富兰克林国海新收益灵活配置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:国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
送出日期:2018年8月25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。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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月22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2018年1月1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	国富新收益混合	
基金主代码	002114	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年8月31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	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	94,962,027.13份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国富新收益混合A	国富新收益混合C
下属分级基金的交易代码:	002114	002115
报告期末下属分级基金的份额总额	140,499.31份	94,821,527.82份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置和组合管理,力求实现基金资产的稳健增值。
投资策略	(一)大类资产配置策略 本基金贯彻"自上而下"的资产配置策略,通过对宏观经济、国家/地区政策、证券市场流动性、大类资产相对收益特征等因素的综合分析,在遵守大类资产投资比例限制的前提下进行积极的资产配置,对基金组合中股票、债券、短期金融工具的配置比例进行调整和优化,平衡投资组合的风险与收益。 (二)股票投资策略 本基金将采用"自下而上"精选个股策略,对受益于国家/地区产业政策及经济发展方向的相关上市公司进行深入挖掘,精选具有核心竞争优势和持续成长能力的优质上市公司。主要从行业地位、核心竞争力、盈利能力、公司治理水平、估值水平等五方面对上市公司进行评估。 (三)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,以获取稳健的投资收益。 (四)股票申购策略 本基金将深入研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面,挖掘公司的内在价值,根据当时股票市场整体投资环境及定价水平,一、二级市场间资金供求关系,在有效控制风险的前提下制定相应的股票申购策略。对通过股票申购获得的股票,将根据其实际的投资价值确定持有或卖出。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中债国债总指数收益率(全价)*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金的预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中等风险收益特征的投资品种。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	张志永
	联系电话	021-3855 5555	021-6267 7777-212004
	电子邮箱	service@ftsfund.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680和021-38789555	95561
传真		021-6888 3050	021-6215 9217

2.4 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

基金级别	国富新收益混合A	国富新收益混合C
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)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	9,291.47	8,412,089.56
本期利润	4,053.87	5,406,517.27
加权平均基金份额本期利润	0.0199	0.0268
本期基金份额净值增长率	3.82%	2.14%
3.1.2 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	0.1366	0.1112
期末基金资产净值	159,692.36	105,361,588.01
期末基金份额净值	1.1366	1.1112

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

国富新收益混合A

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	-0.26%	0.14%	-3.57%	0.64%	3.31%	-0.50%
过去三个月	0.00%	0.22%	-4.26%	0.57%	4.26%	-0.35%
过去六个月	3.82%	0.34%	-5.11%	0.57%	8.93%	-0.23%
过去一年	9.84%	0.27%	-1.33%	0.47%	11.17%	-0.20%
自基金合同生效起至今	13.66%	0.21%	1.20%	0.42%	12.46%	-0.21%

国富新收益混合C

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	-0.31%	0.14%	-3.57%	0.64%	3.26%	-0.50%
过去三个月	-0.20%	0.22%	-4.26%	0.57%	4.06%	-0.35%
过去六个月	2.14%	0.32%	-5.11%	0.57%	7.25%	-0.25%
过去一年	7.61%	0.26%	-1.33%	0.47%	8.94%	-0.21%
自基金合同生效起至今	11.12%	0.21%	1.20%	0.42%	9.92%	-0.21%

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2016年8月31日。本基金在6个月建仓期结束时,各项投资比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

本公司具有丰富的管理基金经验。自2005年6月第一只基金成立开始,截至本报告期末,本公司已经成功管理了33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		
吴西燕	公司行业研究主管,国富中国收益混合基金、国富金融地产混合基金、国富新机遇混合基金、国富新增长混合基金、国富新价值混合基金、国富新收益混合基金、国富新活力混合基金、国富新趋势混合基金及国富天颐混合基金的基金经理	2016年8月31日	-	12年	吴西燕女士,上海财经大学硕士,历任中国建设银行深圳分行会计,国海富兰克林基金管理有限公司研究助理、研究员、高级研究员,国富弹性市值混合基金及国富深化价值混合基金的基金经理助理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司行业研究主管,国富中国收益混合基金、国富金融地产混合基金、国富新机遇混合基金、国富新增长混合基金、国富新价值混合基金、国富新收益混合基金、国富新活力混合基金、国富新趋势混合基金及国富天颐混合基金的基金经理。
邓钟锋	国富金融地产混合基金、国富新机遇混合基金、国富新增长混合基金、国富新价值混合基金、国富新收益混合基金、国富新活力混合基金、国富恒丰定期债券基金、国富新趋势混合基金、国富天颐混合基金及国富恒裕6个月定期开放债券基金的基金经理	2016年9月30日	-	11年	邓钟锋先生,厦门大学金融学硕士。历任深圳发展银行北京分行公司产品研发及审查、中信银行厦门分行公司信贷审查、上海新世纪信用评级公司债券分析员、农银汇理基金管理有限公司研究员及国海富兰克林基金管理有限公司投资经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富金融地产混合基金、国富新机遇混合基金、国富新增长混合基金、国富新价值混合基金、国富新收益混合基金、国富新活力混合基金、国富恒丰定期债券基金、国富新趋势混合基金、国富天颐混合基金及国富恒裕6个月定期开放债券基金的基金经理。

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《富兰克林国海新收益灵活配置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

2018年上半年度权益市场走势有所分化,期间沪深300指数下跌12.90%,上证综指下跌13.90%,以成长型公司为代表的创业板指数下跌8.33%。上半年度市场对于经济增长预期开始逐渐弱化,从年初的乐观到逐步转向悲观,并且,随着中美贸易战逐渐升级,大宗商品价格出现较大幅度回落,此前上涨幅度较大的周期和地产板块股票开始调整。此外,由于国内紧信用环境持续,股权质押风险持续暴露,年初由周期蓝筹切换回创业板的投资逻辑开始逆转,小盘股也出现较大幅度下跌。债券市场因贸易战导致的风险偏好下降,人民银行持续降准释放宽松预期的利好刺激,2018年上半年度迎来较大幅上涨。

2018年上半年度本基金的资产配置以债券为主,股票组合主要投资于高分红蓝筹股,债券组合以中长久期信用债为基本配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,本基金A类份额净值为1.1366元,本报告期份额净值上涨3.82%,同期业绩基准下跌5.11%,本基金跑赢业绩基准8.93个百分点。本基金C类份额净值为1.1112元,本报告期份额净值上涨2.14%,同期业绩基准下跌5.11%,本基金跑赢业绩基准7.25个百分点。本基金上半年度权益类行业配置较好,为基金贡献了较多收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计2018年下半年经济增长增速放缓。由于贸易战持续升温,经济增长不确定性加大,大宗商品价格总体将呈现下降态势,市场的风险偏好难以提升,博弈机会减少;考虑到中央对房地产的严厉控制及宏观审慎监管升级,社会融资总量可能继续下滑,经济存在持续回落风险。权益市场的超额收益机会较少,消费行业受益于国内乡村振兴政策,可能存在相对收益。债券市场机会相对明确,由于内外部经济环境均存在较大压力,社会融资总量及M2数据下行趋势暂时难以中止,央行公开市场操作预计将持续偏向宽松。

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,争取未来取得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

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,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

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,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:富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	77,883,427.49	22,180,499.55
结算备付金	127,041.43	288,263.41
存出保证金	31,618.69	17,134.50
交易性金融资产	27,162,245.25	397,889,851.51
其中:股票投资	220,245.25	63,137,579.71
基金投资	-	-
债券投资	26,942,000.00	334,752,271.80
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	-	-
应收利息	774,216.95	5,838,406.06
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	105,978,549.81	426,214,155.03
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31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	-	100,000,000.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	555.35	82,493,229.31
应付管理人报酬	111,485.68	190,046.06
应付托管费	23,889.77	40,724.15
应付销售服务费	47,738.68	81,416.67
应付交易费用	70,514.30	29,027.26
应交税费	2,915.14	-
应付利息	-	97,657.50
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	200,170.52	360,000.18
负债合计	457,269.44	183,292,101.13
所有者权益:		
实收基金	94,962,027.13	223,293,401.64
未分配利润	10,559,253.24	19,628,652.26
所有者权益合计	105,521,280.37	242,922,053.90
负债和所有者权益总计	105,978,549.81	426,214,155.03

注:报告截止日2018年6月30日,国富新收益混合A基金份额净值1.1366元,基金份额总额140,499.31份;国富新收益混合C基金份额净值1.1112元,基金份额总额94,821,527.82份。国富新收益混合份额总额合计为94,962,027.13份。

6.2 利润表

会计主体:富兰克林国海新收益灵活配置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

单位:人民币元

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	7,275,139.05	18,173,080.19
1.利息收入	2,785,149.58	10,623,625.95
其中:存款利息收入	507,475.30	302,115.93
债券利息收入	2,277,674.28	10,279,589.53
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	41,920.49
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	7,495,450.86	8,829,598.32
其中:股票投资收益	10,468,158.70	10,677,185.35
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,571,519.20	-1,847,587.03
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	598,811.36	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-3,010,809.89	-1,299,406.80
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	5,348.50	19,262.72
减:二、费用	1,864,567.91	4,422,967.95
1.管理人报酬	791,144.62	1,938,064.02
2.托管费	169,530.96	415,299.43
3.销售服务费	338,702.48	802,892.02
4.交易费用	271,352.58	388,229.36
5.利息支出	101,824.30	672,695.14
其中:卖出回购金融资产支出	101,824.30	672,695.14
6.税金及附加	8,136.29	-
7.其他费用	183,876.68	205,787.98
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	5,410,571.14	13,750,112.24
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	5,410,571.14	13,750,112.24

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富兰克林国海新收益灵活配置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

单位:人民币元

项目	本期 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)	223,293,401.64	19,628,652.26	242,922,053.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,410,571.14	5,410,571.14
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)	-128,331,374.51	-14,479,970.16	-142,811,344.67
其中:1.基金申购款	1,126,701.57	149,293.19	1,275,994.76
2.基金赎回款	-129,458,076.08	-14,629,263.35	-144,087,339.43
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)	94,962,027.13	10,559,253.24	105,521,280.37

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	484,395,049.40	2,547,696.09	486,942,745.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,750,112.24	13,750,112.24
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)	-92,886,104.57	-3,536,287.97	-96,422,392.54
其中:1.基金申购款	222,654,493.28	2,473,363.90	225,127,857.18
2.基金赎回款	-315,540,597.85	-6,009,651.87	-321,550,249.72
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)	391,508,944.83	12,761,520.36	404,270,465.19

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 胡昕彦 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

富兰克林国海新收益灵活配置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[2015]1587号《关于准予富兰克林国海新收益灵活配置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《富兰克林国海新收益灵活配置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,首次募集期间为2016年8月29日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集424,250,591.66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(2016)第1151号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年8月31日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为424,250,591.66份基金份额,其中无认购资金利息折合的基金份额。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")。

根据《富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海新收益灵活配置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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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、证券公司短期公司债券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、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)、货币市场工具、权证、资产支持证券、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)。本基金股票占基金资产的比例为0%-95%;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,现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率X50%+中债国债总指数收益率(全价)X50%。

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》、《富兰克林国海新收益灵活配置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。

根据《富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于2018年8月18日和8月23日发布的《国海富兰克林基金管理有限公司关于富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第一次提示性公告》和《国海富兰克林基金管理有限公司关于富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第二次提示性公告》,本基金可能触发基金合同终止情形,详情参见附注6.4.8.2资产负债表日后事项,因此本基金财务报表以非持续经营基础编制。于2018年6月30日,所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量,负债以预计需要清偿的金额计量。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年6月30日止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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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的说明

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、桂财综[2011]13号《关于调整我区地方教育附加征收标准有关问题的通知》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。

(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)本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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

无

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
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	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。

6.4.8 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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	155,093,480.66	100.00%	258,699,940.80	100.00%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	144,439.03	100.00%	70,514.30	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	240,863.16	100.00%	154,665.58	100.00%

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。

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	791,144.62	1,938,064.02
其中:支付销售机构的客户维护费	872.23	1,646.65

注:支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.70%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 0.70%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

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
当期发生的基金应支付的托管费	169,530.96	415,299.43

注:支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%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 0.15%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富新收益混合A	国富新收益混合C	合计
国海富兰克林基金管理有限公司	-	337,789.61	337,789.61
国海证券	-	597.62	597.62
合计	-	338,387.23	338,387.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富新收益混合A	国富新收益混合C	合计
国海富兰克林基金管理有限公司	-	802,673.34	802,673.34
国海证券	-	1.81	1.81
合计	-	802,675.15	802,675.15

注:支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.3%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给国海富兰克林基金管理有限公司,再由国海富兰克林基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日基金销售服务费=前一日C类基金份额对应的资产净值×0.3%/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

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 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.本报告期和上年度可比期间(2017年1月1日至2017年6月30日)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.本报告期末和上年度末(2017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。

6.4.8.5 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	77,883,427.49	502,173.99	10,587,459.25	270,963.59

注:本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管,按银行同业利率计提。

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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.9 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

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
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股未上市	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	新股未上市	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	新股未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 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

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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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2018年06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132,215.10元,属于第二层次的余额为27,030,030.15元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次63,100,683.26元,第二层次334,789,168.25元,无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018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(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	220,245.25	0.21
	其中:股票	220,245.25	0.21
2	固定收益投资	26,942,000.00	25.42
	其中:债券	26,942,000.00	25.42
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	78,010,468.92	73.61
7	其他各项资产	805,835.64	0.76
8	合计	105,978,549.81	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	67,459.26	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.07
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	-	-
J	金融业	-	-
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	81,226.14	0.08
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	220,245.25	0.21

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未通过港股通交易机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.08
2	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.05
3	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.05
4	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.02
5	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	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	601818	光大银行	19,446,788.00	8.01
2	601288	农业银行	10,345,555.00	4.26
3	601328	交通银行	6,997,483.00	2.88
4	601988	中国银行	4,471,503.00	1.84
5	601939	建设银行	3,245,967.00	1.34
6	603156	养元饮品	166,828.87	0.07
7	600901	江苏租赁	155,843.75	0.06
8	601828	美凯龙	104,233.47	0.04
9	603259	药明康德	102,405.60	0.04
10	601066	中信建投	101,299.80	0.04
11	601838	成都银行	89,465.01	0.04
12	603587	地素时尚	57,709.44	0.02
13	603693	江苏新能	48,456.00	0.02
14	603680	今创集团	47,171.67	0.02
15	601990	南京证券	38,771.70	0.02
16	603348	文灿股份	30,687.86	0.01
17	603013	亚普股份	30,026.91	0.01
18	603650	彤程新材	29,272.32	0.01
19	603897	长城科技	28,167.70	0.01
20	603596	伯特利	23,133.20	0.01

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	600048	保利地产	28,619,292.62	11.78
2	601988	中国银行	20,939,938.97	8.62
3	601328	交通银行	19,151,848.89	7.88
4	601818	光大银行	18,872,570.98	7.77
5	601288	农业银行	16,640,956.48	6.85
6	601939	建设银行	3,161,779.00	1.30
7	603259	药明康德	597,940.23	0.25
8	600901	江苏租赁	261,817.50	0.11
9	601828	美凯龙	237,494.59	0.10
10	603156	养元饮品	220,376.00	0.09
11	601066	中信建投	207,459.00	0.09
12	601838	成都银行	197,232.59	0.08
13	603712	七一二	104,147.80	0.04
14	603056	德邦股份	103,608.54	0.04
15	603013	亚普股份	101,967.99	0.04
16	601990	南京证券	99,026.40	0.04
17	603587	地素时尚	93,735.90	0.04
18	600929	湖南盐业	93,300.48	0.04
19	603348	文灿股份	82,933.64	0.03
20	603301	振德医疗	78,915.98	0.03

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	45,767,135.77
卖出股票收入(成交)总额	110,586,184.66

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	26,942,000.00	25.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,942,000.00	25.53

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	1680473	16西秀债	200,000	18,342,000.00	17.38
2	1680382	16永专债01	100,000	8,600,000.00	8.15

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	31,618.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	774,216.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	805,835.64

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

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	603693	江苏新能	48,456.00	0.05	新股未上市
2	603706	东方环宇	23,103.85	0.02	新股未上市
3	603105	芯能科技	16,470.30	0.02	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
国富新收益混合A	48	2,927.07	-	-	140,499.31	100.00%
国富新收益混合C	133	712,943.82	94,376,697.41	99.53%	444,830.41	0.47%
合计	181	524,652.08	94,376,697.41	99.38%	585,329.72	0.62%

8.2 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	国富新收益混合A	288.98	0.205681%
	国富新收益混合C	2,510.00	0.002647%
	合计	2,798.98	0.002947%

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	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	国富新收益混合A	0
	国富新收益混合C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国富新收益混合A	0
	国富新收益混合C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国富新收益混合A	国富新收益混合C
基金合同生效日(2016年8月31日)基金份额总额	1,491.66	424,249,100.00
本报告期期初基金份额总额	115,047.71	223,178,353.93
本报告期基金总申购份额	520,656.36	606,045.21
减:本报告期基金总赎回份额	495,204.76	128,962,871.32
本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	140,499.31	94,821,527.82

§ 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

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

期后事项说明:

经公司决定,吴西燕不再担任富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,由共同管理上述基金的基金经理邓钟锋单独管理。公司已办理完成上述基金经理的变更手续,并于2018年8月10日进行了公告。

(二)基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

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形

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形。

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	155,093,480.66	100.00%	144,439.03	100.00%	-

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

基金管理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单元。选择的标准是:

①资历雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币;

②财务状况良好,经营行为规范,最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;

④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,并能为本基金提供全面的信息服务;

⑤研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的特定要求,提供专题研究报告。

2)公司基金交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:

①全面及时向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;

③能有效组织上市公司调研;

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与我公司投资和研究人员的信息交流和沟通能力;

⑦其他与投资相关的服务和支持。

3)租用基金专用交易单元的程序

①基金管理人根据上述标准考察证券经营机构,考察结果经公司领导审批后,我司与被选中的证券经营机构签订《券商交易单元租用协议》和《研究服务协议》,并办理基金专用交易单元租用手续。

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,每季度对签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由基金管理人提出课题,证券经营机构提供的研究论文质量;

C证券经营机构协助我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;

E其他可评价的量化标准。

经过评价,对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留,并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。若本公司认为签约机构的服务不能满足要求,或签约机构违规受到国家有关部门的处罚,本公司有权终止签署的协议,并撤销租用的交易单元;基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构,租用其交易单元。

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

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	195,635,692.88	100.00%	262,000,000.00	100.00%	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年4月23日至2018年6月30日	40,000,000.00	-	20,000,000.00	20,000,000.00	21.06%
	2	2018年1月1日至2018年6月30日	50,000,000.00	-	25,000,000.00	25,000,000.00	26.33%
	3	2018年1月1日至2018年6月30日	49,309,664.69	-	25,000,000.00	24,309,664.69	25.60%
产品特有风险							
1.流动性风险 投资者大额赎回所持有的基金份额时,为了实现基金资产的迅速变现,在基金交易过程中可能存在无法实现交易价格最优;亦或导致基金仓位调整困难,基金资产不能迅速转变成现金,产生流动性风险。 一旦引发巨额赎回,当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难,或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时,可能出现比例赎回、延期支付赎回款等情形。 管理人有权根据本基金合同和招募说明书的约定,基于投资者保护原则,暂停或拒绝申购、暂停赎回。 2.估值风险 投资者大额赎回所持有的基金份额时,基金份额净值可能受到尾差和部分赎回费归入基金资产的影响,从而导致非市场因素的净值异常波动。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司分别于2018年8月18日和8月23日发布的《国海富兰克林基金管理有限公司关于富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第一次提示性公告》和《国海富兰克林基金管理有限公司关于富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第二次提示性公告》,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》本基金可能触发基金合同终止情形。根据《富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》"第五部分 基金备案"中"三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模"的约定《富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止,无需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。"

若截至2018年8月28日日终,富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人数量不满200人,即本基金已连续60个工作日基金份额持有人数量不满200人。根据基金合同约定,本基金管理人将按照基金合同的约定履行基金财产清算程序后终止基金合同,且无需召开基金份额持有人大会审议。

国海富兰克林基金管理有限公司

2018年8月25日