

富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金
2020 年中期报告

2020 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 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。本中期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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 年 2 月 13 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.....	7
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
§4 管理人报告	11
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.....	13
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.....	14
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
§5 托管人报告	15
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
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
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
§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.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	59

§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金
基金简称	国富基本面优选混合
基金主代码	008515
交易代码	008515
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 2 月 13 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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,936,302,368.00 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过基本面指标精选质地优良的公司，在严控组合风险及考虑流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	<p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>本基金通过基本面指标精选质地优良的公司，在严控组合风险及考虑流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>本基金对内地股票及港股通标的股票，选用长期有效且稳定的基本面选股指标对个股进行筛选，再进一步研究分析加以精选，以选择质地优良、盈利能力突出、增长稳定持续的个股构建投资组合，并合理控制组合的风险暴露，在控制风险的同时最大程度获得收益。本基金利用风险管理工具合理控制组合的风险暴露，以求在获得最大收益的同时控制组合的收益波动。本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</p> <p>(三) 债券投资策略</p> <p>本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。</p> <p>(四) 金融衍生品投资策略</p> <p>1、股指期货投资策略</p>

	<p>本基金以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。</p> <p>2、国债期货投资策略</p> <p>本基金在进行国债期货投资时，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，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债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国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率× 50% +恒生指数收益率 ×20% +中债综合指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中风险收益特征的证券投资基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国海富兰克林基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	张燕
	联系电话	021-3855 5555	0755-8319 9084
	电子邮箱	service@ftsfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555	95555
传真		021-6888 3050	0755-8319 5201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		吴显玲	李建红

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
----------------	-------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金中期报告备置地点	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 号上海国金中心二期 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(2020年2月13日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	19,662,745.59
本期利润	420,865,059.83
加权平均基金份额本期利润	0.1113
本期加权平均净值利润率	11.23%
本期基金份额净值增长率	12.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	23,833,553.50
期末可供分配基金份额利润	0.0081
期末基金资产净值	3,301,790,855.54
期末基金份额净值	1.1245
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	12.45%

注：

1. 本基金合同生效日为 2020 年 2 月 13 日。本基金 2020 年度主要财务指标的计算期间为 2020 年 2 月 13 日-2020 年 6 月 30 日。
2. 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》。
3. 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。
4. 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）。
5. 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

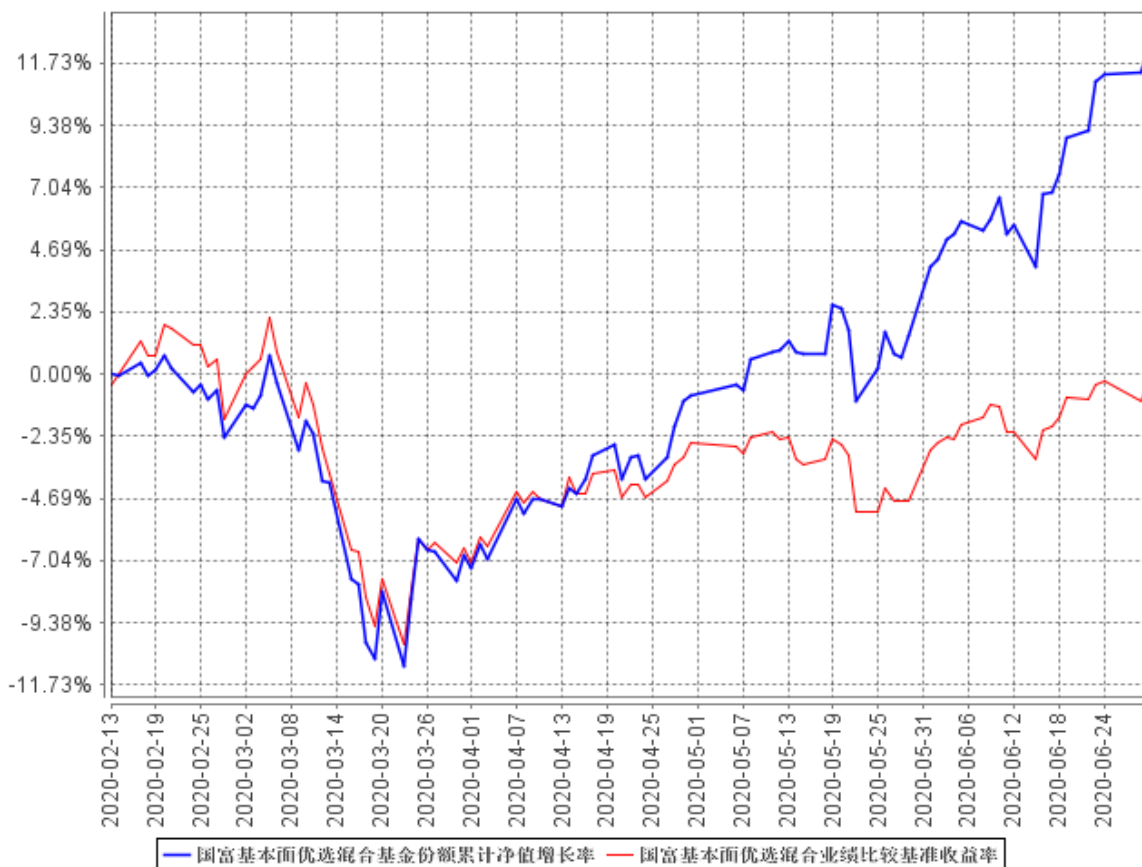
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	10.86%	1.02%	4.80%	0.70%	6.06%	0.32%

过去三个月	20.68%	0.96%	6.80%	0.71%	13.88%	0.25%
自基金合同生效起至今	12.45%	1.21%	-0.21%	1.01%	12.66%	0.20%

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

国富基本面优选混合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 2020 年 2 月 13 日。本基金建仓期为 6 个月，截至报告期末基金尚未完成建仓。

§ 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，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。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，在全球市场具备超过 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。

国海富兰克林基金管理有限公司具有丰富的基金管理经验，截至 2020 年二季度末，公司旗下合计管理 34 只公募基金产品。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵晓东	公司权益投资总监、职工监事，国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金、国富弹性市值混合基金、国富恒瑞债券基金及国富基本面优选	2020 年 2 月 13 日	-	17 年	赵晓东先生，香港大学 MBA。历任淄博矿业集团项目经理，浙江证券分析师，上海交大高新技术股份有限公司高级投资经理，国海证券有限责任公司行业研究员，国海富兰克林基金管理有限公司研究员、高级研究员、国富弹性市值混合基金及国富潜力组合混合基金的基金经理助理、国富沪深 300 指数增强基金的基金经理、国海富兰克林基金管理有限公司 QDII 投资总监。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司权益投资总监、职工监事，国富中小盘股票基金、国富焦

	混合基金的基金经理				点驱动混合基金、国富弹性市值混合基金、国富恒瑞债券基金及国富基本面优选混合基金的基金经理。
--	-----------	--	--	--	---

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《富兰克林国海基本面优选混合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

2020 年上半年，受到新冠疫情影响国内经济出现了一定的下滑，国内消费和投资都在一季度受到严重影响，虽然疫情在一季度末逐渐得到控制，但二季度增速同比依然较低。进出口数据略超市场预期，尤其是疫情物资出口数据表现较好；国内贷款降息、减税降费政策持续落地，财政政策持续发力，使得中小企业在疫情下的生存环境大大改善；国内资本市场流动性宽裕，信贷，地方专项债等融资稳健增长，强有力支撑了经济的健康增长；

证券市场投资者的风险偏好开始提升，业绩稳定且增长确定性强的行业成为市场的热点，科技，医药健康，大众消费，新能源等行业大幅跑赢市场，银行，地产和周期等低估值蓝筹走弱市场。上半年沪深 300 指数，中证 500 指数和创业板指数分别上涨 1.64%，11.33%和 35.60%，中小创股走势明显好于大盘指数。

自二季度开始，本基金总体维持了较高的权益仓位，港股权益仓位占权益部分近一半；行业配置较为均衡，科技，金融，消费等配置相对较多，投资上进一步加强自下而上的选股。

在投资策略上，我们始终坚持基本面投资的方向，坚持“安全边际”选股，在控制风险的前提下，重点持有和关注，公司治理好、管理团队优秀、业务成长空间大、议价能力强、估值合理的公司。同时提高组合的均衡和分散程度，致力于在长期中带来超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.1245 元，本基金于 2020 年 2 月 13 日成立，自成立以来份额净值上涨 12.45%，同期业绩比较基准下跌 0.21%，跑赢业绩比较基准 12.66%。由于本基金行业配置的消费，科技较多且权益仓位较高，是报告期内跑赢业绩基准的主要原因。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计国内经济相对今年上半年经济将快速恢复到正增长的区间。虽然，下半年国际政治经济形势复杂多变，新冠疫情依然严峻而且存在反复的可能，但国内在疫情已经严密控制住，消费和投资在国家一系列财政和货币政策的刺激下，经济前景越来越乐观，趋势越来越明朗。预计下半年，国内货币政策依然保持相对宽裕状态，会进一步降低企业融资成本，为资本市场提供宽裕的流动性。

环览全球经济，在大的经济体中唯有中国已经出现明显的企稳恢复增长的态势，资金流入资本市场步伐仍将持续，虽然市场可能出现波动，但从中长期投资的角度看，中国的资本市场依然

具有很强的吸引力。

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《投资产品估值管理办法》。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，根据基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未分配的利润。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	412,531,150.44
结算备付金		1,559,469.73
存出保证金		602,107.65
交易性金融资产	6.4.7.2	2,880,396,794.61
其中：股票投资		2,843,724,683.61
基金投资		-
债券投资		36,672,111.00
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		87,186,602.67
应收利息	6.4.7.5	91,342.14
应收股利		8,540,113.37
应收申购款		2,701,462.96
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		3,393,609,043.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 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		288.47
应付赎回款		85,101,531.98
应付管理人报酬		4,328,731.51
应付托管费		721,455.25
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	1,354,097.68
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	312,083.14
负债合计		91,818,188.03
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	2,936,302,368.00
未分配利润	6.4.7.10	365,488,487.54
所有者权益合计		3,301,790,855.54
负债和所有者权益总计		3,393,609,043.57

注：

1. 报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1245 元，基金份额总额 2,936,302,368.00 份。
2. 本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 06 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 2 月 13 日(基金合同生 效日)至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		453,349,408.61
1.利息收入		5,251,644.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,904,713.41
债券利息收入		18,466.64
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,328,464.80
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		44,238,103.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	18,883,489.79
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	25,354,613.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	401,202,314.24
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	2,657,346.18
减：二、费用		32,484,348.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	21,144,725.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,524,120.89
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	7,695,081.73
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	120,420.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		420,865,059.83
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		420,865,059.83

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金

本报告期：2020年2月13日(基金合同生效日)至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年2月13日(基金合同生效日)至2020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)	3,914,634,665.57	-	3,914,634,665.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	420,865,059.83	420,865,059.83
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)	-978,332,297.57	-55,376,572.29	-1,033,708,869.86
其中：1.基金申购款	25,767,992.39	1,154,017.45	26,922,009.84
2.基金赎回款	-1,004,100,289.96	-56,530,589.74	-1,060,630,879.70
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)	2,936,302,368.00	365,488,487.54	3,301,790,855.54

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金(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[2019]1995号《关于准予富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金注册的批复》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《富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,914,507,978.22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(2020)第0091号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金基金合同》于2020年2月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,914,634,665.57份,其中认购资金利息折合126,687.35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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为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(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他经中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票投资比例为基金资产的60%-95%,港股通标的股票最高投资比例不得超过股票资产的50%,每个交易日日终在扣除股指期货和国债期

货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×30%。

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 2020 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<年度报告和中期报告>》、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》、《富兰克林国海基本面优选混合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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 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

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2020 年 2 月 13 日(基金合同生效日)日至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部

分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动

性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2020年6月30日
活期存款	412,531,150.44
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	412,531,150.44

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,440,111,898.82	2,843,724,683.61	403,612,784.79	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	39,082,581.55	36,672,111.00	-2,410,470.55
	银行间市场	-	-	-
	合计	39,082,581.55	36,672,111.00	-2,410,470.55
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,479,194,480.37	2,880,396,794.61	401,202,314.24	

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	40,271.32
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	11,315.11
应收债券利息	38,827.29
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	928.42
合计	91,342.14

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,351,514.29
银行间市场应付交易费用	2,583.39
合计	1,354,097.68

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	213,403.46
审计费用	43,034.40
信息披露费	46,645.28
债券账户维护费	9,000.00
合计	312,083.14

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年2月13日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	3,914,634,665.57	3,914,634,665.57
本期申购	25,767,992.39	25,767,992.39
本期赎回(以“-”号填列)	-1,004,100,289.96	-1,004,100,289.96
本期末	2,936,302,368.00	2,936,302,368.00

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	19,662,745.59	401,202,314.24	420,865,059.83
本期基金份额交易产生的变动数	4,170,807.91	-59,547,380.20	-55,376,572.29
其中：基金申购款	-145,375.20	1,299,392.65	1,154,017.45
基金赎回款	4,316,183.11	-60,846,772.85	-56,530,589.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,833,553.50	341,654,934.04	365,488,487.54

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年2月13日(基金合同生效日)至2020年6月30日
	活期存款利息收入
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	176,890.63
其他	21,557.66
合计	1,904,713.41

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年2月13日(基金合同生效日)至2020 年6月30日
卖出股票成交总额	1,293,696,294.94
减：卖出股票成本总额	1,274,812,805.15
买卖股票差价收入	18,883,489.79

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 2020年2月13日(基金合同生效日)至2020年6 月30日
股票投资产生的股利收益	25,354,613.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,354,613.55

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年2月13日(基金合同生效日)至2020 年6月30日
1. 交易性金融资产	401,202,314.24
——股票投资	403,612,784.79
——债券投资	-2,410,470.55
——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	401, 202, 314. 24

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2, 655, 163. 24
基金转换费收入	2, 182. 94
合计	2, 657, 346. 18

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 2020 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	7, 695, 081. 73
银行间市场交易费用	-
合计	7, 695, 081. 73

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	43, 034. 40
信息披露费	46, 645. 28
债券账户维护费	9, 000. 00

银行汇划费用	21,341.18
其他手续费	400.00
合计	120,420.86

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

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国海证券股份有限公司（“国海证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
邓普顿国际股份有限公司 (Templeton International, Inc.)	基金管理人的股东
国海富兰克林资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年2月13日(基金合同生效日) 至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
国海证券	2,691,608,022.89	53.81%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年2月13日(基金合同生效日)至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国海证券	2,344,401.93	55.88%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。
3. 本公司通过国海证券的交易席位买卖证券的交易佣金不超过本报告期内本公司所有基金买卖证券交易佣金的 30%。

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 2020年2月13日(基金合同生效日)至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	21,144,725.30
其中：支付销售机构的客户维护费	14,375,439.53	-

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 1.50% 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 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年2月13日(基金合同生效 日)至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,524,120.89	-

注：支付基金托管人招商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自有资金投资本基金的情况

1. 基金管理人运用自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. 本基金基金合同生效日为 2020 年 2 月 13 日，本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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. 本基金基金合同生效日为 2020 年 2 月 13 日，本报告期末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 2020年2月13日(基金合同生效日) 至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
招行银行	412,531,150.44	1,706,265.12	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020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

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
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020年6月24日	2020年7月7日	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-

688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688312	燕麦科技	2020年5月29日	2020年12月8日	科创板新股锁定	19.68	41.77	7,390	145,435.20	308,680.30	-

注：

1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

6.4.12.2 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

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中风险收益特征的证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资及权证投资等。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。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“风险和收益相匹配”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，主要是发掘各类风险的风险点，判断风险发生的频度和损失，对风险实行分级管理。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，日常的分析报告，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时对各种风险进行监控和评估，并通过风险处置流程，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人招商银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以

控制相应的信用风险。

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 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 1.11%。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
AAA	36,672,111.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	36,672,111.00

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 2020 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》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上市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上述比例限制）。

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。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%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有流动性受限资产。

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。于 2020 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。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。

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、买入返售金融资产和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	412,531,150.44	-	-	-	412,531,150.44
结算备付金	1,559,469.73	-	-	-	1,559,469.73
存出保证金	602,107.65	-	-	-	602,107.65
交易性金融资产	-	-36,672,111.00	2,843,724,683.61	2,880,396,794.61	2,880,396,794.61
应收证券清算款	-	-	-	87,186,602.67	87,186,602.67
应收利息	-	-	-	91,342.14	91,342.14
应收股利	-	-	-	8,540,113.37	8,540,113.37
应收申购款	-	-	-	2,701,462.96	2,701,462.96
资产总计	414,692,727.82	-36,672,111.00	2,942,244,204.75	3,393,609,043.57	3,393,609,043.57
负债					
应付证券清算款	-	-	-	288.47	288.47
应付赎回款	-	-	-	85,101,531.98	85,101,531.98
应付管理人报酬	-	-	-	4,328,731.51	4,328,731.51
应付托管费	-	-	-	721,455.25	721,455.25
应付交易费用	-	-	-	1,354,097.68	1,354,097.68
其他负债	-	-	-	312,083.14	312,083.14
负债总计	-	-	-	91,818,188.03	91,818,188.03
利率敏感度缺口	414,692,727.82	-36,672,111.00	2,850,426,016.72	3,301,790,855.54	3,301,790,855.54

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 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.11%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民 币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,285,186,736.13	-	1,285,186,736.13
应收股利	-	8,540,113.37	-	8,540,113.37
资产合计	-	1,293,726,849.50	-	1,293,726,849.50
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口 净额	-	1,293,726,849.50	-	1,293,726,849.50

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。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，港股投资比例不得超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%（现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）。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 2020 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,843,724,683.61	86.13
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	2,843,724,683.61	86.13

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（2020 年 6 月 30 日）
	业绩比较基准上升 5%	增加约 18,490
	业绩比较基准下降 5%	减少约 18,490

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 2020 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 2,879,534,305.10 元，属于第二层次的余额为 862,489.51 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 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。

(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	2,843,724,683.61	83.80
	其中：股票	2,843,724,683.61	83.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	36,672,111.00	1.08
	其中：债券	36,672,111.00	1.08
	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	414,090,620.17	12.20
8	其他各项资产	99,121,628.79	2.92
9	合计	3,393,609,043.57	100.00

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	789,906,358.92	23.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	86,967,639.40	2.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,137,097.57	0.31
J	金融业	448,830,827.97	13.59
K	房地产业	31,368,000.00	0.95
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	142,456,251.30	4.31
R	文化、体育和娱乐业	48,859,006.00	1.48
S	综合	-	-
	合计	1,558,537,947.48	47.20

注：鉴于部分行业分类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”。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
消费者非必需品	129,542,005.56	3.92
公用事业	-	-
电信业务	-	-
信息技术	739,326,360.80	22.39
金融	247,555,579.88	7.50
医疗保健	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
能源	-	-
消费者常用品	87,602,549.76	2.65
房地产	81,160,240.13	2.46
合计	1,285,186,736.13	38.92

注：以上分类采用 GICS 行业分类标准。

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	00700 HK	腾讯控股	491,000	223,621,621.34	6.77
2	002304	洋河股份	1,880,000	197,663,200.00	5.99
3	02382 HK	舜宇光学科 技	1,323,600	149,919,618.82	4.54
4	00981 HK	中芯国际	6,001,000	148,001,942.88	4.48
5	002142	宁波银行	5,607,129	147,299,278.83	4.46
6	002044	美年健康	9,885,930	142,456,251.30	4.31
7	601166	兴业银行	7,599,923	119,926,784.94	3.63
8	000403	双林生物	1,549,966	114,898,979.58	3.48
9	601318	中国平安	1,489,801	106,371,791.40	3.22

10	601966	玲珑轮胎	5,006,504	101,131,380.80	3.06
11	03888 HK	金山软件	2,709,000	89,206,048.01	2.70
12	00291 HK	华润啤酒	2,220,000	87,602,549.76	2.65
13	002352	顺丰控股	1,589,902	86,967,639.40	2.63
14	600298	安琪酵母	1,580,268	78,191,660.64	2.37
15	00388 HK	香港交易所	257,200	77,529,133.44	2.35
16	000001	平安银行	5,877,576	75,232,972.80	2.28
17	000858	五粮液	380,600	65,128,272.00	1.97
18	002475	立讯精密	1,200,108	61,625,545.80	1.87
19	600059	古越龙山	6,527,283	60,834,277.56	1.84
20	02013 HK	微盟集团	6,800,000	60,436,844.16	1.83
21	01918 HK	融创中国	2,000,000	59,282,256.00	1.80
22	01398 HK	工商银行	12,850,000	55,167,208.80	1.67
23	01765 HK	希望教育	22,096,000	53,485,931.14	1.62
24	000002	万科A	1,200,000	31,368,000.00	0.95
24	02202 HK	万科企业	977,600	21,877,984.13	0.66
25	03690 HK	美团点评— W	320,000	50,246,507.52	1.52
26	300144	宋城演艺	2,824,220	48,859,006.00	1.48
27	00772 HK	阅文集团	987,200	47,071,243.93	1.43
28	03908 HK	中金公司	3,069,200	42,669,727.33	1.29
29	601012	隆基股份	1,000,000	40,730,000.00	1.23
30	01299 HK	友邦保险	500,000	33,020,856.00	1.00
31	002415	海康威视	1,000,000	30,350,000.00	0.92
32	600690	海尔智家	1,376,000	24,355,200.00	0.74
33	01336 HK	新华保险	1,000,000	23,703,768.00	0.72
34	00268 HK	金蝶国际	1,280,000	21,069,041.66	0.64
35	01797 HK	新东方在线	718,500	20,411,136.50	0.62
36	06818 HK	中国光大银行	5,818,000	15,464,886.31	0.47
37	688278	特宝生物	197,604	13,982,459.04	0.42
38	600406	国电南瑞	500,000	10,125,000.00	0.31
39	01896 HK	猫眼娱乐	500,000	5,398,430.40	0.16
40	688312	燕麦科技	7,390	308,680.30	0.01
41	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
42	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
43	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
44	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
45	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.00

46	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
47	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
48	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
49	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
50	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
51	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
52	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
53	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
54	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
55	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	00700 HK	腾讯控股	267,961,415.63	8.12
2	002304	洋河股份	216,465,972.29	6.56
3	02382 HK	舜宇光学科技	200,317,526.09	6.07
4	00981 HK	中芯国际	191,700,800.10	5.81
5	002044	美年健康	170,529,954.54	5.16
6	002142	宁波银行	152,460,442.23	4.62
7	601166	兴业银行	129,546,916.62	3.92
8	000001	平安银行	118,654,792.36	3.59
9	601966	玲珑轮胎	114,755,698.10	3.48
10	00388 HK	香港交易所	112,648,517.84	3.41
11	600009	上海机场	110,796,060.04	3.36
12	601318	中国平安	109,463,449.07	3.32
13	000403	双林生物	95,741,830.13	2.90
14	000002	万科A	91,691,991.34	2.78
15	002352	顺丰控股	85,101,399.26	2.58
16	000858	五粮液	81,144,113.04	2.46
17	00291 HK	华润啤酒	79,115,897.05	2.40

18	300144	宋城演艺	78,808,574.43	2.39
19	01810 HK	小米集团-W	78,411,429.35	2.37
20	601111	中国国航	76,769,969.00	2.33

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	00981 HK	中芯国际	140,854,194.11	4.27
2	600009	上海机场	111,435,961.11	3.38
3	00700 HK	腾讯控股	95,447,576.25	2.89
4	01810 HK	小米集团-W	76,234,398.35	2.31
5	601111	中国国航	66,031,020.00	2.00
6	03618 HK	重庆农村商业银行	55,108,634.28	1.67
7	000002	万科A	54,265,683.96	1.64
8	02382 HK	舜宇光学科技	53,026,903.74	1.61
9	002044	美年健康	51,302,815.99	1.55
10	000796	凯撒旅业	50,137,855.80	1.52
11	00388 HK	香港交易所	46,901,596.78	1.42
12	002304	洋河股份	41,437,732.24	1.26
13	300144	宋城演艺	40,469,119.00	1.23
14	600519	贵州茅台	38,210,471.28	1.16
15	002601	龙麟佰利	36,545,385.84	1.11
16	000858	五粮液	35,359,774.12	1.07
17	000001	平安银行	26,709,897.00	0.81
18	601601	中国太保	26,203,045.50	0.79
19	02238 HK	广汽集团	23,775,263.62	0.72
20	02899 HK	紫金矿业	22,930,061.90	0.69

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	3,714,924,703.97
卖出股票收入（成交）总额	1,293,696,294.94

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	36,672,111.00	1.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	36,672,111.00	1.11

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	360,060	36,672,111.00	1.11

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	602,107.65
2	应收证券清算款	87,186,602.67
3	应收股利	8,540,113.37
4	应收利息	91,342.14
5	应收申购款	2,701,462.96

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,121,628.79

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	36,672,111.00	1.11

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
36,072	81,401.15	606,614.13	0.02%	2,935,695,753.87	99.98%

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	232,309.42	0.007912%

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（2020年2月13日）基金份额总额	3,914,634,665.57
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	25,767,992.39
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,004,100,289.96
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,936,302,368.00

§ 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二十二次会议审议通过，自 2020 年 6 月 19 日起，首席信息官丁磊先生担任公司高级管理人员。相关公告已于 2020 年 6 月 20 日在《证券时报》和公司网站披露。

(二) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

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	
国海证券	2	2,691,608,022.89	53.81%	2,344,401.93	55.88%	-
东北证券	1	855,127,873.08	17.10%	744,396.90	17.74%	-
华创证券	1	625,242,634.04	12.50%	483,667.11	11.53%	-
长江证券	1	421,349,183.98	8.42%	312,085.15	7.44%	-

东方证券	1	408,501,547.67	8.17%	310,806.22	7.41%	-
------	---	----------------	-------	------------	-------	---

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，本基金逐步新增国海证券上海及深圳交易单元各 1 个，东北证券深圳交易单元 1 个，华创证券上海交易单元 1 个，东方证券上海交易单元 1 个，长江证券深圳交易单元 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
国海证券	39,102,942.20	100.00%	2,105,600,000.00	49.83%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	1,600,000,000.00	37.86%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	520,000,000.00	12.31%	-	-

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	富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 1 月 6 日
2	富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 1 月 6 日
3	富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 1 月 6 日
4	富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 1 月 6 日
5	富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 1 月 6 日
6	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 1 月 17 日
7	关于增加部分销售机构为富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金代销机构的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 1 月 21 日
8	国海富兰克林基金管理有限公司关于做好新型冠状病毒感染的肺炎	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 3 日

	炎疫情防控工作的提示性公告		
9	关于增加部分销售机构为富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金代销机构的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 8 日
10	关于增加部分销售机构为富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金代销机构的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 8 日
11	关于富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 11 日
12	富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 14 日
13	公司旗下基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订法律文件的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 28 日
14	国海富兰克林基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下 32 只公募基金法律文件的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 28 日
15	富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金基金合同更新	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 28 日
16	富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金托管协议更新	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 28 日
17	富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金更新招募说明书及摘要	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 28 日
18	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 3 月 27 日
19	国海富兰克林基金管理有限公司关于中止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 4 月 7 日
20	富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2020 年 2 号）	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 4 月 17 日
21	富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金更新招募说明书（2020 年 2 号）	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 4 月 17 日
22	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指定网站	2020 年 4 月 20 日
23	公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 4 月 21 日

24	国海富兰克林基金管理有限公司 2020年第一季度报告提示性公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020年4月21日
25	国海富兰克林基金管理有限公司 关于旗下部分基金于2020年非 港股通交易日暂停基金交易业务 的公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020年4月27日
26	国海富兰克林基金管理有限公司 关于提醒直销个人投资者完善身 份信息的公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020年4月30日
27	富兰克林国海基本面优选混合型 证券投资基金开放申购、赎回、 转换和定期定额投资业务公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020年5月8日
28	富兰克林国海基本面优选混合型 证券投资基金参加部分销售机构 申购、定期定额投资费率优惠活 动的公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020年5月12日
29	国海富兰克林基金管理有限公司 关于终止泰诚财富基金销售（大 连）有限公司办理相关销售业务 的公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020年6月4日
30	国海富兰克林基金管理有限公司 高级管理人员变更公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020年6月20日
31	关于增加大连网金基金销售有限 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 刊及指定网站	2020年6月22日
32	关于增加华安证券股份有限公司 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 刊及指定网站	2020年6月22日
33	关于增加阳光人寿保险股份有限 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 刊及指定网站	2020年6月22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基本面优选混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海基本面优选混合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。

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

2020 年 8 月 28 日