富兰克林国海弹性市值混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日 基金管理人;間海當兰克林基金管理有限公司 基金任管人;中國农业银行股份有限公司 进出日期;2018年8月25日 §1重要提示及目录

§ 2 基金简介 2.1 基金基本情况 450002 2006年6月14日

报告期末基金份額总額	3, 298, 332, 496.38 🕅
基金合同存续期	不定期
2.2 基金产品说明	<u> </u>
投资目标	本基金以富兰克林邓普顿基金集团环球资产管理平台为依托,在充分 结合国务斯光度等市场特性的原则下,通过主要投资于具有绘构且可 持续要全性费,未来放益具有最佳的上心可思测,通效严资产 价值低估的上市公司股票,以达到基金财产长期增值的目的。
投资策略	對於起棄地區, 一般協定下、投資法重要員会負责基金制产的配置機能,并采用資产配易分析的影響的表表的影光来來華。以資产配置分析合物的形形 化苯基。以資产配置分析合物的形形,保证证明和政策的基础的工程性的科学企業。與产产配更分析合物的创新形式保证证明和政策的工程,并不是实现的一个企业,并不是实现的一个企业,并不是实现的一个企业,并不是实现的一个企业,并不是实现的一个企业,并不是实现的一个企业,并不是实现的一个企业,并不是实现的一个企业,就是一个企业,这一个企业,这一个企业,这一个企业,这一个企业,这一个企业,这一个企业,这个企业,这个企业,这个企业,这个企业,这个企业,这个企业,这个企业,这
业绩比较基准	70%× MSCI 中国 A 股指数 + 25%× 中债国债总指数(全价) + 5%× 同业存款息率
	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
风险收益特征	于债券型基金及货币市场基金,属于中等风险收益特征的基金品种。

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 务指标和基金净值表现		
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址		N 800 Hr	www.ftsfund.com		
2.4 信息披露	方式				
传兆 021- 6888 3		021- 6888 30	050	010- 6812 1816	
		400- 700- 45 021-387895	518 ,9510- 5680 和 555	95599	
电子邮箱		service@tsfund.com		tgxxpl@abchina.com	
信息披露负责人 联系电话		021- 3855 5555		010- 6606 0069	
	姓名	储丽莉		製價	
石朴 国和		国得高二光生	李盛五官理有限公司	中国农业银行政切有限公司	

基金管理人

基金托管人

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(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	47, 941, 433.11
本期利润	- 402, 384, 018.08
加权平均基金价值太超利润	- 0.1442

本期利润	- 402, 384, 018.08
加权平均基金份額本期利润	- 0.1442
本期基金份額净值增长率	- 11.39%
3.12 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0756
期末基金资产净值	3, 547, 559, 525.76
期末基金份額净值	1,0756

5-1年服內內相称不用的计算公式,详见证监会发布的证券投资基金信息披露编程规则一第 1 号主要财务指标的计算及按照)。 2、本即之实现改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)和除 相关费用后的余额,本期利润为本即已实现收益加土本期公允价值变动收益。 3.期末可供分配利润。共用期末积产价值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.上述基金业储指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如,开放式基金的中助赎回费等,计人费用启运所收益要低于新为数字。 3.2 基金净值贷现 3.2 基金份额价值增长率及其与即即业体比较增加。

阶段	份额净值增长 率①	份額净值增长 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	- 7.10%	0.96%	- 5.63%	0.99%	- 1.47%	- 0.03%
过去三个月	- 8.47%	0.88%	- 9.03%	0.81%	0.56%	0.07%
过去六个月	- 11.39%	0.96%	- 11.94%	0.82%	0.55%	0.14%
过去一年	2.78%	0.88%	- 9.22%	0.68%	12.00%	0.209
过去三年	17.24%	1.61%	- 24.64%	1.09%	41.88%	0.52%
自基金合同生效 起至今	556.97%	1.53%	109.70%	1.25%	447.27%	0.28%

性管理性工程的系统是影响或引擎定数性。斯特曼是我们把影響设置 \$1000克克斯 到上京 § 4 管理人报告

4.日報告首本签官即到定。
4.日本金管理人及基金经期情况
4.1本金管理人及基金经期情况
4.1本金管理人及其管理基金的经验
国商富兰泉基金管理有限公司成立于 2004 年 11 月,由国高证券股份有限公司和富兰克林
对普顿投资课总统会管理有限公司放立于 2004 年 11 月,由国高证券股份有限公司注册资本 2.2 亿元
人民币、国高证券股份有限公司持有 5 7%的股份,邓普姆国际股份有限公司持有 49%的股份。
国高证券股份有限公司股内 会市场第 16 家上市券市 是用有金业务师,常区得品渝市
中国主要城市的会国性综合委证券公司。富兰克林布等朝投资集团是世界和名基金管理公司,在
全球市场上有超过70 年份投资理整验。 国富兰克林泰金使罪有限公司引进富兰安林布的
投资集团享受金球的投资机制,研究平台和风险控制体系,借助国高证券股份有限公司的综合业
多优势,力争公球的投资机制,研究平台和风险控制体系,借助国高证券股份有限公司的综合业
本公司具有丰富的管理基金管理公司。
本公司共有丰富的管理基金管理公司。
本公司共有丰富的管理基金经验。自 2005 年 6 月第一只基金成立开始,截至本报告期未,本
公司已经成功管理工场。只是金产品。
在公司经营业营业了3.日及金产品。
4.1.2 基金经理(成款金经理)组队发金经理助期两份

44.75	姓名 职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年	逆明
红石	81.77	任职日期	离任日期	限	18.91
赵晓东	公賣ODI益事小金点基準合富基區 公賣ODI益事小金点基準合富基經 在企業。企業。全性基位全理 可息以,有企業。全性基位全理	2014年12月19日		14 年	起院东生生。各港大学MBA、 任福等企业提問用目包集系生 多分份。上海公务份、上海公务的大会经 有限公司实现投资处理,国际公 有限公司实现投资处理,国际公 是有限公司等现公司等以 是有限公司等现公司等以 是有限公司等现公司等以 是有限公司等的是一个企业的。 是有限公司等的是一个企业的。 是有限公司等的是一个企业的。 是有限公司等的是一个企业的。 是有限公司等的是一个企业的。 是有限公司等的是一个企业的。 是有限公司等的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个企业的是一个企业的是一个企业的。 是一个企业的是一个一个企业的是一个一个企业的是一个一个企业的是一个一个一个企业的是一个一个企业的是一个一个企业的是一个一个企业的是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个

在1. 在一任职日期"和"属任日期"分别指根据公司决定确定的两任日期和解聘日期,其中,首任监查经理的任职日期"为监查台国生效目。
2. 使中"证券从业年限"的计算标准分数。名列工从事过的所有诸如监查、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总积。
4.2 管理人发标控制内本基金运作建规守信情况的说明
报公前内,本基金管理人严格通气中平人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和富兰主教组制的特性。但在党业还转投资基金基金合同的的规定。本着被实信用,则剩至贵的原则管理规证用基金资产。在严格控制风险的基础上,为基金价额持有人从果来放入利益、尤指幸基金份额待有人制造的行为,基金投资组合特合并法律、法规的规定及基金合同的约定。
4.3 管理人对格告期内公司产格比较的最少,用确了公平交易的原则由有,到订了实现公平交易的原则和企业产业的特征的专项规则
从另市内公司产格执行公平交易高度制度》,用确了公平交易的原则由使,到订了实现公平交易的原则和企业产业的通常的人工业发展的调查价值,是必要不可投资组合问通过价差交易进行利益输送的行为。
4.3 定率交易可以使用的通过价差交易进行对益输送的行为。
4.3 定率交易可以使用自由交通管理办法》对非常交易进行其控。按证明中依据代诉者交易监控与报告制度》和《四日反向交易管理办法》对非常交易进行适证。
按当由及定量的5%的情况。
4.4 管理人对格告别内基金的投资维贴和业债表现代请完多的基础过过证证券当日由发生的6%的情况。

4.4 管理人有核告期內基金的投资策略和业债表现的说明
4.4.1 假告期内基金的投资策略和业债表现的说明
4.4.1 假告期内基金的投资策略证许分析
中国经济上半年继续期待数高的增强。GDP 同比增速 6.8%,其中消费增速同比增长 9.4%,对
经济增地。传统了些学体更多的。18%,是所有的特殊优化。上半年战略新兴产业增速 8.7%。然于经 增增、传统了经济交益年代。 18%,是所有的特殊优化。上半年战略新兴产业增速 8.7%。然于经 增速,传统了经济交益在任何的风险的大学最下。强监管和去红年成为金融行业的主要工作。社会融 现益则,上半年在去红年,防风险的大学最下,强监管和去红年成为金融行业的主要工作。社会融 设金量增强期盈回高、宏观能生和限制等宽度全局和去红年成为金融行业的主要工作。社会融 企业大幅层面市场。金融,进行和周期等宽度全量和步、上半于26%。30分 指数,一步转 低业债稳定且增长确定性强的行业成为市场的热点。成药健康 大众消费和自主创新的计量机等 业长指数分别下跌 12,90%,16,53%和 8,33%。创业板业身好干代表高级股份分深 300 指数, 在投资增贴上,我们给收免损益不能设置的方向。从周安参考,一是寻找相价估值帐。业绩 持续增长的成长股;一是寻找价值较低的存在阶段性业绩反转或加速增长的中大盘价值度、在选 提上,我们相处的全分也所或。或增输定强、企业竞争力实出作为效量重要的标准。提高组合的公 预量、数力于在长期中中来超强的收益。

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

不愈差特继续按照。据言即及由大征时在原本介入所以。 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事顶的这明 本公司在报告期内有效控制基金估值接租 按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员 会间称"恰值委员会",并已制订了《公允估值管理办法》,恰值委员会审核和决定投资资产估值 的相关事务。通报金给值的公人。合理、保证信任来被查出出以安排金持有人产生不利影响,很 告期内相关基金估值改资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 包括投资,风险控制。建设解核、交易、益金核算方面份部门上管、相关人员动具有丰富的证券基金 行业从业验验和专业能力。基金经理加入总值有效曲点有失少允恰情况。应的信金委员会员 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 管理人对接受期内基金则分配信贷的信息。

4.7 管理人对报告期內基金利润分配情况的增加 本基金的基金管理人于2018年5月26日宣告分紅,向截至2018年5月28日止在本基金注记人国高富兰克林基金管理有限公司登记在册的金体持有人,按每10份基金份额派发红利

00元。 本基金本报告期所实现的利润分配情况符合基金合同要求 4.8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。
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信债风声明
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信债风声明
在任管承基金的过程中、本基金任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)相关法律法据的规定以及基金合同,任管协议的约定、对本基金基金管理人。国高第三支林基 金管理信假公司2018年1月1日至2018年2月30日基金的投资业使,提行了认真,他立约会对 核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何组害基金份额持有人利益的行

利益的行为,在报告期户,严格遵守了(世券投资基金店)等有关选择法规,在各重要方面的运作严格按照基金后的规定进行。 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的英文,准确和完整发表意见 本托管人认为,固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等起入及其他相方法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半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,未发现有据责基金持有人利益的行为。 6 年年度财务会计报告(未经审计)

\$ 6 半年度財务会计报告(未经 6.1 资产负债表 会计主体;富兰克林国海弹性市值混合型证券投资基金 报告截止日;2018 年 6 月 30 日

本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年 12 月 31 日	
238, 227, 265.37	161, 795, 493.8	
5, 978, 908.81	3, 499, 064.9	
1, 135, 925.41	2, 683, 713.6	
3, 227, 169, 168.35	2, 882, 245, 2193	
3, 026, 780, 262.15	2, 836, 563, 2193	
200, 388, 906.20	45, 682, 000.0	
99, 800, 249.90	92, 064, 338.1	
706, 546.73	120, 106, 468.4	
4, 787, 939.99	1, 406, 144.5	
562, 272.73	875, 829.6	
-		
-		
3, 578, 368, 277.29	3, 264, 676, 272.4	
本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年 12 月 31 日	
21, 284, 326.12	13, 962, 952.0	
1, 533, 735.08	2, 298, 299.5	
4, 584, 687.74	4, 157, 893.7	
764, 114.64	692, 9822	
1, 935, 818.09	3, 217, 837.7	
219, 345.74	219, 340.0	
-	.,	
486, 724.12	837, 481.9	
	25, 386, 787.2	
00,000,10100	20,000,1012	
3, 298, 332, 496 38	2, 536, 645, 797.4	
	702, 643, 687.7	
	3, 239, 289, 485.2	
3, 578, 368, 277.29	3, 264, 676, 272.4	
	2018/# 6 /J 30 II 238, 227, 265, 537 5, 978, 908, 81 1, 135, 925, 84 3, 227, 169, 168, 83 3, 026, 780, 282, 15 200, 388, 906, 20	

会计主体:富兰克林国海弹性市值混合型证券投资基金本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30 日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	- 366, 454, 501.84	516, 194, 624.97
1.利息收入	4, 383, 738.08	2, 693, 484.75
其中:存款利息收入	1, 128, 884.52	980, 234.77
债券利息收入	2, 189, 719.18	1, 341, 419.48
资产支持证券利息收入		
买人返售金融资产收入	1, 065, 134.38	371, 830.50
其他利息收入		
2.投资收益(损失以" - "填列)	78, 681, 822.14	283, 099, 504.96
其中:股票投资收益	49, 030, 764.30	258, 658, 570.56
基金投资收益		
债券投资收益	2, 505, 650.71	613, 125.37
资产支持证券投资收益		
贵金属投资收益		
衍生工具收益		
股利收益	27, 145, 407.13	23, 827, 809.03
3.公允价值变动收益(损失以"。"号填列)	- 450, 325, 451.19	228, 867, 922.21
4.汇兑收益(损失以"。"号填列)		
5.其他收入(损失以" - "号填列)	805, 389.13	1, 533, 713.05
减:二、费用	35, 929, 516.24	33, 167, 944.83
1. 管理人报酬	25, 409, 219.81	20, 237, 321.56
2. 托管费	4, 234, 869.94	3, 372, 886.90
3. 销售服务费		
4. 交易费用	6, 009, 305.55	9, 281, 469.25
5. 利息支出		
其中:卖出回购金融资产支出		
6. 税金及附加	57.99	
7. 其他费用	276, 062.95	276, 267.14
三、利润总额(亏损总额以*。*号填列)	- 402, 384, 018.08	483, 026, 680.10
减:所得税费用		
四、净利润(净亏损以"。"号填列)	- 402, 384, 018.08	483, 026, 680.10

会计主体:富兰克林国海弹性市值混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

2, 536, 645, 797,49

(肚)			
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数 本期利润)		- 402, 384, 018.08	- 402, 384, 018.08
三、本期基金份額交易产生的 基金净值变动数 (净值减少以"-"号填 列)	761, 686, 698.89	145, 920, 93822	907, 607, 637.11
其中:1.基金申购款	1, 274, 227, 399.74	275, 601, 085.30	1, 549, 828, 485.04
2.基金赎回款	- 512, 540, 700.85	- 129, 680, 147.08	- 642, 220, 847.93
四、本期向基金份額持有人分 配利润产生的基金净值变动 净值减少以"-"号填列)		- 196, 953, 578.48	- 196, 953, 578.48
五、期末所有者权益(基金净值)	3, 298, 332, 496.38	249, 227, 029.38	3, 547, 559, 525.76
項目	2017		
	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)	2, 066, 414, 277.66	217, 201, 110.49	2, 283, 615, 388.15
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数(本期利润)		483, 026, 680.10	483, 026, 680.10
三、本期基金份額交易产生的 基金净值变动数 (净值减少以"号填 列)	2, 488, 782, 21328	594, 670, 299.46	3, 083, 452, 512.74
其中:1.基金申购款	3, 452, 628, 327.25	764, 725, 955.72	4, 217, 354, 282.97
2.基金赎回款	- 963, 846, 113.97	- 170, 055, 65626	- 1, 133, 901, 770.23
四、本期向基金份額持有人分 配利润产生的基金净值变动 净值减少以。"号填列)		- 835, 384, 816.08	- 835, 384, 816.08
五、期末所有者权益(基金净值)	4, 555, 196, 490.94	459, 513, 273.97	5, 014, 709, 764.91

本期 2018年1月1日至2018年6月30日

702, 643, 687.72

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;

6.4.1 基金基本情况

6.41 基金基本情况 第二支林国海灣性市值混合型证券投资基金 (原名为富兰克林国海灣性市值股票型证券投资基金。以下商除"本基金"处于国证券业金等(2006 第57号(光于同意富兰之林国海灣性市值股票型证券投资基金赛集的批复)核准。由国海富兰克 株基金管爾有提公司报威(中华人民共和国证券投资基金等)基金等、股份股 J核准。由国海富兰克 株基金管爾有提公司报威(中华人民共和国证券投资基金等)或一次有"政党"或是实现。 非投资基金基金合同为而公开基集。本基金为契约型开放式,存储期限不定; 首次设立募集不包 括从购资金相主募集人民币。2912;4507818.0元。业经普华人市产业;首次设立募集不包 每次第一次第一次第一次第一次第一次第一次第一次第一次第一次第一次第一次第一次 等来道中于整字(2006)第766号数据报告于比较证。然如中国证监会备案、《富兰总株国海灣性市值 股票型证券投资基金基金合同》于2006年8月114日正式生效,基金合同生及目的基金份额总额 为2,912,981,452.28 份基金份额,其中从购货金利息折合830,6704 份还金份额。本基金的基金 管理人为国海富兰克林基金管理有股公司,选金社管人为中国农业银行股份有限公司。 根据2014年中国证监会会身"10.5年公开赛基础,是投资基金管理为办方。33 兰克林国海 弹性市位股票型证券投资基金于2015年8月8日公告后更名为富兰克林国海弹性市值混合型证券投资基金

等投资基金。 相超代中华人民共和国证券投资基金进入和(富兰克林国海弹性市值混合型证券投资基金基金 合同的商关规定。本基金的投资范围为国内依法公子安产的股票。债券以及中国证监会允许基金 投资的其他金融工具。本基金投资组合的范围为、股票投资基金资产的 60%-60%。 债券 是会至 资产以及中国证监会允许基金投资的基础证券品种为基金资产的 5%-40%,其中,基金保留的现金 以及投资于一年期以内的政场储务的比例会计下层下基金资产的 5%-40%,其中,基金保留的现金 更要集中于具有良好品质并具有良好或长性的上市公司,辅助投资于资产价值被抵价的上市公司。 具有或长年取货产价值被抵价的上市公司的投资比较等不低于本金を影离资产的00%。本基金的 业绩比较基准为,70%×MSCI中国 A 股指数+25%×中国国债总指数(全价)+5%×同业在款利

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 2018 年 8 月 25 日批

権权出。 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 2066 年 2 月 15 日及以后期间颁布的(企业会计准则一基本 に第一条 15 日本 1

页磁金融运行的对比较级的可以表明上 0.44 用为小约中凹面面显变,中国磁金型的宏观中的有关规定 及允许的基金行业完全操作编辑。 本结务报表以特殊还是为基础编制。 6.43 薄暗点金计传廊段及其他有关规定的声明 本基金本报告前即联务报表符合企业会计值制的要求,真实。完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务及代以及 2018 年 1 月 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的监管成果和基金价值变

月30 日前與各状配以及2018年 月 月 日至2018年 6 月 30 日止期间则经营成果和 动情况等有关作息。 6.4.4 本报告期所采用的会计改策。会计估计与最近一期年度报告相一致的说明 本报生期所采用的会计改策。会计估计与最近一期年度报告相一致。 6.4.6 会计政策契重的说明 本基金本报告期未发生会计故策变更。 6.4.5.1 会计改策变更的说明 本基金本报告期未发生会计故策变更。 6.4.5.2 会计估计变更的说明 本基金本报告期上的说明 本基金本在专用品类发生会计估计变更。 6.4.6.3 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。

相關財政部、国家税务包贴财税 [2008]1 号《关于企业所得税者干优重资策的通知》,财税 [2012]85 号(关于实施上市公司股鱼丝利差别化个人所得税政策有关问题的通知),财税 [2015]101 号(关于上市公司股金任利差别化个人所得税政策有关问题的通知),财税 [2015]101 号(关于进一步) 电力量 (表达 [2015]46 号(关于进一步) 电对路电路 (表达 [2015]46 号(关于进一步) 明确企而指于营业增加 (表达 [2016]46 号(关于明确金施制产) 财税 [2017]101 号(关于明确金施制产) 财税 [2017]101 号(关于明确金施制产于发放销的服务等增组税政策的通知),财税 [2017]20 号(关于强备处于明确金施制产于发放销的服务等增值税政策的通知),财税 [2017]50 号(关于明确金施制产分 (表达 [2017]20 号(关于现金产)101 第20 号(表达 [2017]20 号(表达 [2017]20

收育费附加。 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

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 基金托管人、基金销售机构

国商业股股的保险(《国商业》) 国高省宣总核资管徵 上海 有限公司 注下逐类聚交易均在正常业务范围内按一股商业条款订立 6.4.8 非社类联方交易率元进行的交易 6.4.8.1 通过类联方交易率元进行的交易 6.4.8.1 11 股票交易 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 2018年1月1日至2018年6月30日

成交金額 成交金額 37, 581, 337.84 6.4.8.1.2 权 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。 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期佣金总量的比 例 2017年1月1日至2017年6月30日 关联方名称

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 官股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

上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 頂目 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 25, 409, 219,81 20, 237, 321.56 7 注:支付基金管理人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 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 6.4.8.2.2 基金托管费

本期 2018年1月1日至2018年6月30日 2017年1月1日至2017年6月30日 4, 234, 869.94 3, 372, 886.92 注;支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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 × 0.25%/当年天 6.4.8.3 与美联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 本基金本报告期內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

单位:人民币元

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

75.0	本期	上年度可比期间	
项目	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日	
基金合同生效日(2006年6月14日)持有的基金份额			
期初持有的基金份額	26, 542, 566.25	22, 402, 317.82	
期间申购 / 买入总份额	1, 378, 954.00		
期间因拆分变动份额			
滅:期间赎回/卖出总份額			
期末持有的基金份額	27, 921, 520.25	22, 402, 317.82	
期末持有的基金份額 占基金总份額比例	0.85%	0.49%	

注: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 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

	本期末 2018年 6 月 30 日		上年度末 2017年 12 月 31 日		
关联方名称	持有的 基金份額	持有的基金 份額 占基金总份 額的比例	持有的 基金份額	持有的基金份 額 占基金总份額 的比例	
国海富兰克林资产管理 (上海)有限公司	8, 497, 030.09	0.26%	8, 077, 389.13	0.329	
国海证券股份有限公司					
邓普顿国际股份有限公司 (Templeton International, Inc.)					
中国农业银行股份有限公司					

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

关联方 名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比 2017年1月1日至20	
40.00	期末余額	当期利息收入	期末余額	当期利息收入
中国农业银 行	238, 227, 265.37	1, 024, 785.28	250, 810, 892.03	845, 8572
注, 本基	金的银行存款由基	金托管人中国农业组	B行保管,按银行同业利率	区计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期內及上年度可比期间未在承销期內参与关联 6.4.8.7 其他关联交易事项的证明 本基金本报告期內及上年度可比期间无其他关联交易事项。 6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券 64.12.1.1 受限证券类别,股票

单位:人民币元

3, 239, 289, 485,21

证券 代码	证券名称	成功 认购日	可流通日	流通 受型 类型	认购 价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末 成本总額	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018年 6月25 日	2018 年 7 月 3 日	新未市	9.00	9.00	5, 384	48, 456.00	48, 456.00	
603706	东方环宇	2018年 6月29 日	2018 年 7 月 9 日	新未市	13.09	13.09	1, 765	23, 103.85	23, 103.85	
603105	芯能科技	2018年 6月29 日	2018 年 7 月 9 日	新未市	4.83	4.83	3, 410	16, 470.30	16, 470.30	-
002892	科力尔	2017年 8月10 日	2018 年 8 月 17 日	首原东售份 发股限股	17.56	29.90	11,000	193, 160.00	328, 900.00	
603156	养元饮品	2018年 2月2 日	2019 年 2 月 12 日	首原东售份 发股限股	78.73	54.86	37, 717	2, 969, 459.41	2, 069, 154.62	
603156	养元饮品	2018年 2月2 日	2019 年 2 月 12 日	首原东售份 发股限股	-	54.86	15, 087	-	827, 672.82	
300713	英可瑞	2017年 10 月 23日	2018 年 11 月 1	首原东售份	40.29	39.07	7,008	282, 352.32	273, 802.56	
300713	英可瑞	2017年 10 月 23日	2018 年 11 月 1	首原东售份		39.07	5, 606		219, 026.42	

自自发行	结织	東之日	起 12	定投资 个月内 暂时停	不得	特让。		票时公司股东公司	干发售股份,所认 金额单位:人	
股票代码	股票名称	停牌 日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量(股)	期末 成本总額	期末估值总额	备注
000426	兴业矿业	2018 年 6 月 19 日	重大资产重组停牌	6.89		-	20, 775, 259	188, 200, 600.03	143, 141, 534.51	
002739	万达电影	2017 年 7 月 4 日	重大资产重组停牌	38.03		-	500,000	26, 092, 670.94	19, 015, 000.00	-

推,本基金数至2018年06月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂 时停阱的股票,该党股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。 6.49.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券 本基金本报告期来无以申债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。 6.4.10 有助于理解和分析会计根表需要说明的其他事项 (1)公会的作

公允价值计量柱离环属的层次,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裁贬之效定; 第一层次,相同资产或负偿在活跃市场上来管理整的报价。 第二层次,格斯·思次体验,他外科关资产效,价值发统或间接可观察的输入值。 第三层次,格斯·克尔·战场外科关资产或负值复统或间接可观察的输入值。 第三层次,相关资产或负值的不可观察输入值。 (均转体的以公允价值计量的全融工具 ()各层次金融工具公允价值 ()各层次金融工具公允价值 ()各层次金融工具公允价值 ()各层次金融工具公允价值 ()等层次金融工具公允价值 ()等层次金融工具公允价值 ()等层次金融工具公允价值 ()等层次金融工具公允价值 ()等层次金融工具公允价值 ()等层次的余额分。2661,266,047.27元。属于第二层次的余额为 365,393,121,08 元元,无属于第三层次的余额分。 ()第二层次的余额分。 ()第二层次分允价值的影响程度,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。 (面)第三层次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。 (面)第三层次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。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具 于 2018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(2017年 12月 31

日:同)。 (d)不以公允价值计量的金融工具 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账而价值与公允 个位在形態的。 价值相繁複為。 (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 金額 3, 026, 780, 262 3, 026, 780, 262.15 200, 388, 906.20 99, 800, 249.9 244, 206, 174.18

3, 578, 368, 277.29

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

17.03	行业央别	22元年間(元)	白岛亚页广伊旧瓦列(76)
Α	农、林、牧、渔业		
В	采矿业	143, 141, 534.51	4.0
С	制造业	1, 510, 778, 869.74	42.5
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71, 559.85	0.0
Е	建筑业		
F	批发和零售业		
G	交通运输、仓储和邮政业		
Н	住宿和餐饮业		
1	信息传输、软件和信息技术服务业	56, 388, 888.60	1.5
J	金融业	1, 143, 388, 198.31	32.2
K	房地产业	40, 939, 845.00	1.1
L	租赁和商务服务业	112, 975, 140.00	3.1
М	科学研究和技术服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	81, 226.14	0.0
0	居民服务、修理和其他服务业		
Р	教育		
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业	19, 015, 000.00	0.5
S	综合		
	合计	3, 026, 780, 262.15	85.3

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	
601966	玲珑轮胎	16, 090, 742	253, 751, 001.34	7.15
601009	南京银行	31, 975, 046	247, 167, 105.58	6.97
601166	兴业银行	15, 654, 541	225, 425, 390.40	6.35
600036	招商银行	8, 107, 176	214, 353, 733.44	6.04
601398	工商银行	33, 564, 196	178, 561, 522.72	5.03
000426	兴业矿业	20, 775, 259	143, 141, 534.51	4.03
000001	平安银行	15, 430, 571	140, 263, 890.39	3.95
600741	华城汽车	5, 760, 583	136, 641, 028.76	3.85
601888	中国国族	1, 754, 000	112, 975, 140.00	3.18
300003	乐普医疗	2, 914, 569	106, 906, 390.92	3.01
600104	上汽集团	2, 900, 902	101, 502, 560.98	2.86
601012	隆基股份	5, 661, 641	94, 492, 788.29	2.66
000858	五粮液	1, 186, 115	90, 144, 740.00	2.54
600887	伊利股份	2, 905, 299	81, 057, 842.10	2.28
300357	我武生物	1, 906, 016	75, 992, 857.92	2.14
000651	格力电器	1, 500, 000	70, 725, 000.00	1.99
002308	威创股份	8, 043, 489	66, 760, 958.70	1.88
002583	海能达	7, 779, 155	64, 955, 944.25	1.83
002470	金正大	8, 345, 412	57, 416, 434.56	1.62
600406	国电南瑙	3, 568, 917	56, 388, 888.60	1.59
600585	海螺水泥	1, 639, 700	54, 897, 156.00	1.55
601939	建设银行	6, 997, 812	45, 835, 668.60	1.29
000000	46.10.00.00	700 000	11 000 000 01	1.10

40, 939, 845.00

81, 226.14

50, 988 96

23, 103.85

99.80

3, 355, 725 2, 676, 952 609, 192 37, 075, 425.1 9, 644, 60 34, 817, 00 9, 219, 800 33, 744, 468 32, 926, 436 989, 964 31, 371, 959.16 601318 23, 219, 413.1 19, 015, 000 7, 719, 651 500, 000 35 60076 36 603156 37 600276 52, 804 2, 896, 827.44 37 600276 38 300713 492, 828.91 38 300713 39 002892 40 002859 41 600584 42 300747 43 601330 44 603650 45 603893 46 603706 47 603105 48 603897 49 002931 11, 000 328, 900.0 325, 816. 182, 155.82

2.376

金额单位:人民币元

列示、放析注为"0.00"。 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 7.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号 股票代码		股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601966	玲珑轮胎	284, 271, 378.71	8.78
2	601009	南京银行	272, 705, 840.64	8.42
3	601398	工商银行	132, 028, 192.72	4.08
4	000858	五粮液	116, 605, 567.38	3.60
5	601318	中国平安	105, 898, 731.50	3.27
6	601888	中国国族	98, 044, 662.82	3.03
7	601818	光大银行	95, 640, 000.00	2.95
8	601012	隆基股份	95, 412, 985.76	2.95
9	002470	金正大	92, 501, 528.44	2.86
10	600887	伊利股份	87, 245, 403.31	2.69
11	601166	兴业银行	83, 846, 903.37	2.59
12	600036	招商银行	79, 319, 874.92	2.45
13	000651	格力电器	74, 603, 772.68	2.30
14	000333	美的集团	74, 521, 687.10	2.30
15	600585	海螺水泥	68, 782, 722.91	2.12
16	600406	国电南瑞	68, 415, 171.89	2.11
17	000426	兴业矿业	67, 436, 455.82	2.08
18	601058	赛轮金宇	65, 466, 278.77	2.02
19	601939	建设银行	52, 896, 816.49	1.63
0.0		-1-10000 01		

800019 宝钢鼓份 48,690,74300 买人金额按买人成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关实 7.4.2 累计卖出金额租出期初基金资产净值,2%;市市 20 全的即用时间

7.4.7	2 系计买出金	· 額超出期初點並實产	·净值 2%或削 20 名的股票明细	金额单位:人民币
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	002488	金固股份	154, 873, 318.67	4.78
2	002308	威创股份	151, 302, 247.99	4.67
3	002530	金财互联	143, 374, 052.84	4.43
4	601318	中国平安	132, 098, 154.30	4.08
5	000426	兴业矿业	97, 683, 032.38	3.02
6	600048	保利地产	86, 489, 517.95	2.67
7	601169	北京银行	73, 513, 264.85	2.27
8	600584	长电科技	68, 412, 159.00	2.1
9	600036	招商银行	61, 915, 862.14	1.9
10	000333	美的集团	59, 811, 208.19	1.85
11	601058	赛轮金宇	59, 175, 646.01	1.83
12	002142	宁波银行	58, 350, 094.09	1.80
13	002583	海能达	57, 061, 938.09	1.76
14	600690	青岛海尔	54, 992, 156.17	1.70
15	300232	洲明科技	51, 956, 137.92	1.60
16	601818	光大银行	49, 250, 648.00	1.52
17	601166	兴业银行	49, 223, 622.00	1.52
18	600019	宝钢股份	44, 094, 491.72	1.36
19	601398	工商银行	44, 032, 842.00	1.36
		1		

20 002415 高康威론 41,205,171.74 注:卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑料 7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额 20 002415 海康威视 41, 205, 171,74

1, 896, 929, 621.17

卖出股票收入 成交) 总额 1,896,929,621.17 注:"买人股票成本总额"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 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

3	金融债券			199, 940, 000.00		5.64	
	其中:政策性金融修	t		199, 940, 000.00	5.		
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)			448, 906.20	0.0		
8	同业存单						
9	其他						
10	合计			200, 388, 906.20	5.63		
7.6	期末按公允价值	[占基金资产	净值比例大小	非序的前五名债务		金額单位:人民币	
 		结治力品	料据(22)	0.4464	t	占基金资产净值比例	

1,000,000

1, 000, 000

100, 010, 000,00

113019 玲珑转惯 4,380 448,90620 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 本基金本限召朝来来持有资产支持证券。 7.5 报告期末按公允价值占基金财产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 根据金金何年,表金不投资资金。 7.5 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 本基金来降的期末未持有证。

根据基金台间, 本基金不投資股捐明資。 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 根据基金台同,本基金不投资国债期货。

706, 546.73 562, 272.73

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

1 000426 兴业矿业 143,141,534.51 重大资产重组停牌 § 8 基金份8 8.1 期末基金份額持有人户数及持有人结构

7, 192, 684.86

份额单位:位

持有人户数(户)	户均持有的基金	机构投资	f	个人投资者			
,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	份額	持有份額 占总份額比 例			持有份額	占总份額比 例	
60, 901	54, 158.92	1, 793, 676, 405.0	7 54.38%		1, 504, 656, 091.31	45.62%	
8.2 期末基	金管理人的从	比人员持有本基金的	情况	•			
I)		持有份額总数(份)			占基金总份額	七例	
基金管理人所有, 金	从业人员持有本基		917, 9	38.01		0.027830%	
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:	量区的	目的情况		
	76 (2)		Life of the A. A. A. A. A. A. B. H. A. A. B. H. C. A. A. A. T. A. A.				

基金合同生效日(2006年6月14日)基金份额总额 2 912 981 452 28 本报告期基金总申购份额 1, 274, 227, 399.74 512, 540, 700.85 报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) 本报告期期末基金份额总额 3, 298, 332, 496,38

10.1 基金份额持有人大会决议

公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责 本开放式基金

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

10.2 加速管理人、加速代管人的专门加速化管部门了 一基管理用是长人界变动 本用帝明本基金基金管理人无意大人事变动。 本用帝明本基位基金经管用人直发人事变动。 本限帝国基金经管人的专门盈金经管间下走发人事变动。 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的订

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 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为普华水道中天会计师事务所,未曾改聘其他 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;本报告期內,基金管理人及其高级管理人员及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 一, 虽显元百八及共同或日廷八页支信员或是同可留记 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5 881, 516, 597.15 644, 647.36 20.12% 716. 061. 063.10 16.34% 666, 868,24 565, 579, 456.19 413, 608.66 494, 097, 733.80 460, 151.3 339, 638, 281.65 248, 376.79 6.67% 210, 058, 104.99 195, 624.15 202 724 401 37 188 795 26 507% 158, 262, 940.60 147, 390.73 32, 682, 950.5 30, 438.85

注,
1. 专用交易单元的选择标准和程序
1.选择代理基金证券买卖的证券经营机构的标准
1.选择代理基金证券买卖的证券经营机构,并租用其交易单元作为基金的专用交易单元人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构,并租用其交易单元作为基金的专用交易等。(2)附分状况良好。经营行分摊范,被近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。(3)内部管理规范,严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求,争交易的需要,具备基金运作所需的高效,安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能放了基金提价。而经由人,是分析的研究人员,能及时、定期。全面地为本基金提代金的信息服务。
(6)研究实力按键,有固定的研究机构和专门研究人员。能及时、定期。全面地为本基金提代金的信息服务。
(2)依当基金是供金的信息服务,可能为任务。用他分析及报金额的研究报告。

2. 提供专题研究报告。 20公司基金支易佣金分配依据券商提供的研究报告和服务质量、评判标准包括但不限于: 0分面及时的公司提供高质量的关于宏观、行业和市场的研究报告; ②具有数量研究和开发能力; ②能查分相归;中心司证据。

※所外以無の水元の人の元分 総能有效程紙上市公司調研。 ④能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告; ⑤上门路演和电话会议的质量; ⑥与収公司投资和研究人员的信息交流和沟通能力;

手续。
②之后,基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况,根据如下选择标准细化的评价体系,每季度对差约证券经营机构的服务进行一次综合评价;
A提供的研究报告质量和数量;
B由基金管理人格组课题,证券经营机构提供的研究论文质量;
C证券经营机构助取及公司研究员调带情况;

C 证券经营机构协助找公司研究员调研情况; D 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况;

显新运绎共已经后稳健、研究能力强、信息版券顺重尚的证券经营机构、租用 ③交易单元租用协议期限为一年,到期后若双方没有异议可自动延期一年 2、报告期内证券公司基金专用交易单元的变更情况

报告期内,本基金交易单元无变更。 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

成交金額 6, 510, 172,6 7, 351.8 25, 490, 916.76 54.559