富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司　　基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2015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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015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2015年2月3日(基金合同生效日)起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国富大中华精选混合(QDII)
基金主代码	000934
交易代码	000934
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月3日
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	125,621,312.26
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极进行资产配置和组合管理,投资于大中华地区证券市场和海外证券市场发行的大中华企业,以力争获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	(一)资产配置策略 本基金将根据宏观大势进行资产配置调整,通过对全球宏观经济状况、区域经济发展情况、证券市场走势、政策法规影响、市场情绪等综合分析,调整基金在股票、债券等资产类别上的投资比例,以降低投资风险,提高收益。 (二)区域配置策略 本基金主要投资于大中华地区。本基金通过对国家或区域的经济发展趋势、财政政策、货币政策、就业状况及市场估值水平变化等方面进行深入研究和比较分析的基础上,确定投资区域的权重。 (三)股票投资策略 本基金将采用"自下而上"的选股策略,通过对企业基本面的分析和研究,挖掘基本面良好、具有较强竞争力和持续成长能力的上市公司作为投资方向。主要评估因素包括: 1.公司竞争优势评估——在行业中处于领先地位,或者在生产、技术、市场等一个或多个方面具有行业内领先地位的上市公司。 2.盈利能力评估——结合公司所处行业的特点和发展趋势、公司背景、从财务结构、资产质量、业务增长、利润水平、现金流特征等方面考察公司的盈利能力,专注于具有行业领先优势、资产质量良好、盈利能力较强、盈利增长具有可持续性的上市公司。 3.成长能力评估——选择具有持续、稳定的盈利增长历史,且预期盈利能力将保持稳定增长的公司。 4.公司治理结构评估——清晰、合理的公司治理是公司不断良性发展的基础。从股权结构的合理性、信息披露的质量、激励机制的有效性、关联交易的公允性、公司的管理层和股东的利益是否协调和平衡、公司是否具有清晰的发展战略等方面,对公司治理水平进行综合评估。 5.估值评估——企业的估值水平在一定程度上反应了其未来成长性以及当前投资的安全性。估值合理将是本基金选股的一个重要条件。本基金通过评估公司相对市场和行业的相对投资价值,选择目前估值水平明显较低或估值合理的上市公司。 (四)新股申购策略 本基金基于对首次发行股票(IPO)及增发新股的上市公司的基本面研究、估值分析,判断新股的投资价值、参与新股申购的预期收益和风险,从而制定相应的申购策略。 (五)债券投资策略 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,构建债券组合。 (六)金融衍生品投资策略 基金管理人在确保与基金投资目标相一致的前提下,可本着谨慎和风险可控的原则,适度投资于经中国证监会允许的各类金融衍生产品,如期权、期货、权证、远期合约、掉期等。本基金投资于衍生工具主要是为了避险和增值、管理汇率风险,以便能够更好地实现基金的投资目标。本基金投资于各类金融衍生工具的全部敞口不高于基金资产净值的100%。
业绩比较基准	MSCI金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)×60%+同期人民币一年期定期存款利率(税后)×40%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中等风险收益特征的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国海富兰克林基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	林葛
	联系电话	021-3855 5555	010-66060069
	电子邮箱	service@ftsfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-4518,9510-5680和021-38789555	95599
传真		021-6888 3050	010-68121816

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	-	纽约梅隆银行股份有限公司
注册地址		-	One Wall Street, New York, NY
办公地址		-	One Wall Street, New York, NY
邮政编码		-	10286

2.5 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年2月3日-2015年6月30日)
本期已实现收益	34,238,028.74
本期利润	24,511,534.64
加权平均基金份额本期利润	0.1035
本期基金份额净值增长率	5.70%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2015年6月30日)**
期末可供分配基金份额利润	0.0569
期末基金资产净值	132,767,836.43
期末基金份额净值	1.057

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	-10.80%	2.25%	-2.45%	0.64%	-8.35%	1.61%
过去三个月	4.14%	2.32%	2.78%	0.68%	1.36%	1.64%
自基金合同生效起至今	5.70%	1.86%	5.12%	0.58%	0.58%	1.28%

注:本基金的业绩比较基准为60%×MSCI金龙净总收益指数+40%×人民币一年期定期存款利率(税后)。

本基金股票投资部分的业绩比较基准采用MSCI金龙净总收益指数,具有较强的代表性。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理,日收益率(Benchmark)按下列公式计算:

Benchmark t = 60% × (MSCI金龙净总收益指数t/ MSCI金龙净总收益指数t-1)+40% × 人民币一年定期存款利率(税后)/360

其中,t=1,2,3,…, T,T表示时间截止日。

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

注:本基金的基金合同生效日为2015年2月3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,目前公司注册资本22亿元人民币,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65年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿投资集团享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系,借助国海证券股份有限公司的综合业务优势,力争成为国内一流的基金管理公司。

本公司具有丰富的管理基金经验。自2005年6月第一只基金成立开始,截至本报告期末,本公司已经成功管理了20只基金产品(包含A、C类混合基金,A、B、C类债券基金,A、B类货币市场基金)。

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		
曾宇	国富亚洲机会股票(QDII)和国富大中华精选混合(QDII)基金经理	2015年2月3日	-	11年	曾宇先生,法国籍,CFA,巴黎高等商学院研究生硕士。历任汇丰集团信汇资产管理公司基金经理助理,交易员,Financi è re de l' Echiquier基金经理助理,股票分析师。截止本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富亚洲机会股票(QDII)和国富大中华精选混合(QDII)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《富兰克林国海大中华精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,公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配、信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》,严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

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

基于有好香港市场的表现,本基金在今年上半年成立之后加快建仓速度,以配置香港市场为主。在板块方面,基于中小市值公司的成长机会和合理估值,本基金增加了在中小市值公司上的配置。该配置在上半年前期市场上涨的过程中给基金带来较好的收益,但五月份开始的市场剧烈调整,导致基金净值出现较大的波动。尤其港股的中小市值公司的股价表现,体现了和中国A股市场较大的关联度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自成立以来至六月底,本基金净值上涨5.70%。相比之下,基金业绩比较基准上涨5.12%.基金表现略好于业绩比较基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前美国经济出现持续改善,美联储加息的预期日渐加强,相比之下,亚洲包括中国等新兴市场经济体经济增长出现放缓,这导致美元指数持续走强。资金流出新兴市场的趋势较为明显。中国国内股市近期出现的剧烈调整,也波及了香港等海外市场的整体表现。大中华市场目前整体估值处于历史低位,而香港市场估值优势更为突出,中长期投资吸引力较大。港股未来将继续受益于中国资本市场的进一步开放。在中国经济转型的过程中,如医疗、环保、科技等新兴行业都将涌现出一批优质的上市公司。本基金未来将继续保持较高的股票仓位,以自下而上选取优质成长型公司为主,兼顾估值,以争取更好的表现。

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。公司估值委员会由董事长(本报告期内代为履行总经理职责)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,根据本基金基合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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人-国海富兰克林基金管理有限公司 2015年2月3日(基金合同生效日)至 2015年 6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,国海富兰克林基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,国海富兰克林基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日
资 产:	
银行存款	11,344,460.48
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	126,065,317.40
其中:股票投资	126,065,317.40
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	4,414,552.40
应收利息	786.15
应收股利	1,131,448.73
应收申购款	133,441.02
递延所得税资产	-
其他资产	5,548,175.11
资产总计	148,638,181.29
负债和所有者权益	**本期末 2015年6月30日**
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	9,958,859.00
应付管理人报酬	194,946.50
应付托管费	35,090.38
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	5,681,448.98
负债合计	15,870,344.86
所有者权益:	
实收基金	125,621,312.26
未分配利润	7,146,524.17
所有者权益合计	132,767,836.43
负债和所有者权益总计	148,638,181.29

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.057元,基金份额总额125,621,312.26份。

6.2 利润表

会计主体:富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金

本报告期:2015年2月3日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年2月3日至2015年6月30日
一.收入	29,790,465.34
1.利息收入	515,982.06
其中:存款利息收入	138,814.44
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	377,167.62
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	39,645,936.71
其中:股票投资收益	28,928,550.28
基金投资收益	2,409,842.22
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	6,546,120.47
股利收益	1,761,423.74
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-9,726,494.10
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-2,450,117.25
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,805,157.92
减:二、费用	5,278,930.70
1. 管理人报酬	1,617,998.86
2. 托管费	291,239.76
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	3,255,426.65
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	114,265.43
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	24,511,534.64
减:所得税费用	
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	24,511,534.64

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金

本报告期:2015年2月3日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年2月3日至2015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)	330,232,755.09		330,232,755.09
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	24,511,534.64	24,511,534.64
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)	-204,611,442.83	-17,365,010.47	-221,976,453.30
其中:1.基金申购款	179,069,132.32	27,359,416.52	206,428,548.84
2.基金赎回款	-383,680,575.15	-44,724,426.99	-428,405,002.14
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)	125,621,312.26	7,146,524.17	132,767,836.43

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:

基金管理公司负责人 吴冠玲(董事长,本报告期内代为履行总经理职责)	主管会计工作负责人 胡昕彦	会计机构负责人 黄宇虹

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海大中华精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[2014]1236号《关于准予富兰克林国海大中华精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《富兰克林国海大中华精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330,173,165.87元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2015)第110号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金基金合同》于2015年2月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为330,232,755.09份,其中认购资金利息折合59,589.22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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金可投资于下列金融产品或工具:银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(含交易型开放式指数基金ETF);与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品;法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关要求)。本基金主要投资于大中华地区证券市场和在其他证券市场发行的"大中华企业"股票、存托凭证、债券和衍生品等。"大中华地区证券市场"为中国证监会允许投资的香港、台湾和中国内地证券市场等。"大中华企业"是指满足以下三个条件之一的上市公司:1)上市公司注册在大中华地区(中国内地、香港、台湾、澳门);2)上市公司中最少百分之五十之营业额、盈利、资产,或制造活动来自大中华地区;3)控股公司,其子公司的注册办公室在大中华地区,且主要业务活动亦在大中华地区。基金的投资组合比例为:股票等权益类资产投资比例为基金资产的40%-95%,债券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具投资比例为基金资产的5%-60%,其中,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%。 本基金投资于大中华地区证券市场和在其他证券市场发行的"大中华企业"的资产不低于非现金基金资产的80%。本基金的业绩比较基准为:MSCI 金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)×60% + 同期人民币一年期定期存款利率(税后)×40%。

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2015年8月26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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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>》及相关修订,中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,《富兰克林国海大中华精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发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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2015年6月30日的财务状况以及2015年2月3日(基金合同生效日)至2015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

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》及其他相关境内外税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂免征营业税和企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金管理人全资控股的子公司国海富兰克林资产管理(上海)有限公司以自有资金全额出资,成立国海富兰克林投资管理(上海)有限公司,并已在工商行政管理部门办理完成工商注册登记,取得营业执照。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人、基金销售机构
纽约梅隆银行股份有限公司(The Bank of New York Mellon Corporation)	基金境外资产托管人
国海证券股份有限公司("国海证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
邓普顿国际股份有限公司(Templeton International, Inc.)	基金管理人的股东
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
国海富兰克林投资管理(上海)有限公司	基金管理人存在控制关系的公司

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年2月3日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,617,998.86
其中:支付销售机构的客户维护费	693,079.63

注:支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的基金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:日计提报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年2月3日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	291,239.76

注:支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.27%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 0.27% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券、回购交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

1.基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

2.本基金基金合同生效日为2015年2月3日,本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

1.本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

2.本基金基金合同生效日为2015年2月3日,本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年2月3日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年02月03日-2014年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3,282,407.56	136,026.17	-	-
纽约梅隆银行	8,062,052.92	-	-	-
合计	11,344,460.48	136,026.17	-	-

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国农业银行和境外资产托管人纽约梅隆银行保管,按适用利率或约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2015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

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时份额等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2015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 126,065,317.40元,无属于第二层次和第三层次的余额。于2015年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次。

(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,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,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。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、资产支持证券和私募债券除外),本基金于2015年3月26日起改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注6.4.5.2),并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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2015年06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	126,065,317.40	84.81
	其中:普通股	123,109,963.12	82.83
	存托凭证	2,955,354.28	1.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,344,460.48	7.63
8	其他各项资产	11,228,403.41	7.55
9	合计	148,638,181.29	100.00

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
香港	123,109,963.12	92.73
美国	2,955,354.28	2.23
合计	126,065,317.40	94.95

注:以上国家(地区)均按照股票及存托凭证上市交易地点进行统计

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
材料	4,739,609.19	3.57
电信服务	-	-
信息技术	26,531,824.17	19.98
非必需消费品	4,901,431.96	3.69
必需消费品	-	-
能源	1,839,827.13	1.39
保健	7,627,417.00	5.74
金融	55,818,273.19	42.04
工业	18,719,511.60	14.10
公用事业	5,887,423.16	4.43
合计	126,065,317.40	94.95

注:以上分类采用GICS行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	Haitong International Securities Group Limited	海通国际	BBG000C313X5	香港联合交易所	香港	1,822,000.00	10,057,931.94	7.58
2	Value Partners Group Limited	惠理集团	BBG000TW8473	香港联合交易所	香港	901,000.00	8,696,980.35	6.55
3	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd	香港交易所	BBG000BGW354	香港联合交易所	香港	35,500.00	7,659,611.21	5.77
4	CIFI Holdings (Group) Co. Ltd	旭辉控股集团	BBG003MHHV68	香港联合交易所	香港	4,590,000.00	7,348,031.40	5.53
5	KWG Property Holding Ltd	合景泰富地产	_BBG000Q71X74	香港联合交易所	香港	1,333,500.00	6,877,538.78	5.18
6	China Railway Construction Corp Ltd	中国铁建	BBG000QNN9H7	香港联合交易所	香港	703,500.00	6,646,349.88	5.01
7	CAR Inc	神州租车	BBG00071LBRS4	香港联合交易所	香港	475,000.00	6,180,730.88	4.66
8	EGL Holdings Co Ltd	东瀛游	BBG007K5DD07	香港联合交易所	香港	2,204,000.00	4,901,431.96	3.69
9	Fosun International Ltd	复星国际	BBG000RJJ5Z8	香港联合交易所	香港	329,500.00	4,739,609.19	3.57
10	China CITIC Bank Corp Ltd	中信银行	BBG000J7DX33	香港联合交易所	香港	972,000.00	4,737,148.73	3.57

注:投资者欲了解本报告期末基金投资