-	177,855.78
应付赎回款		296,366.96	6,732.73
应付管理人报酬		46,098.85	45,832.25
应付托管费		10,141.79	10,083.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	12,304.46	7,483.77

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	201,020.18	283,007.23
负债合计		565,932.24	530,994.88
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	49,046,201.40	58,088,752.41
未分配利润	6.4.7.10	8,874,586.51	-5,721,143.56
所有者权益合计		57,920,787.91	52,367,608.85
负债和所有者权益总计		58,486,720.15	52,898,603.73

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额总额54,971,144.92份。其中国富中证100指数增强分级的份额总额为40,279,991.92份，基金份额净值1.054元；国富中证 100 指数增强分级 A 份额总额为7,345,576.00份，基金份额参考净值1.025元；国富中证100指数增强分级B份额总额为7,345,577.00份，基金份额参考净值1.083元。

6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金

本报告期：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
一、收入		16,454,213.88	-4,854,623.60
1.利息收入		14,079.14	17,430.88
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,050.32	17,430.88
债券利息收入		28.82	-
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）		3,832,675.97	6,985,595.78
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,138,068.95	6,285,102.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	20,731.89	-
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	673,875.13	700,493.13
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.16	12,594,496.29	-11,904,466.23

“-”号填列）			
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	12,962.48	46,815.97
减：二、费用		600,568.98	762,600.05
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	286,204.50	349,062.99
2．托管费	6.4.10.2.2	62,964.99	76,793.81
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.18	49,457.02	89,349.19
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	6.4.7.19	201,942.47	247,394.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,853,644.90	-5,617,223.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,853,644.90	-5,617,223.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金

本报告期：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）	58,088,752.41	-5,721,143.56	52,367,608.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,853,644.90	15,853,644.90
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）	-9,042,551.01	-1,257,914.83	-10,300,465.84
其中：1.基金申购款	3,824,775.06	377,403.79	4,202,178.85
2.基金赎回款	-12,867,326.07	-1,635,318.62	-14,502,644.69
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）	49,046,201.40	8,874,586.51	57,920,787.91
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）	77,713,814.32	9,568,315.63	87,282,129.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,617,223.65	-5,617,223.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-19,909,959.96	-3,510,917.62	-23,420,877.58
其中：1.基金申购款	16,144,756.48	2,706,928.27	18,851,684.75
2.基金赎回款	-36,054,716.44	-6,217,845.89	-42,272,562.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	57,803,854.36	440,174.36	58,244,028.72

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

富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金(以下简称“本基金”)，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]第426号《关于核准富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金募集的批复》核准，由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息

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

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

合同生效后，国富中证100份额可办理场外与场内申购和赎回，但不上市交易；国富中证100 A份额、国富中证100 B份额只上市交易，不可单独申购和赎回。本基金的分级运作期为五年(含五年)，分级运作期满后，满足基金合同约定的存续条件，本基金无需召开基金份额持有人大会，国富中证100 A 份额和国富中证100 B份额以各自的份额净值为基础，按照国富中证100份额的份额净值自动转换为上市开放式基金(LOF)，基金名称为“富兰克林国海中证100指数增强型证券投资基金(LOF)”。本基金转为上市开放式基金(LOF)后，投资者可通过场内、场外进行基金份额

的申购、赎回。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金作为指数型基金，采用被动复制策略，跟踪标的指数市场表现，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如果法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产净值的比例为90%-95%，其中投资于股票资产的比例不低于基金资产净值的90%，投资于中证100指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产净值的80%；债券、现金以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为5%-10%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金投资组合的业绩比较基准为中证100指数收益率

×95%+银行同业存款利率×5%。

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金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日期间的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	3,683,023.56
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	3,683,023.56

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		44,004,530.33	54,721,475.43	10,716,945.10
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		44,004,530.33	54,721,475.43	10,716,945.10

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	682.61
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	0.63
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.43
合计	685.67

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	12,304.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,304.46

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	1,003.75
审计费	31,240.60
信息披露费	39,023.05
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
合计	201,020.18

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	63,120,790.96	58,088,752.41
本期申购	18,322.45	16,866.05
本期赎回(以"-"号填列)	-282.62	-260.15
2019年1月2日基金拆分/份额折算前	63,138,830.79	58,105,358.31
基金拆分/份额折算变动份额	1,985,495.93	0
本期申购	4,267,504.20	3,807,909.01
本期赎回(以"-"号填列)	-14,420,686.00	-12,867,065.92
本期末	54,971,144.92	49,046,201.40

注：

1. 本基金在2019年度共发生以下1次折算：

根据《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》的相关规定和国海富兰克林基金管理有限公司2019年1月4日发布的《关于富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金的管理人国海富兰克林基金管理有限公司以2019年1月2日为定期折算基准日，对本基金进行定期份额折算。折算前，国富中证100份额场外份额和场内份额分别为43,666,868.79份和1,381,169.00份，份额净值为0.820元，根据份额折算公式，新增份额折算比例为0.031446540，折算后国富中证100份额场外份额和场内份额分别为45,040,040.72份和1,993,493.00份，份额净值为0.795元。折算前，国富中证100A份额总额为9,045,396.00份，份额净值为1.050元，根据份额折算公式，新增份额折算比例为0.062893081，折算后国富中证100A份额总额为9,045,396.00份，份额净值为1.000元，新增份额均为国富中证100份额之场内份额。

2. 截至2019年6月30日止，本基金于深交所上市的国富中证100 A份额为7,345,576.00份、国富中证100 B份额为7,345,577.00份，托管在场内未上市交易的国富中证100份额1,341,914.00份，托管在场外未上市交易的国富中证100份额为38,938,077.92份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。国富中证100份额与国富中证100A份额、国富中证100B份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。

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	10,702,170.74	-16,423,314.30	-5,721,143.56
本期利润	3,259,148.61	12,594,496.29	15,853,644.90
本期基金份额交易产生的变动数	-1,801,663.20	543,748.37	-1,257,914.83
其中：基金申购款	790,919.45	-413,515.66	377,403.79
基金赎回款	-2,592,582.65	957,264.03	-1,635,318.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,159,656.15	-3,285,069.64	8,874,586.51

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	13,946.99
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	78.40
其他	24.93
合计	14,050.32

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	19,509,937.69
减：卖出股票成本总额	16,371,868.74
买卖股票差价收入	3,138,068.95

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	20,731.89
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	20,731.89

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	112,060.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	91,300.00
减：应收利息总额	28.82
买卖债券差价收入	20,731.89

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	673,875.13

基金投资产生的股利收益	-
合计	673,875.13

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	12,594,496.29
——股票投资	12,594,496.29
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	12,594,496.29

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	12,962.48
合计	12,962.48

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的0.5%，赎回费总额的25%归入基金资产。

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	49,457.02
银行间市场交易费用	-
合计	49,457.02

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	31,240.60
信息披露费	39,023.05
银行汇划费用	1,926.04
指数使用费	100,000.00
上市费	29,752.78
合计	201,942.47

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02%的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币50,000.00元。

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。

6.4.9.3 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.9.4 关联方报酬

6.4.9.4.1 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	286,204.50	349,062.99
其中：支付销售机构的客户维护费	85,062.98	92,996.95

注：

1.支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.00% / 当年天数。

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

6.4.9.4.2 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	62,964.99	76,793.81

注：

1.支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.22% / 当年天数。

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

6.4.9.5 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.9.6 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.6.1 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。

6.4.9.6.2 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。

6.4.9.7 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	3,683,023.56	13,946.99	4,389,355.54	17,015.88

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。

6.4.9.8 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。

6.4.9.9 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。

6.4.10 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配情况。

6.4.11 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌的股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票指数增强型基金，属于高风险品种。本基金投资范围限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、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他证券品种，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动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。本基金采用指数增强投资策略。通过量化风险管理方法，控制基金投资组合与标的指数构成的偏差，同时结合主动投资方法，在严格控制跟踪偏离风险的基础上，力争获得超越业绩比较基准标的投资收益，追求基金资产的长期增值。

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。

6.4.12.2 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,本基金无债券投资(2018年12月31日：同)。

6.4.12.3 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。

6.4.12.3.1 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时间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公司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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 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	3,683,023.56	-	-	-	3,683,023.56
结算备付金	1,541.95	-	-	-	1,541.95
存出保证金	6,087.07	-	-	-	6,087.07
交易性金融资产	-	-	-	54,721,475.43	54,721,475.43
应收利息	-	-	-	685.67	685.67
应收申购款	-	-	-	73,906.47	73,906.47
资产总计	3,690,652.58	-	-	54,796,067.57	58,486,720.15
负债					

应付赎回款	-	-	-	296,366.96	296,366.96
应付管理人报酬	-	-	-	46,098.85	46,098.85
应付托管费	-	-	-	10,141.79	10,141.79
应付交易费用	-	-	-	12,304.46	12,304.46
其他负债	-	-	-	201,020.18	201,020.18
负债总计	-	-	-	565,932.24	565,932.24
利率敏感度缺口	3,690,652.58	-	-	54,230,135.33	57,920,787.91
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	5,184,695.48	-	-	-	5,184,695.48
结算备付金	4,716.94	-	-	-	4,716.94
存出保证金	1,163.61	-	-	-	1,163.61
交易性金融资产	-	-	-	47,698,335.80	47,698,335.80
应收利息	-	-	-	1,007.82	1,007.82
应收申购款	-	-	-	8,684.08	8,684.08
资产总计	5,190,576.03	-	-	47,708,027.70	52,898,603.73
负债					
应付证券清算款	-	-	-	177,855.78	177,855.78
应付赎回款	-	-	-	6,732.73	6,732.73
应付管理人报酬	-	-	-	45,832.25	45,832.25
应付托管费	-	-	-	10,083.12	10,083.12
应付交易费用	-	-	-	7,483.77	7,483.77
其他负债	-	-	-	283,007.23	283,007.23
负债总计	-	-	-	530,994.88	530,994.88
利率敏感度缺口	5,190,576.03	-	-	47,177,032.82	52,367,608.85

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。

6.4.12.4.1.2 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)。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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或银行间同业市场

交易的股票和债券，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。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产净值的比例为 90%-95%，其中投资于股票资产的比例不低于基金资产净值的 90%，投资于中证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产净值的 80%；债券、现金以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-10%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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。

6.4.12.4.3.1 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	54,721,475.43	94.48	47,698,335.80	91.08
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	54,721,475.43	94.48	47,698,335.80	91.08

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)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(附注6.4.1)上升5%	增加约2818	增加约259
	2.业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	减少约2818	减少约259

6.4.13 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

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54,687,605.49元，第二层次的余额为33,869.94元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次46,441,550.80元，第二层次：1,256,785.00元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

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	54,721,475.43	93.56
	其中：股票	54,721,475.43	93.56
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	3,684,565.51	6.30
8	其他各项资产	80,679.21	0.14
9	合计	58,486,720.15	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,802,591.00	3.11
C	制造业	18,433,966.49	31.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,299,961.76	2.24
E	建筑业	1,856,490.00	3.21
F	批发和零售业	443,946.28	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	1,467,545.00	2.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	854,715.20	1.48
J	金融业	24,244,457.23	41.86
K	房地产业	2,536,958.88	4.38
L	租赁和商务服务业	767,603.32	1.33

M	科学研究和技术服务业	121,352.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	53,829,587.16	92.94

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	35,361.55	0.06
C	制造业	276,772.70	0.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,084.08	0.04
J	金融业	554,669.94	0.96
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	891,888.27	1.54

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未通过港股通交易机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	64,500	5,715,345.00	9.87
2	600519	贵州茅台	3,277	3,224,568.00	5.57
3	600036	招商银行	67,400	2,425,052.00	4.19
4	000651	格力电器	35,700	1,963,500.00	3.39
5	600887	伊利股份	47,062	1,572,341.42	2.71
6	000858	五 粮 液	12,821	1,512,236.95	2.61
7	000333	美的集团	28,700	1,488,382.00	2.57
8	601166	兴业银行	73,600	1,346,144.00	2.32
9	600030	中信证券	55,600	1,323,836.00	2.29
10	600276	恒瑞医药	19,557	1,290,762.00	2.23
11	601398	工商银行	184,200	1,084,938.00	1.87
12	600000	浦发银行	91,730	1,071,406.40	1.85
13	000002	万　科A	36,700	1,020,627.00	1.76
14	601288	农业银行	282,300	1,016,280.00	1.75
15	601328	交通银行	162,200	992,664.00	1.71
16	601601	中国太保	26,300	960,213.00	1.66
17	601668	中国建筑	159,440	916,780.00	1.58
18	600900	长江电力	47,400	848,460.00	1.46
19	600837	海通证券	55,901	793,235.19	1.37
20	600016	民生银行	122,660	778,891.00	1.34
21	000001	平安银行	54,512	751,175.36	1.30
22	002415	海康威视	20,925	577,111.50	1.00
23	601211	国泰君安	30,800	565,180.00	0.98
24	600104	上汽集团	22,071	562,810.50	0.97
25	002304	洋河股份	4,613	560,756.28	0.97
26	601169	北京银行	89,300	527,763.00	0.91
27	600585	海螺水泥	12,600	522,900.00	0.90
28	603288	海天味业	4,900	514,500.00	0.89
29	601888	中国国旅	5,800	514,170.00	0.89
30	600309	万华化学	11,900	509,201.00	0.88
31	601628	中国人寿	17,600	498,432.00	0.86
32	600048	保利地产	37,463	478,027.88	0.83

33	000063	中兴通讯	14,600	474,938.00	0.82
34	600340	华夏幸福	14,500	472,265.00	0.82
35	600028	中国石化	83,800	458,386.00	0.79
36	600019	宝钢股份	70,500	458,250.00	0.79
37	601088	中国神华	22,200	452,436.00	0.78
38	601229	上海银行	37,520	444,612.00	0.77
39	601688	华泰证券	19,800	441,936.00	0.76
40	000725	京东方A	124,200	427,248.00	0.74
41	600009	上海机场	5,000	418,900.00	0.72
42	300059	东方财富	29,544	400,321.20	0.69
43	601766	中国中车	48,680	393,821.20	0.68
44	600050	中国联通	63,700	392,392.00	0.68
45	002594	比亚迪	7,500	380,400.00	0.66
46	600919	江苏银行	52,000	377,520.00	0.65
47	601818	光大银行	95,800	364,998.00	0.63
48	601009	南京银行	41,720	344,607.20	0.59
49	601989	中国重工	61,800	343,608.00	0.59
50	601857	中国石油	49,800	342,624.00	0.59
51	002142	宁波银行	13,630	330,391.20	0.57
52	600999	招商证券	19,000	324,710.00	0.56
53	601186	中国铁建	32,600	324,370.00	0.56
54	601006	大秦铁路	39,600	320,364.00	0.55
55	000568	泸州老窖	3,900	315,237.00	0.54
56	000776	广发证券	21,900	300,906.00	0.52
57	002024	苏宁易购	24,886	285,691.28	0.49
58	601998	中信银行	47,600	284,172.00	0.49
59	601899	紫金矿业	74,900	282,373.00	0.49
60	600690	海尔智家	16,088	278,161.52	0.48
61	001979	招商蛇口	13,200	275,880.00	0.48
62	000166	申万宏源	54,500	273,045.00	0.47
63	600015	华夏银行	35,040	269,808.00	0.47
64	601390	中国中铁	39,400	256,888.00	0.44
65	002027	分众传媒	47,908	253,433.32	0.44
66	601336	新华保险	4,300	236,629.00	0.41
67	000538	云南白药	2,706	225,734.52	0.39
68	600703	三安光电	19,900	224,472.00	0.39
69	002352	顺丰控股	5,600	190,176.00	0.33
70	601138	工业富联	15,700	189,185.00	0.33
71	601111	中国国航	18,400	176,088.00	0.30

72	603993	洛阳钼业	43,100	170,676.00	0.29
73	002736	国信证券	12,668	166,710.88	0.29
74	600115	东方航空	26,000	163,020.00	0.28
75	600958	东方证券	14,900	159,132.00	0.27
76	601933	永辉超市	15,500	158,255.00	0.27
77	000069	华侨城A	21,800	151,510.00	0.26
78	600606	绿地控股	20,300	138,649.00	0.24
79	601800	中国交建	12,200	138,104.00	0.24
80	601727	上海电气	24,800	133,424.00	0.23
81	600025	华能水电	31,000	126,170.00	0.22
82	600018	上港集团	18,300	124,806.00	0.22
83	600011	华能国际	19,800	123,354.00	0.21
84	603259	药明康德	1,400	121,352.00	0.21
85	600010	包钢股份	69,640	117,691.60	0.20
86	000895	双汇发展	4,700	116,983.00	0.20
87	601669	中国电建	22,000	116,380.00	0.20
88	601618	中国中冶	34,200	103,968.00	0.18
89	600023	浙能电力	22,928	101,341.76	0.17
90	601985	中国核电	18,100	100,636.00	0.17
91	601225	陕西煤业	10,400	96,096.00	0.17
92	601881	中国银河	6,100	74,725.00	0.13
93	601018	宁波港	16,900	74,191.00	0.13
94	601360	三六零	2,900	62,002.00	0.11
95	601238	广汽集团	5,100	55,743.00	0.10

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601939	建设银行	70,000	520,800.00	0.90
2	000157	中联重科	30,000	180,300.00	0.31
3	300782	卓胜微	347	37,795.24	0.07
4	600968	海油发展	9,961	35,361.55	0.06
5	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.06
6	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.05
7	601698	中国卫通	6,399	25,084.08	0.04
8	300594	朗进科技	487	21,481.57	0.04
9	603863	松炀资源	443	10,224.44	0.02

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	698,205.99	1.33
2	600519	贵州茅台	532,924.00	1.02
3	601939	建设银行	503,633.00	0.96
4	600887	伊利股份	441,243.00	0.84
5	601800	中国交建	370,826.00	0.71
6	000651	格力电器	350,404.00	0.67
7	601398	工商银行	344,475.00	0.66
8	601288	农业银行	277,975.00	0.53
9	000157	中联重科	264,639.00	0.51
10	601628	中国人寿	261,770.00	0.50
11	600340	华夏幸福	253,685.00	0.48
12	603288	海天味业	241,269.00	0.46
13	600837	海通证券	239,454.00	0.46
14	600989	宝丰能源	230,217.36	0.44
15	601390	中国中铁	217,732.00	0.42
16	600377	宁沪高速	216,260.00	0.41
17	601166	兴业银行	211,770.00	0.40
18	000002	万　科Ａ	206,054.00	0.39
19	603259	药明康德	199,527.00	0.38
20	601857	中国石油	199,312.00	0.38

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,340,890.00	2.56
2	000651	格力电器	1,252,176.00	2.39
3	601166	兴业银行	723,141.00	1.38

4	000858	五 粮 液	600,123.32	1.15
5	600016	民生银行	562,708.00	1.07
6	000002	万　科Ａ	542,927.90	1.04
7	600519	贵州茅台	513,813.00	0.98
8	600036	招商银行	470,928.00	0.90
9	600030	中信证券	453,012.00	0.87
10	601328	交通银行	399,750.00	0.76
11	000895	双汇发展	370,520.00	0.71
12	601800	中国交建	368,222.00	0.70
13	600048	保利地产	356,756.00	0.68
14	000333	美的集团	355,861.70	0.68
15	600989	宝丰能源	352,517.70	0.67
16	601288	农业银行	332,400.00	0.63
17	600795	国电电力	302,148.40	0.58
18	603288	海天味业	282,983.58	0.54
19	000001	平安银行	281,200.00	0.54
20	601866	中远海发	256,700.00	0.49

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	10,800,512.08
卖出股票收入（成交）总额	19,509,937.69

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

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	6,087.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	685.67
5	应收申购款	73,906.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	80,679.21

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.06	新股未上市

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国富中证100指数增强分级A	63	116,596.44	1,979,797.00	26.95%	5,365,779.00	73.05%
国富中证100指数增强分级B	282	26,048.15	-	-	7,345,577.00	100.00%
国富中证100指数增强分级	2,313	17,414.61	754,565.46	1.87%	39,525,426.46	98.13%
合计	2,658	20,681.39	2,734,362.46	4.97%	52,236,782.46	95.03%

8.2 期末上市基金前十名持有人

国富中证100指数增强分级A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	梁小红	3,297,110.00	44.89%
2	泰康人寿保险有限责任公司-分红-个人分红-019L-FH002深	1,574,860.00	21.44%
3	黄德俊	520,000.00	7.08%
4	梁志云	325,878.00	4.44%
5	中国太平洋财产保险-传统-普通保险产品-013C-CT001深	166,700.00	2.27%
6	方春娣	150,000.00	2.04%
7	中国石油天然气集团公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	127,937.00	1.74%
8	邬杰	118,463.00	1.61%
9	赖明理	112,100.00	1.53%
10	中国太保集团股份有限公司-本级-	110,300.00	1.50%

	集团自有资金-012G-ZY001深		

国富中证100指数增强分级B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	项燕	1,595,217.00	21.72%
2	张玲	504,300.00	6.87%
3	梁志云	482,278.00	6.57%
4	曾庆梅	333,400.00	4.54%
5	林少逸	321,406.00	4.38%
6	肖华	257,000.00	3.50%
7	邓义勇	170,000.00	2.31%
8	莫家秀	140,000.00	1.91%
9	王侃	120,000.00	1.63%
10	张茜	117,546.00	1.60%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	国富中证100指数增强分级A	-	-
	国富中证100指数增强分级B	-	-
	国富中证100指数增强分级	545.15	0.001353%
	合计	545.15	0.000992%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

	强分级	
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富中证100指数增强分级A	国富中证100指数增强分级B	国富中证100指数增强分级
基金合同生效日（2015年3月26日）基金份额总额	117,906,583.00	117,906,584.00	439,642,401.42
本报告期期初基金份额总额	9,045,396.00	9,045,397.00	45,029,997.96
本报告期期间基金总申购份额	-	-	4,285,826.65
减:本报告期期间基金总赎回份额	-	-	14,420,968.62
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列）	-1,699,820.00	-1,699,820.00	5,385,135.93
本报告期期末基金份额总额	7,345,576.00	7,345,577.00	40,279,991.92

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及定期折算份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（一）基金管理人重大人事变动

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

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	
中信证券	1	18,367,670.32	62.57%	17,105.66	62.57%	-
东方证券	2	3,387,208.32	11.54%	3,154.52	11.54%	-
华创证券	1	3,099,331.21	10.56%	2,886.47	10.56%	-
兴业证券	1	2,743,270.00	9.35%	2,554.80	9.35%	-
光大证券	2	1,444,127.70	4.92%	1,344.89	4.92%	-
瑞银证券	1	183,818.27	0.63%	171.19	0.63%	-
海通证券	2	129,747.20	0.44%	120.84	0.44%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	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，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
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	112,060.71	100.00%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

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	关于富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间国富中证100 A份额停复牌的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年1月3日
2	关于富兰克林国海中证100指数增	中国证监会指定报	2019年1月4日

	强型分级证券投资基金国富中证100 A份额办理定期份额折算次日前收盘价调整的公告	刊及公司网站	
3	关于富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金 定期份额折算结果及恢复交易的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年1月4日
4	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金 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
5	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金暂停大额申购以及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年3月1日
6	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
7	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金 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
8	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金 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
9	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
10	关于增加北京百度百盈基金销售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4月17日
11	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金 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
12	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金 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10日
13	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金 更新招募说明书（2019年第1号）	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年5月10日
14	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	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年5月10日

	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		
15	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
16	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
17	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
18	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投资及相关风险揭示的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019年6月21日
19	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 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中证100指数增强型分级证券投资基金设立的文件；

2、《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》；

3、《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金招募说明书》；

4、《富兰克林国海中证100指数增强型分级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。

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 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

2019年8月28日