富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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:2019年8月28日

1.1 重要提示

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、误导性陈述或重九遗漏,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一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2019年8月26日复核了本报告中的财务指标。净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容、保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证

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

基金的过生业绩并不代表真未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前 应行细阅读本基金的招募说明书及其更新。 本报告中财务资料未经审计。 本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。 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 度报告正父

KIII III XV	
	§ 2 基金简介
2.1 基金基本情况	
基金简称	国富沪深300指数增强
基金主代码	450008
交易代码	450008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9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	154,947,043.54 ()
基金合同存续期	不定期
2.2 基金产品说明	
投資目标	本基金采用指数增强投资策略。通过量化风险管理方法,控制 基金投资组合与标识指数构成的偏差。同时结合主动投资方 法,在严格控制跟踪偏离风险的基础上,力争获得超越业绩比 较基准标识投资收益,追求基金资产的长期增值,在正常市场

报告期末基金份额总额	154,947,043.54	69
基金合同存续期	不定期	
2.2 基金产品说明		
投资目标	基金投资组合与标法,在严格控制师 较基准标的投资	曾强投资策略。通过量化风险管理方法,控制 示的指数构成的偏差,同时结合主动投资方 紧缩腐风险的基础上,力争获得超越业绩计 及益,追求基金资产的长期增值,在正常市场 业绩比较基准的年跟踪误差不超过8%。
投換物格	股票的第三步号字 经国际	級代別或予生、以最小化關語說數为則自營 基金所報節的目光時數分率從300時 數化稅等的基金上軸以有與實的等級辦 級化稅等的基金上軸以有與實的等級辦 於約40歲取價,并轉數數量化稅實分所沒 從股票租分。 是一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個
业绩比较基准	95% × 沪深300	指数 + 5% × 银行同业存款利率
风险收益特征	的证券投资基金。	效增强型基金,属于较高风险、较高预期收益
2.3 基金管理人和基金技	壬管人	
项目	基金管理人	基金托管人

名称		可	兒林基並官埋有限公	中国农业银行股份有限公司	
	姓名 储丽和			贺倩	
信息披露负责人	联系电话	021-3858	5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5	010-6606 0069	
	电子邮箱	service@t	ftsfund.com	tgxxpl@ahchina.com	
		400-700- 021-387	-4518、9510-5680和 89555	95599	
伯真		021-6888 3050		010-6812 1816	
2.4 信息披露	疗式				
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	指标和基金净色	值表现	
3.1 主要会计	数据和财务	指标			
				金额单位:人民	
9 1 1 MII/GIRW/#FEITH	HG.		10.45.HE/20.10	der Br = 2010(Ee B20 =)	

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	
本期已实现收益	10,656,290.37	
本期利润	35,708,872.64	
加权平均基金份额本期利润	0.2361	
本期基金份额净值增长率	27.94	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1082	
期末基金资产净值	171,712,091.68	
期末基金份額净值	1.108	

编报规则 – 第1号《主要财务指标的计算及披露》。 ##IXの契例 - 邦1で5 土安別の月前がDIT昇及股路 》。 2. 本期已変現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 河收益。 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

实现部分的现在例如,不为所不见广从原农中不为加利润。可以加利润可安分加利润。 实现部分的积低数(为期末余额,不是到取发生数)。 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,计人费用后实际收益要低于所列数字。 3.2. 基金净值表现

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	6.74%	1.09%	5.13%	1.10%	1.61%	-0.01%
过去三个月	2.78%	1.40%	-1.10%	1.45%	3.88%	-0.05%
过去六个月	27.94%	1.40%	25.66%	1.47%	2.28%	-0.07%
过去一年	12.49%	1.39%	8.68%	1.45%	3.81%	-0.06%
过去三年	24.13%	1.02%	20.52%	1.05%	3.61%	-0.03%
自基金合同生 改起至今	46.60%	1.41%	32.65%	1.42%	13.95%	-0.01%
322 白某	金合同生	效以来基	金份额累	计净值增-	长驱变动及其	上与同期小

注: 本基金的基金合同生效日为2009年9月3日。本基金在6个月建仓期结束 时,各项的 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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
国和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是有449%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和名金管理公司,在全球市场上有超过70年的投资管理经验。即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。 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

在公司兵行十届7日生命》。 报告期末,本公司旗下运作32只基金产品。 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期 限		证券从业年限	说明
		任职日期	高任日期		
张志强	公司競投金総立。 公司競投金総立監中 工器的報金、企工工器的 第四十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二	2013年3月21日	-	16年	表現先生 CPA. 田 州以大学 (市选型)。中国科学 水大学教学中进一中国科学 水大学教学中进一个国科学 大学教学中进一个工作的人 。 国 Eurose Technology In-Technology In- Edition (1997)。 Eurose 发 (1997)。 Eurose Euros

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"证券从业保限"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遭期守信情况的说明 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《富兰克林国游沪深300指数增强延证券投资基金基金合同》的 规定、本著级空信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险总 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

10-1 公十×河町県北野州丁門町 报告期乃公司严格执行《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 方针以下2-8 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。 44 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 4.41 报告期内基金的投资策略和运作分析 2019年上半年,从股市场的膨胀层块。全期间仍取得了较大幅度上涨、大盘监筹 风格表现较好。所有行业均取得正收益,其中食品饮料,非根金融、农林牧渔、家用 电器、计算机等行边涨幅居前,而建筑装饰、钢铁、传媒、纷步服装、汽车、公用事业 等行业表现整后。上半年,从下分深的相景之形了270分。 报告期内,本基金在保持均衡的组合配置以控制主动投资风险的前提下、继续 使用量化选股模型精选个股及构建投资组合。量优选股模型在不同市场阶段的表现有一定处动,但报告制用内基本取得了预期的超额收益。

现有一定波动,但报告期内基本取得了预期的超额收益。 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年6月30日,本基金份额净值为1.108元。本报告期,份额净值上涨 27.94%,同期业绩比较基准上涨25.66%,基金表现超越业绩基准2.28%,期间基金

年化跟踪误差为2.74%。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

45 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 中国采购经理人PMI指数从去年底的44%上升到一季度末的50.5%,然后二 季度末又回到49.4%。显示经济增长的下行压力比较大。展望下半年,内外需求疲 弱、经济增长乏力的趋势所计将持续。相应地、财政政策和货币政策可能继续加码, 尤其是美联储明确进人降息周期后,国内货币政策空间比较大,预计流动性将超出 合理充裕的水平。政策方面,随着股捐期货交易放松和料创板高效率推出,证券市 场迎来了政策友好期。前期一些影响A股市场的其它重要因素对于市场的影响力 在逐步下降、中美贸易摩擦方面,短期内充益恶映块转换的阶段已经过去了,进 人了持久战时期。信用事件仍然会不断发生,但市场反应更加平和。 对A股市场而高,后续起决定作用的将是经济基本面和上市公司盈利基本面 的边际改善。在经济增长预期、上市公司盈利增长预期没有改善前,市场将在各种 短期因素作用下,维持震荡状态。 投资策略方面、下半年仍将保持均衡配置,控制主动投资风险。同时,力争通过 选股和其它有效策略获取超额收益。

及贸积和分周,1一十年5万18737、2018年 选股和其它有效策略获取超额收益。 本基金将继续按照基金合同及相关法律法规要求,努力做好基金投资工作,争

中華並作的表現公司 取未来更好的长期投资收益。 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 本公司在报告期内有效控制基金估值流程,按照相关法律法规的规定设有投

资资产估值委员会(简称"估值委员会"),并已制订了《公允估值管理办法》。估值 委员会审核和决定投资资产估值的相关事务,确保基金估值的公允、合理,保证估值未被查曲以免对基金持有。公生不利影响,报告期内相关基金估值政策由托管 银行进行复级、公司估值委员会由总经理或其任命者负责,成员包括投好,风险较制、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

看到益最大化为最高准则。 47 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 《5 托管人报告

\$5.托管人报告 51.报告期内本基金托管人边规守信情况证明 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 金基金管理人一国海富兰克林基金管理有限公司 2019 年1月1日至 2019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。 52.托管人对报告期内本基金经资运作遗规守信、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。基金份额申取赎回价格的计算、基金费用工专及和调和各国每年间 资产净值的计算。基金份额申取赎回价格的计算、基金费用工专及和调和各国每年间

本托管入认为、国商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、基金参惠费用于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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的复定。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 6.1 页厂以顺农 会计主体:富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金 报告截止日: 2019年6月30日

		单位:人民
资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:		
银行存款	15,163,684.57	12,653,029.08
结算备付金	553,721.33	14,548.80
存出保证金	28,091.01	16,157.32
交易性金融资产	156,546,133.06	114,693,434.20
其中:股票投资	156,546,133.06	114,693,434.20
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	-	
买人返售金融资产	-	
应收证券清算款	-	38,515.25
应收利息	2,891.90	2,452.26
应收股利	-	_
应收申购款	84,569.33	20,360.00
逆延所得税资产	-	_
其他资产	-	
资产总计	172,379,091.20	127,438,496.96
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负债:		
短期借款	-	
交易性金融负债	-	
衍生金融负债	_	
卖出回购金融资产款	_	
应付证券清算款	_	
应付赎回款	114,537.46	33,819.00
应付管理人报酬	115,278.93	94,085.74
应付托管费	20,343.35	16,603.30
应付销售服务费	-	
应付交易费用	198,427.33	125,961.83
应变税费	_	
应付利息	_	
应付利润	_	
逆延所得税负债	-	
其他负债	218,412.45	400,926.9
负债合计	666,999.52	671,396.88
所有者权益:	, , , , , , , , , , , , , , , , , ,	1 (100000
实收基金	154,947,043.54	146,394,891.93
未分配利润	16,765,048.14	-19,627,791.85
211-22 FE21-2019	10,700,040.14	-107,4467,7191.00
所有者权益合计	171,712,091.68	126,767,100.08

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1,108元,基金份额总额154。 +主体, 宣兰古林国海沪溪300指数增强刑证券投资其全

单位:人民币元 25,152,5

3.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体: 富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金

			T-12.7(L)		
2011	2019	本期 年1月1日至2019年6月30日	ı		
	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)	146,394,891.93	-19,627,791.85	126,767,100.08		
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数(本期利润)	-	35,708,872.64	35,708,872.64		
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)	8,552,151.61	683,967.35	9,236,118.96		
其中:1.基金申购款	32,371,670.46	1,873,270.95	34,244,941.41		
2.基金赎回款	-23,819,518.85	-1,189,303.60	-25,008,822.45		
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)	154,947,043.54	16,765,048.14	171,712,091.68		
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日				
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计		
一、期初所有者权益(基金净 值)	224,283,922.41	26,984,462.53	251,268,384.94		
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数(本期利润)	-	-25,823,961.36	-25,823,961.36		
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)	-75,041,986.87	-3,362,809.91	-78,404,796.78		
其中:1.基金申购款	16,693,596.73	1,754,106.49	18,447,703.22		
2.基金赎回款	-91,735,583.60	-5,116,916.40	-96,852,500.00		
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)	149,241,935.54	-2,202,308.74	147,039,626.80		
(净值减少以"-"号填列) 五、期末所有者权益(基金净	的组成部分。	, ,	147,039,		

-基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责

___ 林勇_

___龚黎

林勇

6.4.1 基金基本情况 641基金基本情况 富兰克林田海沪深300捐数增强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[2009]第652号《关于核 准富兰克林国海沪深300捐数增强型证券投资基金募集的批复》核准,由国海富兰 克林基金管理有限公司依服《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国 海沪深300指数增强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 得产保3.00指数增强型业券投资基金基金合同》贝贡公开募集。本基金为奖为型升 放式,存线期限不定,首次投立募集不包括认购资金利息,其募集2,423,482, 243.08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(2009)第 153号验资报告予以验证。经向中国证赔会备案《富兰克林国海沪深300指数增强 型证券投资基金基金合同 572009年9月3日正式生效,基金合同生效日的基金份 额总额为2,423,832,173.19份基金份额,其中认购资金利息折合349,930.11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

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 即欠业银行股份有股公司。 根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海沪深300指数增强 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国内依法公开发行、 上市防股票、债券及中国证金会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资 的资产占基金资产的比例为55%—56%,投资于标的指数成份股,备选成份股 的资产占基金资产的比例为5%—15%,其中现金或者到期目在一年以 资的其他证券品种占基金资产的比例为5%—15%,其中现金或者到期目在一年以 对的成份债务不任于基金资产净值的5%。农证占基金资产净值的比例不高于3%。 本基金除投资于目标指数的成份股票。包括沪深300指数的成份股利备选成份股 以外,还可适当投资一级市场申购的股票(包括部股与增数的成份股利备选成份股 以外,还可适当投资一级市场申购的股票(包括部股与增数的成份股利者选成份股 以外,还可适当投资一级市场申购的股票(包括部股与增数)以允不不增加额外风险 价值都干据基础格水平、本基金阶收得比较基准为;56% × 产空深30倍数 56% × 66% 的前提下提高收益水平。本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数+5%×银

本财务报表由本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于2019

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

642 宏计报金拉姆响准整理 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《企业会计准则一基本准则)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《证券投资基金单放赛XBIL模板第3号《年度报告和平年度报告》)、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》、《富兰克林国海沪深300亩敦增强型证券投资基金基金合同》和任财务报表的注644系列示的中国证监会、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。643 遗婚企业会计准则及其他有关规定的声明 本基金本报告期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2019年6月30日时财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日期间的经营成果和基金本报告期间财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日期间的经营成果和基金本报告期间财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日期间的经营成果和基金本报告期间财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日期间的经营成果和基金产业资本报会计估计

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。

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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]161号《关于全面排用产营业税政证赔值税过点的通知》,财税[2016]164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]140号《关于进等企业财制加业往来等增值税政策的补充通知》,财税[2016]140号《关于设管产品增值税政策有关问题的补充通知》,财税[2016]140号《关于设管产品增值税政策有关问题的补充通知》,财税[2017]25号《关于设管产品增值税有关问题的通知》,财税[2017]26号《关于设管产品增值税有关问题的通知》,财税[2017]296号《关于设管产品增值税对策的通知》,财税[2017]296号《关于报代周定资产出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 (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,费至用简易 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,债券的转让收入免证增值税,对官 债、地方取价债以及金融间处往来利取收入亦免证增值税。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作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,持股期限起过1年的,暂6年代的上生产140年代。1818年代,1818 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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票 交易印花税。 (5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际

缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。 6.4.7.1 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

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方 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。

在: 下处天联交易与在正常业分记国内较一版制 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 本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交

6.48.1.2 权证交易 本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。 6.48.2 关联方报酬 6.48.2 基金管理费

: 支付基金管理人 国海富兰克林基金管理有限公司 的管理人报酬的

	6.4.8.2.2 基金托管物	费	单位:人民币元
	項目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
	当期发生的基金应支付的托 管费	115,193.77	167,213.56
			按前一日基金资产净值0.15%的
			l 算公式为:日托管费 = 前一日基
资	产净值X 0.15% /	当年天数。	

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

2.本报告期和上年度可比期间(2018年1月1日至2018年6月30日)基金管理人 未运用固有资金投资本基金。 6.4.8.4.2 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

1.本基並附屬並且企業 公布的费率执行。 2.本报告期未和上年度末(2018年12月31日)除基金管理人之外的其他关联 方未投资本基金。 6.4.8.5 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

期末余额 当期利息收入 期末余額 当期利息收入 注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计 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。 6.487 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。 6.49. 期末(2015年号四月) 6.4.9 期末(2019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:人民而元

64.9.2 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陴的股票。 64.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 64.9.3.1 银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。 64.9.3.2 交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。 64.9.3.2 交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。 64.9.6.4.0 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)企融工具公允价值计量的方法

(1)公元511届 (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

(1)各层次金融工具公允价值 于2019年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的 金融资产中属于第一层次的余额为 156,489,156.52 元,属于第二层次的余额为 56,976.54 元,无属于第三层次的余额 (2018年12月31日:第一层次108,610, 07390元,第二层次6,083,360.30元,无属于第三层次的余额)。 (1)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。若出现重大事灾障牌、交易不活跃包括 涨跌停时的交易不活跃,或属于非公开处行等情况。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;并根据估值测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过属第二层次无是第二层次。 (2)非持续的以公允价值计量的金融工具 于2019年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年12月31日:同)。 (4)不以公允价值计量的金融工具 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。

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

序号	项目	金额	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	156,546,133.06	90.82
	其中:股票	156,546,133.06	90.82
2	基金投资	_	-
3	固定收益投资	_	_
	其中:债券	_	_
	资产支持证券	_	_
4	贵金属投资	_	_
5	金融衍生品投资	-	-
6	买人返售金融资产	_	-
	其中: 买断式回购的买人返售金融资产	_	-
7	银行存飲和結算备付金合计	15,717,405.90	9.12
8	其他各项资产	115,552.24	0.0
9	승난	172,379,091,20	100.00

期末按行业分类的股票投资组合 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	546,747.00	0.32
В	采矿业	3,823,916.56	2.23
С	制造业	58,049,315.74	33.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应 业	2,108,951.00	1.23
Е	建筑业	4,949,107.05	2.88
F	批发和零售业	5,801,128.25	3.38
G	交通运输、仓储和邮政业	4,958,851.00	2.89
Н	住宿和餐饮业	-	_
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,203,895.64	3.61
J	金融业	55,774,400.67	32.48
K	房地产业	7,107,017.68	4.14
L	租赁和商务服务业	1,407,428.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	-	
N	水利、环境和公共设施管理业	-	
0	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	224,458.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	150,955,216.59	87.91
7.2.2	期末积极投资按行业分	类的境内股票投资组合	金额单位:人民
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	-	-
В	采矿业	2,401,538.25	1.40
C	制造业	658,475.52	0.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	2,209,932.00	1.25
E	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	-	_
I	信息传输、软件和信息技术服务 业	39,603.76	0.0
J	金融业	33,869.94	0.00
K	房地产业	224,390.40	0.13
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	-	-
0	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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	5,590,916.47	3.26

7.2.3 报告期末按行业分类的潜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 期末按公价价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投

数量(股)

股票名称

2
4
4
5 000061 格力地器 94,942 4,671,81000 2.2 6 601166 光度順行 224,700 4,683,48300 2.7 7 600276 200200 4,683,68300 2.2 8 600160 正期桂枝 28,150 3,968,46820 2.2 9 600867 伊邦駅份 103,418 3,465,1853 2.0 11 000002 万 科A 121,200 3,370,57230 15 12 000023 美術園間 63,774 3,307,3964 15 14 600036 指標財子 88,520 3,185,27342 15 15 000668 五報報子 51,000 3,064,0660 12 16 601398 五報報子 51,000 3,064,0660 12 17 601697 上海紫勢 16,066 3,012,00055 12 19 605670 上海紫勢 16,066 3,012,00055 12 20 601968 中財事報 315,600 2,653,0700 14
6
7
8
9
10 601919 中近海岸 688,000 3,448,2800 2.6 11 000002 万 科A 121,200 3,370,57200 15 13 000002 万 科A 121,200 3,370,57200 15 13 00023 別労権局 63,774 3,307,31944 15 13 002594 比極地 64,525 3,272,70800 15 14 600036 招報財行 88,529 3,185,273.42 15 15 000581 五程度 25,900 3,664,905.00 12 16 601398 工程度 25,900 3,664,905.00 12 17 601607 上極筋的 165,066 3,013,708,05 12 17 601607 上極筋的 165,066 3,012,809.55 12 18 600016 民生銀行 414,232 2,639,701.0 11 19 600670 恒生电子 38,600 2,623,775.00 15 20 601766 中時叶车 315,600 2,553,204.00 14 22 601668 中時間 33,420 1,025,215.00 14 22 601668 中時間 33,420 1,025,215.00 1.1 22 601668 中時間 149,700 1,748,466.00 1.0 24 60198 中間財子 22,600 1,667,122.00 0.0 25 601168 中間財産 116,600 1,664,564.00 0.6 26 60118 中間財産 161,319 1,665,124.65 0.0 27 600500 接受報行 210,000 1,562,400.00 0.6 28 601920 建设银行 210,000 1,562,400.00 0.6 28 601920 建设银行 210,000 1,563,400.00 0.6 31 60138 工业高額 118,000 1,421,000.00 0.6 31 60138 工业高額 118,000 1,421,000.00 0.6 31 60138 工业高額 118,000 1,293,196.00 0.6 31 60138 工业高额 118,000 1,293,196.00 0.6 31 60138 工业高额 118,000 1,293,196.00 0.6 31 60121 財務を発 0,063 1,297,192.00 0.3 34 002524 完美世界 48,000 1,293,196.00 0.6 35 601211 財務を発 0,063 1,297,192.00 0.5 36 601211 財務を発 0,063 1,287,192.15 0.0 37 60038 金地集団 94,100 1,122,613.00 0.6
11 000002 万 科A 121,200 3,270,572,00 152 12 000033 炭炭原原図 63,774 3,307,319,04 15 13 002594 比変速 64,555 3,272,708,00 15 14 000036 招解報行 198,529 3,185,273,42 15 15 000888 五 税 度 25,000 3,664,96500 17 15 000888 五 税 度 25,000 3,664,96500 17 17 001607 上海底券 116,666 3,1012,70635 17 17 001607 上海底券 165,986 3,012,809,25 12 18 600016 民党報行 444,226 2,659,970,10 15 19 606570 世史年 38,500 2,663,775,00 15 20 011766 中時年 38,500 2,263,775,00 15 21 000801 光路前刊 146,000 2,265,3204,00 14 22 011766 中時時年 315,600 2,553,204,00 14 24 001196 中時報報 144,200 1,798,245,00 15 25 000000 過度銀行 149,700 1,798,245,00 15 26 00188 中間報報 149,700 1,798,6650 15 26 00188 中間報報 161,319 1,665,154,00 05 26 00188 中間報報 161,319 1,665,154,00 05 27 000000 接近银行 220,000 1,550,4000 05 28 00118 中間報程 161,319 1,665,154,00 05 28 00118 中間報程 17,000 1,562,4000 05 29 000000 接近银行 220,000 1,562,4000 05 20 00108 中間報程 17,000 1,562,4000 05 20 00108 中間報程 17,000 1,562,4000 05 20 00108 丁卯昭春報 18,000 1,562,4000 05 20 00000 接近日力 86,000 1,560,4000 05 20 00000 持江日力 86,000 1,560,4000 05 31 001081 丁邓帝郎 118,000 1,221,500,00 05 31 001081 丁邓帝郎 1
12
13
14
15 000888 五報液 25,000 3,064,08500 1.2 16 601298 五報液 25,000 3,064,08500 1.2 17 601697 1.2 18 600168 1.2 18 600168 1.2 18 600168 1.2 18 600169 1.2 18 600169 1.2 19 600570 1.2 19 600570 1.2 19 600570 1.2 10 600570 1.2 10 600570 1.2 11 600570 1.2 12 600080 2.5 2.5 2.5 2.
16
17
18
19 600670 恒生电子 38,600 2,623,775.00 1£ 20 601766 中甲甲年 315,600 2,253,20400 1.4 21 002801 大参野門 148,900 2,258,20400 1.4 22 001668 中国建筑 334,630 1,925,215.00 1.3 23 600000 耐度銀行 149,700 1,749,46600 1.6 24 601989 中間銀行 222,600 1,687,12220 0.6 25 600837 海域近身 116,600 1,664,654.00 0.6 26 601186 中間銀行 43,970 1,664,654.00 0.6 26 601186 中間銀行 222,600 1,687,1220 0.6 27 600390 建设银行 210,000 1,664,654.00 0.6 28 601186 中間銀行 721,000 1,664,654.00 0.6 28 601186 中間銀行 721,000 1,562,400.00 0.6 29 600600 长行电力 86,600 1,560,400.00 0.6 20 600600 七行电力 86,600 1,500,400.00 0.6 21 60138 工业密研 118,000 1,421,000.00 0.6 21 60138 工业密研 118,000 1,421,000.00 0.6 23 600685 海線水泥 33,000 1,406,800.00 0.6 23 600685 海線水泥 33,000 1,406,800.00 0.6 24 72,000 1,285,556.00 0.6 25 601211 財務春安 0,063 1,287,122,16
19 600670 恒生电子 38,600 2,623,775.00 1£ 20 601766 中甲甲年 315,600 2,253,20400 1.4 21 002801 大参野門 148,900 2,258,20400 1.4 22 001668 中国建筑 334,630 1,925,215.00 1.3 23 600000 耐度銀行 149,700 1,749,46600 1.6 24 601989 中間銀行 222,600 1,687,12220 0.6 25 600837 海域近身 116,600 1,664,654.00 0.6 26 601186 中間銀行 43,970 1,664,654.00 0.6 26 601186 中間銀行 222,600 1,687,1220 0.6 27 600390 建设银行 210,000 1,664,654.00 0.6 28 601186 中間銀行 721,000 1,664,654.00 0.6 28 601186 中間銀行 721,000 1,562,400.00 0.6 29 600600 长行电力 86,600 1,560,400.00 0.6 20 600600 七行电力 86,600 1,500,400.00 0.6 21 60138 工业密研 118,000 1,421,000.00 0.6 21 60138 工业密研 118,000 1,421,000.00 0.6 23 600685 海線水泥 33,000 1,406,800.00 0.6 23 600685 海線水泥 33,000 1,406,800.00 0.6 24 72,000 1,285,556.00 0.6 25 601211 財務春安 0,063 1,287,122,16
29
21 002801
22
23
24 601998 中指银行 202,600 1,687,122.00 0.5 5 600857 海班世界 116,600 1,664,854.00 0.5 25 600857 海班世界 116,600 1,664,854.00 0.5 26 601186 1 163,319 1,606,124.16 0.5 27 600340 年度平福 49,924 1,593,464.62 0.5 28 60199 建度银行 220,000 1,560,464.02 0.5 29 600900 长江屯力 86,600 1,560,400.00 0.6 30 601088 117 12 12 12 12 12 12 12 12 12 12 12 12 12
25 600827 房遊迎券 116,600 1,654,55400 0.5 26 601186 中院総建 151,319 1,665,12445 0.5 27 600340 中院総建 151,319 1,665,12445 0.5 28 601929 建设研行 220,000 1,562,400.00 0.5 29 600600 长行吐力 86,600 1,560,14000 0.5 30 601088 工业密研 118,000 1,421,600.00 0.5 31 60138 工业密研 118,000 1,421,600.00 0.6 32 600685 海螺禾邑 33,000 1,406,850.00 0.5 34 002824 完美世界 48,600 1,283,560.00 0.5 35 601211 財務存安 69,653 1,287,72235 0.7 36 601211 財務存安 69,653 1,387,72235 0.7 37 600383 金地集团 94,100 1,122,613.00 0.6
28
27 600040 年夏幸福 48,024 1,503,464.88 0.5 28 601939 建度银行 220,000 1,562,400.00 0.5 29 600900 长江北力 86,600 1,562,400.00 0.5 30 601088 中間附等 77,662 1,469,472.66 0.5 31 601138 工业密联 138,000 1,421,900.00 0.6 32 600565 海郷水泥 138,000 1,421,900.00 0.6 33 002304 洋利吸粉 10,600 1,238,585.00 0.6 34 002304 完美世界 49,600 1,238,585.00 0.3 36 001281 1 原春春安 69,653 1,387,122.66 0.7 37 600383 金地集団 94,100 1,122,613.00 0.6
28
28
29 600000 長江吐力 86,600 1,560,14000 0.5 30 601088 中時附帶 71,662 1,460,471,66 0.5 31 601138 工业保険 118,000 1,421,900,00 0.6 32 605685 海維光況 33,000 1,408,650,00 0.5 33 60534 洋原政份 49,600 1,299,550,00 0.5 34 002624 河流设験 49,600 1,299,17600 0.5 35 601211 国際存安 69,653 1,297,122,16 02 60083 61888 133,000 1,152,650,00 1,152,650,00 0.5 37 600383 金池県間 94,100 1,122,613,00 0.6
30 601088 中期納粹 71,662 1,460,471,66 0.6 31 601138 工態課業 118,000 1,421,900,00 0.6 32 600686 海椰木配 33,000 1,406,660,00 0.6 33 002304 所則股份 10,000 1,289,56600 0.6 34 002304 完美世界 49,660 1,280,176,00 0.7 36 601211 閉春春安 69,653 1,287,122,65 0.7 36 60188 13,000 1,162,66000 0.6 37 600383 金地集团 94,100 1,122,613,00 0.6
31 601138 工业密联 118,000 1,421,0000 0.6 22 605685 海線米記 33,000 1,406,860.00 0.5 30 002304 洋地理的 10,660 1,228,560.00 0.5 34 002304 完美世界 49,600 1,289,760.00 0.3 36 601211 財務春安 69,653 1,287,122,16 07 37 600383 金地陶研 94,100 1,122,613.00 0.6
32 600565 海維米尼 33,900 1,406,850.00 0.5 33 002304 洋河股份 10,600 1,288,536.00 0.3 34 002324 完度提序 49,600 1,289,176.00 0.3 36 601211 国際背安 69,663 1,287,122.65 0.3 36 60188 中国国版 13,000 1,152,460.00 0.6 37 600383 金地県居 94,100 1,122,613.00 0.6
33 002304 洋河股份 10,600 1,289,53600 0.3 34 002524 完美提界 49,600 1,280,17600 0.2 36 601211 国泰森安 69,653 1,287,12246 0.3 36 601288 中国国版 13,000 1,152,460.00 0.6 37 600383 金地県間 94,100 1,122,613.00 0.6
34 000824 完美世界 49,600 1,280,176.00 0.3 55 601211 財務存安 69,653 1,287,1223.6 07 36 60188 13,000 1,1552,650.00 66 37 600883 金地陶田 94,100 1,122,613.00 6.6
35 601211 国泰君安 69,063 1,287,12256 07 36 601888 中国国旅 13,000 1,152,450.00 0£ 37 600383 金地集团 94,100 1,122,613.00 0£
36 601888 中国国旅 13,000 1,162,450.00 0.6 37 600383 金地集团 94,100 1,122,613.00 0.6
37 600383 金地集团 94,100 1,122,613,00 0.6
38 601169 北京银行 185,800 1,098,078,00 0.6
39 600704 物产中大 181,600 984,272.00 0.5
40 000063 中光通讯 29,800 969,394.00 0.5
41 600019 宝钢股份 146,888 954,772.00 0.5
42 002024 苏宁易购 82,700 949,396,00 0.5
43 601688 华泰证券 40,800 910,656,00 0.5
44 002142 宁波银行 35,000 848,400.00 0.4
46 600028 中国石化 150,600 823,782,00 0.4
47 000725 京东方A 220,500 758,520.00 0.4
48 300122 智飞生物 17,400 749,940.00 0.4
49 601012 隆基股份 32,400 748,764.00 0.4
50 000568 泸州老客 9,000 727,470.00 0.4
51 000538 云南白药 8,700 725,754.00 0.4
52 601899 紫金矿业 186,700 703,859.00 0.4
53 601857 中国石油 98,100 674,928.00 0.3
54 600060 中国联通 109,304 673,312.64 0.3
55 601989 中国重工 120,500 669,980.00 0.3
56 002352 順丰控股 19,600 665,616.00 0.3
67 600999 招商证券 37,181 635,423.29 0.3
57 600999 招商证券 37,181 636,423,29 0.3 58 600104 上汽集团 24,187 616,788,50 0.3
57 600999 招商证券 37,181 605,423.29 0.3 58 600104 上汽集团 24,187 616,768.50 0.3 59 000166 申万宏献 121,296 607,687.96 0.3
57 600000 招前证券 37,181 635,423,29 0.3 58 600104 上代照图 24,187 619,78850 0.3 50 000166 497系数 121,286 607,625.6 0.3 60 601818 光光银行 154,600 589,02600 0.3
67 600000 招班进身 37,181 635,423.21 0.3 58 601040 上年開閉 24,187 616,7885.0 0.3 50 000166 中万宏瀬 12,186 607,687.95 60 601818 大大賦行 154,600 589,036.00 0.3 61 601380 中田中核 90,300 588,786.00 0.3
57 600000 招前证券 37,181 635,423,29 0.3 58 600104 上代照图 24,187 619,78850 0.3 50 000166 497系数 121,286 607,625.6 0.3 60 601818 光光银行 154,600 589,02600 0.3
67 600000 招班进身 37,181 635,423.21 0.3 58 601040 上年開閉 24,187 616,7885.0 0.3 50 000166 中万宏瀬 12,186 607,687.95 60 601818 大大賦行 154,600 589,036.00 0.3 61 601380 中田中核 90,300 588,786.00 0.3
57 600000 招前证券 37,181 635,423,23 0.3 58 601040 上年開閉 24,187 616,76850 0.3 59 000166 中万宏閣 121,266 607,687,95 0.3 60 601818 75,266 0.3 61 601390 中印叶埃 90,300 588,766.00 0.3 62 600048 保利地产 44,400 566,644.00 0.3
57 600000 招前证券 37,181 635,423,29 0.3 58 600104 上年間間 24,197 616,7885.0 0.3 50 000166 中万宏閣 121,256 667,6873.5 0.3 60 601818 光大朝行 154,600 569,026.0 0.3 61 601300 中時中候 90,300 587,766.0 0.3 62 600025 併能水电 137,300 568,811.00 0.3
57 600000 据程证券 37,181 605,423.29 0.3 86 600104 上年期間 24,197 619,798.00 0.3 96 60104 上年期間 24,197 619,798.00 0.3 96 601181 分光期下 154,600 689,0360 0.3 96 601181 光光期下 154,600 689,0360 0.3 96 601818 光光期下 44,400 569,56400 0.3 96 600005 经股股平 44,400 569,56400 0.3 96 600005 经股股平 44,000 559,8400 0.3 96 600005 分别表生 56,000 552,9400 0.3 96 600005 分别表生 56,000 552,9400 0.3
57 600000 招前证券 37,181 635,423,29 0.3 88 600104 上年間間 24,197 616,7885.0 0.3 90 000166 中万宏閣 121,256 667,6873.5 0.3 60 001818 光大朝行 154,600 589,026.00 0.3 61 601300 中時叶峡 90,000 589,786.00 0.3 62 600025 好能水电 137,300 568,811.00 0.3 63 600025 好能水电 137,300 568,811.00 0.3 64 600000 上旬野场 9,300 556,910.0 0.3 65 000274 9,777.00 0.3 66 000000 日上旬野场 6,000 552,948.00 0.3 66 000000 日上旬野场 9,300 5547,777.00 0.3
57 600000 招前正身 37,181 635,423.91 0.3 58 600104 上年間間 24,197 619,788.50 0.3 50 000166 小子窓間 121,256 667,687.65 0.3 60 601818 光小観行 154,600 589,028.00 0.3 61 601300 中田中域 90,300 589,76.00 0.3 62 600018 保持地产 44,400 566,544.00 0.3 63 600025 488.4% 137,300 588,811.00 0.3 64 600000 上海町路 6,600 552,948.00 0.3 65 60274 牧坂駅份 9,300 549,747.00 0.3 66 00274 牧坂駅份 31,300 541,611.00 0.3 67 000776 广牧证券 39,300 549,622.00 0.3
57 6000000 新南正寿 27,181 605,423.29 0.3 66 600104 上年期間 24,197 619,788.00 0.3 90 000166 1力実施 121,265 607,697.6 0.3 00 001161 75,268 121,265 607,697.6 0.3 00 01118 光大規터 164,000 569,000.00 0.3 01 01120 1199,74 0.3 02 000005 569,860.00 0.3 03 000005 568,840.0 0.3 04 000005 568,840.0 0.3 05 000007 568,840.0 0.3 05 00007 568,840.0 0.3 06 00007 568,840.0 0.3 07 00077 07,720.9 0.3 07 00077 17,720.9 0.3 07 00077 17,720.9 0.3 08 00007 17,720.9 0.3 07 00077 17,720.9 0.3 08 00007 17,720.9 0.3 08 00007 17,720.9 0.3 08 00007 17,720.9 0.3 08 00007 17,720.9 0.3 08 00007 17,720.9 0.3 08 00007 17,720.9 0.3 08 00007 17,720.9 0.3 08 00007 17,720.9 0.3 08 00007 17,720.9 0.3 08 00007 17,720.9 0.3 08 00007 17,720.9 0.3 08 00007 17,720.9 0.3 08 00007 17,720.9 0.3 08 00007 0.3 08 08 08 08 08 08 08 08
57 600000 招前证券 37,181 665,423.29 0.3 88 600104 上年間間 24,197 616,7885.0 0.3 90 000166 中分変調 121,256 667,6873.5 0.3 60 001818 光大銀行 154,600 569,036.0 0.3 61 601300 中印呼峡 90,300 587,766.0 0.3 62 600025 年能水电 127,300 568,811.0 0.3 63 600025 年能水电 127,300 568,811.0 0.3 64 600000 上毎町近 6,000 552,988.0 0.3 64 600000 上毎町近 6,000 552,988.0 0.3 65 00274 74720 0.3 66 000776 『東藤野 31,300 543,681.0 0.3 67 00778 『東藤野 31,300 543,681.0 0.3 68 300256 百余元 559,883.0 0.3 68 300256 日間団歩 37,400 402,184.0 0.3
57 600090 招前正券 37,181 635,423.29 0.3 58 600104
57 6000000 招前正券 37,181 665,423.29 0.3 88 600104 上年間間 24,197 619,788.00 0.3 89 600104 上年間間 24,197 619,788.00 0.3 90 000166 407282 121,256 667,6973.6 0.3 60 601818 光大銀行 154,600 589,060.00 0.3 61 601200 中中呼中県 90,300 589,786.00 0.3 62 600035 保健廃土 137,300 589,811.00 0.3 63 600025 保健廃土 137,300 589,811.00 0.3 64 600056 保健廃局 9,300 562,840.0 0.3 65 00274 校原局 9,300 549,747.00 0.3 66 00276 所養皇 31,300 543,811.00 0.3 67 002776 广東北岸 33,300 543,811.00 0.3 68 00026 新春皇 31,300 543,811.00 0.3 68 000276 所養皇 31,300 543,811.00 0.3 68 000276 所養皇 34,400 443,140.00 0.3 69 002736 開稅庫券 37,400 442,140.00 0.2 71 002238 蔣永康壹 4,600 443,000.00 0.3
57 600090 招前正券 37,181 635,423.29 0.3 58 600104
57 600000 長飛延歩 27,181 605,423.29 0.3 60 00104 上年期間 24,197 619,798.60 0.3 60 00105 上年期間 24,197 619,798.60 0.3 60 001181 火火地坪 194,600 589,036.00 0.3 60 001181 火火地坪 194,600 589,036.00 0.3 62 00004 保管財産 44,400 566,644.00 0.3 63 60005 保修財産 44,400 566,644.00 0.3 63 60005 保修財産 44,400 566,644.00 0.3 64 000000 保修財産 44,400 566,840.00 0.3 65 002274 秋原股份 9,300 546,747.00 0.3 66 000676 新希望 31,300 546,747.00 0.3 67 000776 72を設計 39,300 549,861.00 0.3 68 000676 新希望 31,300 549,861.00 0.3 68 000676 新希望 31,300 549,861.00 0.3 69 000276 所称望 39,300 549,861.00 0.3 60 00276 所称望 44,400 449,344.00 0.3 70 00276 所称理身 4,400 449,144.00 0.3 71 002415 海豚産糧 4,400 489,100.00 0.3 72 001010 中間支援 4,400 476,672.00 0.3 73 002415 海豚産糧 90,000 460,600.00 0.3 73 002415 海豚産糧 90,000 460,600.00 0.3 73 002415 海豚栗糧 90,000 460,600.00 0.3 73 002413 系別股地 90,000 460,600.00 0.3 73 002413 系別股地 90,000 460,600.00 0.3
57 600000 招前证券 37,181 635,423.29 0.3 88 600104 上年間間 24,197 616,7885.0 0.3 89 600104 上年間間 24,197 616,7885.0 0.3 90 000166 中井光原 121,256 667,6873.5 0.3 60 001818 光大銀行 154,600 569,036.0 0.3 61 601300 中印甲峡 90,300 589,766.0 0.3 62 600005 年能水电 127,300 568,811.00 0.3 63 000025 年能水电 127,300 568,811.00 0.3 64 600000 上野野 6,600 552,988.00 0.3 64 600000 上野野 5 9,300 552,988.00 0.3 65 000274 秋野 39,300 543,74730 0.3 66 000076 前希望 31,300 543,681.00 0.3 67 000776 广发世券 39,300 559,982.00 0.3 68 300056 第次野営 38,480 494,394.00 0.3 69 002736 国情证券 37,400 492,194.00 0.3 70 602388 海洋戦业 4,000 482,000.00 0.3 71 002388 海洋戦业 4,000 485,000.00 0.3 72 003288 海洋戦业 4,000 485,000.00 0.3 72 004502 中間交建 42,100 476,572.00 0.3
57 600000 長飛延歩 27,181 605,423.29 0.3 60 00104 上年期間 24,197 619,798.60 0.3 60 00106 上年期間 24,197 619,798.60 0.3 60 00118 77,198 121,126 607,679.5 0.3 60 00118 光光射下 154,600 589,036.00 0.3 61 601300 中田中峡 90,300 589,5600 0.3 62 600004 発射財产 44,400 566,544.00 0.3 63 600005 外球火車 177,300 589,110.0 0.3 64 600000 上旬財店 6,600 552,940.0 0.3 65 002714 秋原財产 9,300 546,747.00 0.3 66 000676 新希望 31,300 549,611.0 0.3 67 000776 7次股野 39,300 589,810.0 0.3 68 300069 所希望 31,300 549,611.0 0.3 68 300069 所希望 37,400 494,304.00 0.3 68 300069 水沢野富 26,480 494,304.00 0.3 70 602236 田田世野 37,400 492,184.00 0.3 70 60238 水沢野富 4,600 493,000.00 0.3 71 002415 海豚桃根 17,384 479,69.72 0.3 72 00131 外別財産 90,000 476,672.00 0.3 73 000413 外別財産 90,000 476,670.00 0.3 74 000413 外別財産 90,000 476,670.00 0.3 75 000413 外別財産 90,000 476,670.00 0.3
57 6000000 括南正寿 37,181 665,423.29 0.3 88 600104 上年間間 24,197 619,788.00 0.3 89 600104 上年間間 24,197 619,788.00 0.3 90 000166 リナ光線 121,256 667,687.56 0.3 60 601818 光大銀行 154,600 589,080.00 0.3 61 601300 中中呼収 90,300 589,786.00 0.3 62 600035 保健地は 137,300 568,544.00 0.3 63 600025 保健地は 137,300 568,8111.00 0.3 66 000274 投収配分 9,300 562,948.00 0.3 66 000274 財産報 31,300 564,641.00 0.3 66 000274 財産報 31,300 544,641.00 0.3 67 000776 ア波波券 33,300 543,841.00 0.3 68 000276 ア波波券 33,300 543,841.00 0.3 68 000276 ア波波券 33,400 494,944.00 0.3 69 002236 開催電券 37,400 492,194.00 0.3 71 002238 寿天味业 4,600 483,000.00 0.3 77 002238 寿天味业 4,600 483,000.00 0.3 77 002315 南田原地 17,394 479,6507.2 0.3 78 002415 南田原地 17,394 479,6507.2 0.2 79 002415 南田原地 17,394 479,6507.2 0.2 70 002415 南田原地 17,394 479,6507.2 0.2 71 002415 新規形理 19,000 462,600.00 0.3 74 00113 新規形理 10,000 462,600.00 0.3
57 600000 招前证券 37,181 605,423.29 0.3 88 600104 上年間間 24,197 616,7885.0 0.3 89 600104 上年間間 24,197 616,7885.0 0.3 90 000166 中野変調 121,25€ 667,6873.5 0.3 60 001818 光大銀行 154,600 569,036.0 0.3 61 601300 中野呼峡 90,300 589,766.0 0.3 62 600005 年能水电 127,300 568,811.0 0.3 63 600025 年能水电 127,300 568,811.0 0.3 64 600006 上野野场 6,600 552,988.0 0.3 64 600007 上野野场 9,300 549,7473.0 0.3 66 00027 前希望 31,300 543,681.0 0.3 67 0007/8 「定世券 39,300 559,982.0 0.3 68 30005 日本市・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・
57 6000000 括南正寿 37,181 665,423.29 0.3 88 600104 上午順間 24,197 619,788.00 0.3 89 600104 上午順間 24,197 619,788.00 0.3 90 000166 リカア設備 121,256 667,697.56 0.3 60 601818 光大戦行 154,600 589,060.00 0.3 61 601200 中中呼中県 90,300 589,786.00 0.3 63 600025 帰地地地 137,300 589,786.00 0.3 63 600025 帰地地地 137,300 589,8111.00 0.3 64 600026 上都町路 9,300 562,948.00 0.3 65 000274 放映局 9,300 549,747.00 0.3 66 000276 滑車登 31,300 543,847.00 0.3 67 000776 ア波波声 33,300 543,841.00 0.3 68 00026 新春里 31,300 543,841.00 0.3 68 000276 清水地 4,400 483,800.00 0.3 68 000276 清水地 4,400 483,000.00 0.3 70 000278 清水地 4,600 483,000.00 0.3 71 000213 海水地 4,600 483,000.00 0.3 71 000213 海水地 4,600 483,000.00 0.3 71 000215 赤泥地地 17,384 479,460.72 0.3 72 00013 赤泥地地 90,000 442,400.00 0.3 73 00013 赤泥地地 90,000 442,600.00 0.3 74 001156 新鮮地駅 11,400 45,004.00 0.3 75 600000 77年中半 15,500 447,860.00 0.3 77 000202 金瓦科技 35,302 443,803.8
57 600000 招前证券 37,181 605,423.29 0.3 58 600104
57 600000 長雨世寿 97,181 605,423.29 0.3 60 00104 上年期間 24,197 619,798.20 0.3 60 00106 上年期間 24,197 619,798.20 0.3 60 00106 1上年期間 121,266 607,679.5 0.3 60 001181 光光期庁 154,600 589,030.0 0.3 61 001300 中田中戦 00,000 589,560.0 0.3 62 00005 採港地庁 44,400 566,544.0 0.3 63 60005 採港地市 44,400 566,544.0 0.3 64 00000 158,811.0 0.3 65 000274 校原股份 9,300 559,811.0 0.3 66 000076 新希望 31,300 546,747.0 0.3 66 000076 新希望 31,300 551,811.0 0.3 67 000776 所希望 31,300 551,811.0 0.3 68 000076 新希望 31,300 551,811.0 0.3 69 00276 所衛世 37,400 491,194.0 0.3 70 00773 所称世 4,400 497,194.0 0.3 71 002176 採財販費 4,400 482,194.0 0.3 72 002415 採財販費 4,400 483,194.0 0.3 73 002415 採財販費 17,384 479,450.7 0.3 74 00115 採財販費 11,400 463,834.0 0.3 75 00000 75形化学 10,000 449,260.0 0.3 76 00000 75形化学 10,000 449,260.0 0.3 76 001020 中間入井 15,600 449,265.0 0.3 76 001020 中間入井 15,600 449,265.0 0.3 77 00222 金別村長 35,302 438,803.8 0.3 77 000038 港港市 32,000 303,280.0 0.3 70 00038 港港市 32,000 303,280.0 0.3 70 00038 港港市 32,000 303,280.0 0.3
57 6000000 括南正寿 37,181 665,423.29 0.3 88 600104 上年間間 24,197 619,788.00 0.3 89 600104 上年間間 24,197 619,788.00 0.3 90 000166 1 上年間間 24,197 619,788.00 0.3 60 601818 光大銀行 154,600 589,036.00 0.3 61 601300 中中甲株 90,300 589,786.00 0.3 62 600035 保健性学 44,400 566,544.00 0.3 63 600035 保健性学 44,400 566,544.00 0.3 64 600036 保健性学 44,000 566,544.00 0.3 65 000274 保健性学 39,300 553,882.00 0.3 66 000274 保健性学 39,300 543,747.00 0.3 66 000276 ア发酵器 31,300 543,747.00 0.3 68 000276 ア发酵器 31,300 543,811.00 0.3 68 000276 ア发酵器 36,800 494,304.00 0.3 68 000276 保健性学 44,600 482,100.00 0.3 70 000288 海天味壺 4,600 482,000.00 0.3 71 002415 開催度学 37,400 482,184.00 0.3 71 002415 開催度学 17,394 479,46.072 0.3 72 000415 新規矩理 17,394 479,46.072 0.3 73 000413 紫阳地电 10,000 462,000.00 0.3 74 601155 蘇維尼野 11,400 453,840.00 0.3 75 600000 75年代学 10,500 447,850.00 0.3 76 601638 中球長煙 13,500 447,850.00 0.3 77 000213 紫阳地理 11,000 447,850.00 0.3 76 601638 中球長煙 15,500 447,850.00 0.3 77 000213 紫阳地理 11,000 447,850.00 0.3 77 000203 金属科技 35,300 447,850.00 0.3 79 000203 強性が成分 439,800.00 0.3 79 000203 金属科技 35,300 439,800.00 0.3 79 000203 金属科技 35,300 439,800.00 0.3 79 000203 金属和ガリ 32,000 330,201.00 0.3
52
57 600000 括南正寺 37,181 605,423.29 0.3 60 00104 上年期間 24,197 619,788.00 0.3 60 00105 上年期間 24,197 619,788.00 0.3 60 001018 上年期間 121,126 607,679.5 0.3 60 001181 光光照行 154,000 569,000.00 0.3 61 001180 中市中株 0.300 569,766.00 0.3 62 00005 好成所 44,000 566,544.00 0.3 63 00005 好成所 44,000 566,544.00 0.3 64 000005 好成所 44,000 566,544.00 0.3 65 00007 分析所 44,000 566,440.00 0.3 66 00007 分析所 44,000 566,440.00 0.3 67 00077 720,000 549,747.00 0.3 68 00007 所有 31,000 549,747.00 0.3 69 0027 所有 34,000 549,747.00 0.3 60 0007 所有 34,000 549,747.00 0.3 61 0007 所有 34,000 494,304.00 0.3 62 0007 所有 47,000 492,144.00 0.3 63 0002 所方所謂 36,400 494,304.00 0.3 64 00000 日間 77,200 492,144.00 0.3 71 002415 所服税則 17,384 479,450.72 0.3 72 000413 所服税則 17,384 479,450.72 0.3 73 000413 所規税則 90,000 462,600.00 0.3 74 00115 新規税則 90,000 462,600.00 0.3 75 000000 77年化学 11,600 449,260.00 0.3 76 000000 77年化学 15,600 447,460.00 0.3 77 002202 全球科技 35,302 438,600.00 0.3 77 000204 金球科技 35,302 438,600.00 0.3 79 000006 同申雨 23,000 436,176.00 0.3 79 000006 同申雨 53,000 436,176.00 0.3 79 000006 日間 日間 17,000 390,271.00 0.3 79 0000241 秋月秋時 13,070 390,200.00 0.3 70 000138 多外報時 13,070 390,000.00
57 6000000 括南正寿 37,181 605,423.29 0.3 58 600104
552 600,000 居岡原彦 27,181 665,423.29 0.3 68 600104
57 6000000 括南正寿 37,181 605,423.29 0.3 58 600104

0.39	665,616.00	19,600	順丰控股	002352	6
0.37	635,423.29	37,181	招商证券	600999	57
0.36	616,768.50	24,187	上汽集团	600104	58
0.35	607,687.96	121,295	申万宏源	000166	59
0.34	589,026.00	154,600	光大银行	601818	60
0.34	588,756.00	90,300	中国中铁	601390	61
0.33	566,544.00	44,400	保利地产	600048	62
0.33	558,811.00	137,300	华能水电	600025	63
0.32	552,948.00	6,600	上海机场	600009	64
0.32	546,747.00	9,300	牧原股份	002714	65
0.32	543,681.00	31,300	新希望	000876	66
0.31	539,982.00	39,300	广发证券	000776	67
0.29	494,304.00	36,480	东方财富	300059	68
0.29	492,184.00	37,400	国信证券	002736	69
0.28	483,000.00	4,600	海天味业	603288	70
0.28	479,450.72	17,384	海康威视	002415	71
0.28	476,572.00	42,100	中国交建	601800	72
0.27	462,600.00	90,000	东旭光电	000413	73
0.26	453,834.00	11,400	新城控股	601155	74
0.26	449,295.00	10,500	万华化学	600309	75
0.26	447,456.00	15,800	中国人寿	601628	76
0.26	438,803.86	35,302	金风科技	002202	77
0.25	436,176.00	23,400	国电南瑞	600406	78
0.23	393,280.00	32,000	潍柴动力	000338	79
0.23	390,271.00	43,900	歌尔股份	002241	80
0.21	361,530.00	11,700	海大集团	002311	81
0.21	360,006.90	13,970	步长制药	603858	82
0.21	353,440.00	94,000	上海建工	600170	83
0.20	348,688.00	24,800	通威股份	600438	84
0.20	348,161.00	34,100	永辉超市	601933	85
0.20	343,772.00	57,200	中联重科	000157	86
0.20	343,650.00	47,400	特变电工	600089	87
0.20	339,048.00	10,200	科大讯飞	002230	88
0.19	333,888.00	37,600	建发股份	600153	89
0.18	313,920.00	24,000	三一班工	600031	90
0.18	311,175.00	13,500	航天信息	600271	91
0.18	303,527.00	33,100	中天科技	600522	92
0.17	294,976.00	17,600	亨通光电	600487	93
0.17	293,702.00	11,800	双汇发展	000896	94
0.17	292,049.00	36,100	大秦铁路	601006	95
0.17	290,957.00	12,700	汇川技术	300124	96
0.17	286,146.00	18,168	中的气板机	000768	97
0.16	275,814.00	9,900	烽火通信	600498	98
0.16	267,978.00	11,800	航发动力	600893	99
0.15	254,978.00	48,200	分众传媒	002027	100
0.15	253,990.00	11,000	正泰电器	601877	101
0.14	241,562.00	44,900	上海电气	601727	102
0.13	224,458.00	9,700	宋城演艺	300144	103
0.12	208,054.00	19,300	网宿科技	300017	104
0.12	205,682.96	8,708	中国动力	600482	105
0.11	182,954.00	1,700	欧派家居	603833	106
0.10	175,890.00	7,800	中国卫星	600118	107
0.10	172,602.00	38,700	广汇汽车	600297	108
0.09	160,876.00	14,800	宛州煤业	600188	109
0.09	159,665.00	5,500	中航池飞	600760	110
0.09	158,974.00	10,100	江西铜业	600362	111
0.09	157,065.58	3,829	中直股份	600038	112
0.09	149,050.00	11,000	三七互娱	002555	113
0.08	137,256.00	26,600	上海石化	600688	114
0.06	102,396.00	6,900	中航电子	600372	115

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产 值比例(%
1	600863	内蒙华电	703,800	2,209,932.00	1
2	600259	广展有色	41,900	1,688,570.00	0
3	600871	石化油服	240,700	608,971.00	0
4	600507	方大特钢	50,000	489,000.00	0
5	600266	北京城建	27,840	224,390.40	0
6	600968	海油发展	29,295	103,997.25	0
7	300782	卓胜微	743	80,927.56	0
8	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0
9	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0
10	300594	朗进科技	721	31,803.31	0
11	603863	松炀资源	1,290	29,773.20	0
12	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0
13	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0
		票投资组合	的重大变动 刃基金资产净值2		

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	000651	格力电器	6,737,083.00	5.31
2	600030	中信证券	6,381,341.00	5.03
3	000001	平安银行	5,530,697.00	4.36
4	000333	美的集团	5,288,875.62	4.17
5	000538	云南白药	5,156,242.00	4.07
6	603160	汇顶科技	5,114,378.50	4.03
7	000002	万 科A	4,968,385.00	3.92
8	601818	光大银行	4,955,621.00	3.91
9	601668	中国建筑	4,797,946.71	3.78
10	601607	上海医药	4,607,870.90	3.60
11	600887	伊利股份	4,506,866.82	3.56
12	603259	药明康德	4,500,062.00	3.58
13	002415	海康威视	4,483,519.86	3.54
14	300136	信维通信	4,342,638.00	3.43
15	000636	风华高科	4,285,206.00	3.38
16	002594	比亚迪	4,255,229.75	3.36
17	601866	中远海发	4,216,726.00	3.30
18	600340	华夏幸福	4,113,144.03	3.24
19	601318	中国平安	4,007,328.65	3.1
20	601166	兴业银行	3,964,870.00	3.13
21	601988	中国银行	3,952,407.00	3.12
22	600383	金地集团	3,934,241.00	3.10
23	601138	工业部联	3,814,484.10	3.01
24	600000	浦发银行	3,755,361.00	2.96
25	600795	国电电力	3,727,785.00	2.94
26	000166	申万宏源	3,667,782.51	2.89
27	601919	中远海控	3,644,504.00	2.87
28	600025	华能水电	3,613,549.00	2.88
29	000100	TCL 集团	3,537,320.00	2.79
30	600100	同方股份	3,450,904.00	2.77
31	601998	中信银行	3,440,629.00	2.7
32	600566	济川药业	3,367,005.63	2.66
33	600089	特变电工	3,320,538.00	2.62
34	601800	中国交建	3,183,844.00	2.51
35	600332	白云山	3,114,873.00	246
36	600276	恒瑞医药	3,069,599.40	242
37	600519	贵州茅台	3,053,441.00	241
38	600548	深高速	3,030,975.72	2.39
39	600623	华谊集团	2,994,551.00	2.3
40	002304	洋河股份	2,976,032.00	2.3
41	600259	广展有色	2,970,840.00	2.34
42	601766	中国中车	2,931,522.00	2.3
43	600036	招商银行	2,819,440.73	2.22

主:买人金额按买人成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交

授用。 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	002415	海康威视	7,737,501.00	6.10		
2	000651	格力电器	5,771,245.00	4.55		
3	601818	光大银行	5,710,670.00	4.50		
4	000538	云南白药	5,474,740.83	4.32		
5	601866	中远海发	5,305,797.00	4.19		
6	601328	交通银行	5,233,353.00	4.13		
7	601988	中国银行	5,202,779.00	4.10		
8	600795	国电电力	5,115,363.00	4.04		
9	000100	TCL 集团	5,072,931.00	4.00		
10	000333	美的集团	4,994,156.00	3.94		
11	603259	药明康德	4,671,888.00	3.69		
12	000636	风华高科	4,575,572.00	3.61		
13	600089	特变电工	4,511,328.17	3.56		
14	300136	信维通信	4,406,772.00	3.48		
15	600000	浦发银行	4,366,579.80	3.44		
16	603288	海天味业	4,318,460.00	3.41		
17	601607	上海医药	4,284,479.00	3.38		
18	600100	同方股份	4,028,029.00	3.18		
19	601998	中信银行	3,720,320.39	2.93		
20	600025	华能水电	3,613,707.00	2.85		
21	600566	济川药业	3,590,793.74	2.83		
22	601360	三六零	3,419,776.17	2.70		
23	601800	中国交建	3,413,234.01	2.69		
24	600657	信达地产	3,394,517.00	2.68		
25	600383	金地集团	3,386,671.12	2.67		
26	000540	中天金融	3,383,401.00	2.67		
27	000157	中联重科	3,369,161.00	2.66		
28	000166	申万宏源	3,364,618.51	2.65		
29	600623	华谊集团	3,330,527.00	2.63		
30	601166	兴业银行	3,311,236.00	2.61		
31	600519	贵州茅台	3,300,851.00 2.60			
32	601138	工业部联	3,254,214.40	2.57		
33	600332	白云山	3,234,142.00	2.55		
34	600036	招商银行	3,228,961.00	2.55		
35	601668	中国建筑	3,206,984.00	2.53		
36	600030	中信证券	3,176,072.92	2.51		
37	600588	用友网络	3,036,648.72	2.40		
38	600548	深高速	2,982,539.40	2.35		
39	002304	洋河股份	2,898,477.72	2.29		
40	600016	民生银行	2,872,484.00	2.27		
41	601601	中国太保	2,727,087.00	2.15		
42	600340	华夏幸福	2,703,760.00	2.13		
43	601211	国泰君安	2,596,169.00	2.05		
注	:卖出金	领按卖出成交金	₹额(成交单价乘以成交数±	量)填列,不考虑相等		
费用						
7.	4.3 买入店	及票的成本总额	及卖出股票的收入总额			
				单位:人民		
32	人股票成本()	或交) 总额		323,320,512.91		

第17.377,302.38 注:或入股票成本总额及卖出股票收入总额均按买卖成交金额(成交单价乘 以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 本基金本按告期末未持有债券。

华盛亚华版口明/木尔村间切分。 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 本基金本报告期末未持有债券。 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资

ll 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 本基金本报台期末未持有权证。 7.10 报告期末本基分投资的股捐明货交易情况说明 根据基金合同,本基金不投资股捐明货交易情况说明 根据基金合同,本基金不投资图值制货交易情况说明 根据基金合同,本基金不投资图值明货交易情况说明 根据基金合同,本基金不投资图值明货。 7.12 投资组合报占构注 7.12 投资组合报占构注 7.12 生态量分银后的指生 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

9 合計 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间的可转债 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说

7.12.5.1 期末捐缴投资前十名股票中存在流通受限情况的说明 才12.5.1 期末捐缴投资前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告本期末捐缴投资前十名股票中存在流通受限情况。 7.12.5.2 期末系极投资前五名股票中存在流通受限情况。 素据金本报告本期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况。 8.8 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 3.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情

10 重大事件揭

金额单位:人民币元

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

10.1 基金份额持有人大会决议 0.2 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)基金管理人重大人事变动 经国海富兰成林基金管理有限公司第五届董事会第十七次会议审议通过。自2019年6月24日起,王雷尔 再担任公司副总经理。相关公告已于2019年6月28日在《中国证券报》和公司网站披露。

涉及基金管理人、基金财产

0.4 基金投资策略的改变 .5 为基金进行审计的会计师事务所情况 0.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

店当期股票 成交金額 成交总额的比 例 佣金

西藏东方財 宮证券	2	299,132,540.16	46.81%	218,753.99	43.28%	-
天风证券	1	82,618,461.98	12.93%	60,418.92	11.95%	-
平安证券	2	66,523,388.03	10.41%	48,648.21	9.62%	-
中信证券	2	49,915,449.44	7.81%	46,486.59	9.20%	-
海通证券	1	44,101,638.78	6.90%	41,072.28	8.13%	-
方正证券	1	35,464,569.24	5.55%	33,028.21	6.53%	-
申万宏源	1	29,241,576.24	4.58%	27,232.86	5.39%	-
国信证券	1	17,580,154.45	2.75%	16,372.01	3.24%	-
中泰证券	1	14,454,231.31	2.26%	13,461.44	2.66%	-
国金证券	1	-	_	-	-	-
国泰君安	1	-	_	-	-	-
国盛证券	1	-	_	-	-	-
银河证券	1	-	_	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	_	-	-	-
中金公司	2	-	_	-	-	-
北京高华	1	-	_	-	-	-
兴业证券	1	-	_	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	_	-	_
民族证券	1	-	-	-	-	_

	债券	交易	债券回题	的交易	权证	⊉位:人
券商名称	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金額	占当期权 成交总额 比例
西藏东方财 富证券	-	-	-	-	-	
天风证券	117,178.50	100.00%	-	-	-	
平安证券	-	_	-	-	-	
中信证券	-	-	-	-	-	
海通证券	-	-	-	-	-	
方正证券	-	_	-	-	-	
申万宏源	-	_	-	-	-	
国信证券	-	_	-	-	-	
中泰证券	-	_	-	-	-	
国金证券	-	-	-	-	-	
国泰君安	-	_	-	-	-	
国盛证券	-	-	-	-	-	
银河证券	-	-	-	-	-	
华安证券	-	-	-	-	-	
安信证券	-	-	-	-	-	
东兴证券	-	-	-	-	-	
中金公司	-	-	-	-	-	
北京高华	-	-	-	-	-	
兴业证券	-	-	-	-	-	
第一创业	-	-	-	-	-	
华泰证券	-	-	-	-	-	
招商证券	-	-	-	-	-	
东北证券	-	-	-	-	-	
中信建投	-	-	-	-	-	
国海证券	-	-	-	-	-	
民族证券	-	-	-	-	-	

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

国海富兰克林基金管理有限公司 2019年8月28日