

富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金  
2016 年年度报告摘要

2016 年 12 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 23 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 20 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金简称       | 国富沪港深成长精选股票     |
| 基金主代码      | 001605          |
| 交易代码       | 001605          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2016 年 1 月 20 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      | 中国工商银行股份有限公司    |
| 报告期末基金份额总额 | 27,724,756.14 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金主要投资于具有持续成长潜力和核心竞争优势的上市公司的股票，在有效控制风险的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。 |
|------|--|

|      |  |
|------|--|
| 投资策略 | <p>本基金根据各类证券风险收益特征的相对变化，适度地调整确定基金资产在股票、债券及现金等大类资产的分配比例。</p> <p>（一）行业配置策略</p> <p>本基金根据宏观经济周期、国家产业政策、行业景气度和行业竞争格局等因素进行深入分析，结合行业盈利趋势预测、行业整体估值水平和市场特征等，进行综合的行业投资价值评估。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>对于境内和香港市场的股票，本基金通过自下而上的个股精选策略，从行业发展前景、成长速度、成长质量、成长驱动因素这四个维度对企业的可持续成长能力进行评估。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>（四）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，</p> |
|------|--|

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>在严格控制投资风险的基础上进行投资，以获得稳定收益。</p> <p>（五）股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>（六）中小企业私募债券投资策略</p> <p>本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较，对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析，选择具有优势的品种进行投资，并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。</p> |
| 业绩比较基准 | 85% × 沪深 300 指数收益率 + 15% × 中债国债总指数收益率（全价）  |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型基金，属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种，其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                                 | 基金托管人               |
|---------|------|---------------------------------------|---------------------|
| 名称      |      | 国海富兰克林基金管理有限公司                        | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 储丽莉                                   | 郭明                  |
|         | 联系电话 | 021-3855 5555                         | 010-66105799        |
|         | 电子邮箱 | service@ftsfund.com                   | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555 | 95588               |
| 传真      |      | 021-6888 3050                         | 010-66105798        |

## 2.4 信息披露方式

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

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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 | 2016 年 1 月 20 日<br>(基金合同生效<br>日)-2016 年 12 月<br>31 日 |         |         |
|---------------|--|---------|---------|
|               |  | 2015 年  | 2014 年  |
| 本期已实现收益       | -2,063,296.57  | -       | -       |
| 本期利润          | -3,399,444.34  | -       | -       |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0578  | -       | -       |
| 本期基金份额净值增长率   | -10.20%  | -       | -       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末  | 2015 年末 | 2014 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.1020  | -       | -       |
| 期末基金资产净值      | 24,897,397.16  | -       | -       |
| 期末基金份额净值      | 0.898  | -       | -       |

注：

1. 本基金合同生效日为 2016 年 1 月 20 日。本基金 2016 年度主要财务指标的计算期间为 2016 年 1 月 20 日（基金合同生效日）-2016 年 12 月 31 日。
2. 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则—第 1 号《主要财务指标的计算及披露》。
3. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
4. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。
5. 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

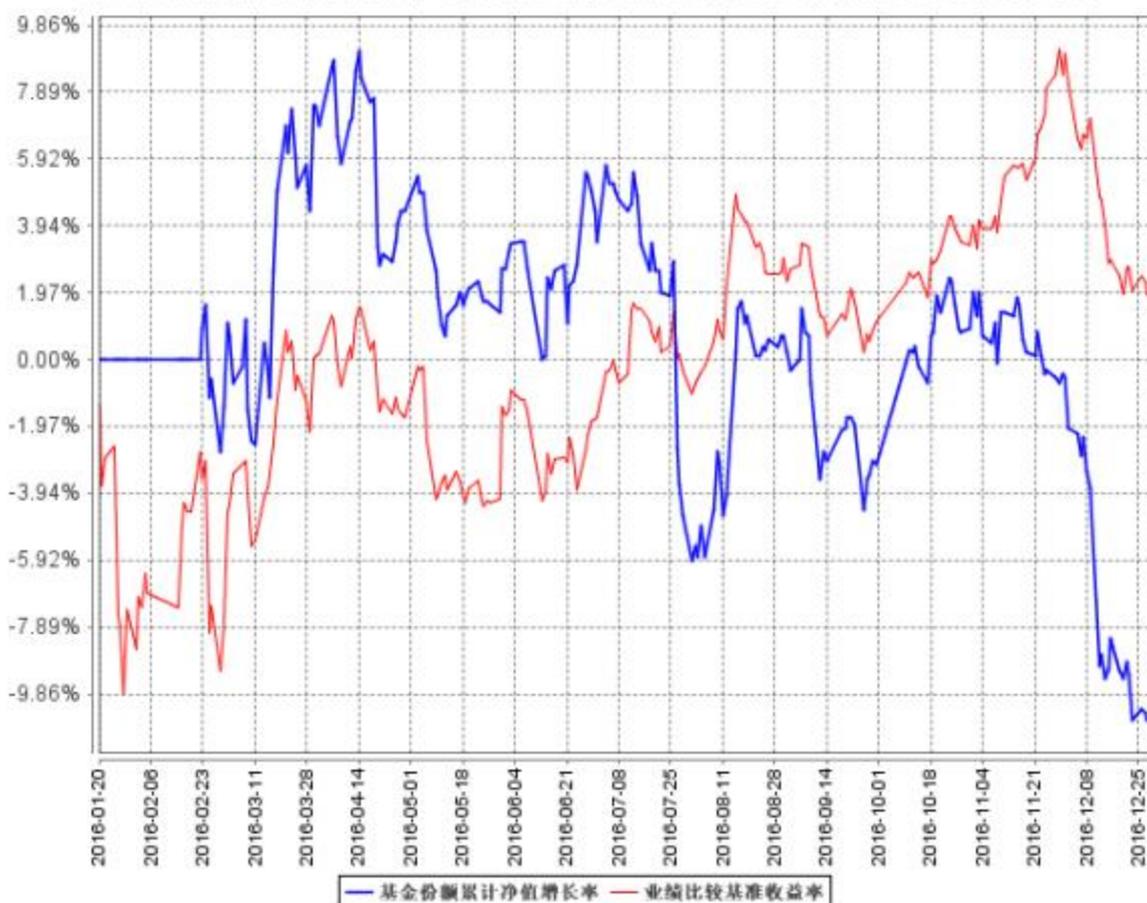
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-----|-----|
|----|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-----|-----|

|            |         |       |       |       |         |       |
|------------|---------|-------|-------|-------|---------|-------|
| 过去三个月      | -7.33%  | 1.04% | 1.12% | 0.61% | -8.45%  | 0.43% |
| 过去六个月      | -13.98% | 1.15% | 4.08% | 0.65% | -18.06% | 0.50% |
| 自基金合同生效起至今 | -10.20% | 1.16% | 2.25% | 1.00% | -12.45% | 0.16% |

### 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

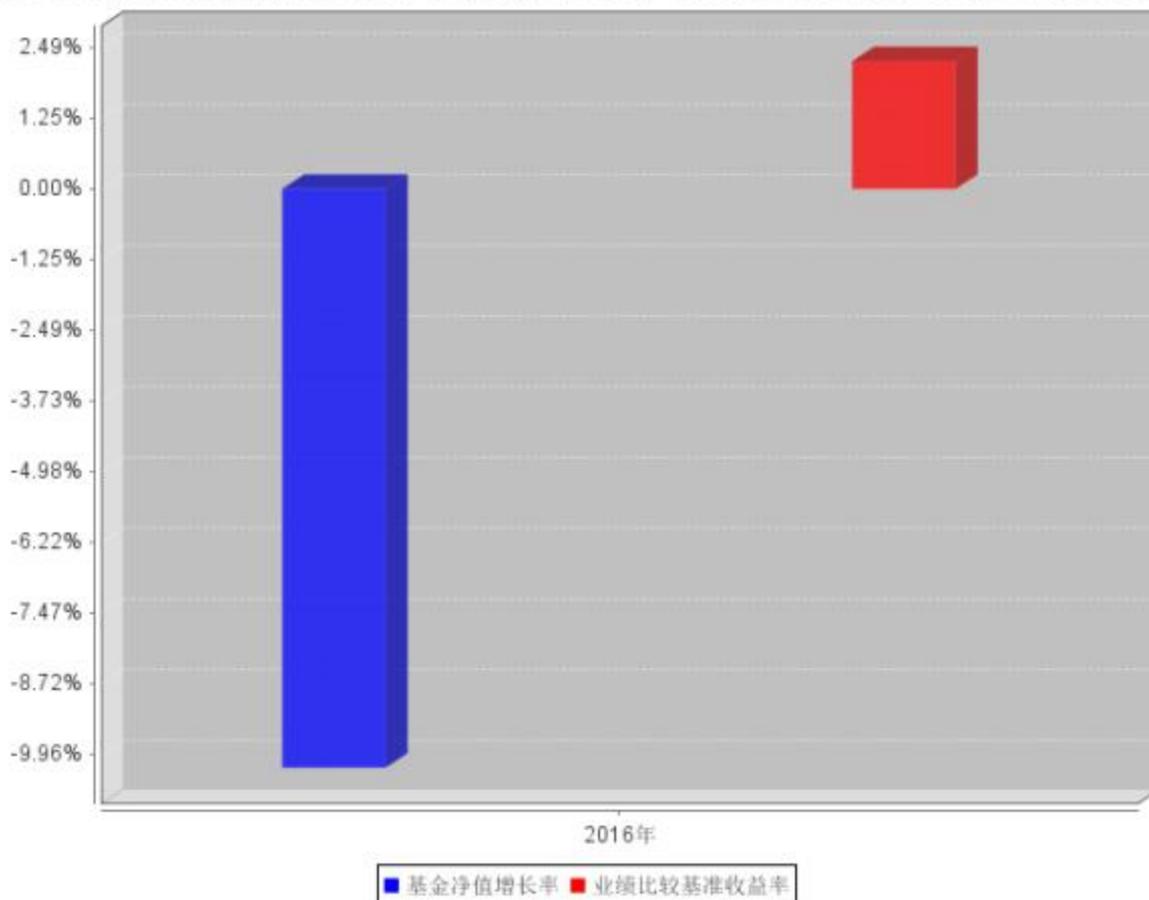
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2016 年 1 月 20 日，截至本报告期末已完成建仓，但报告期末距建仓结束不满一年。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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金成立于 2016 年 1 月 20 日，故 2016 年的业绩为成立日至年底的业绩而非全年的业绩。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度   | 每10份基金份额<br>分红数 | 现金形式发<br>放总额 | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分配合<br>计 | 备注 |
|------|-----------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 2016 | -               | -            | -             | -            |    |
| 合计   | -               | -            | -             | -            |    |

注：本基金于 2016 年 1 月 20 日成立。

## § 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 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 27 只基金产品（包含 A、B、C 类债券基金，A、B 类货币市场基金）。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务                                       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|--|-----------------|------|--------|---|
|     |  | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 卫学海 | 国富深化价值混合基金、国富沪港深成长精选股票基金及国富成长动力混合基金的基金经理 | 2016 年 1 月 20 日 | -    | 13 年   | 卫学海先生，复旦大学工程硕士。历任中国人保资产管理有限公司高级投资经理、长城证券有限责任公司高级投资经理、光大证券资产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深化价值混合基金、国富沪港深成长精选股票基金及国富成长动力混合基金的基金经理。 |

注：

1. 表中“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，其中，首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。
2. 表中“证券从业年限”的计算标准为该名员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海沪港深成长精选股票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 公平交易制度和控制方法

公司建立了《公平交易管理制度》，确保公司旗下投资组合能够得到公平对待，避免各种投资组合之间的利益输送行为。我们主要从如下几个方面对公平交易进行控制：

1. 在研究信息共享方面，投资研究等部门通过定期的例会沟通机制，就相关议题进行讨论；公司建立了统一的研究平台，研究报告信息通过研究平台进行发布。
2. 建立投资对象备选库，股票及债券的入库需要由研究报告支持作为依据，并经过相关领导审批；建立研究报告的定期更新机制。
3. 在投资决策方面，公司在各类资产管理业务之间建立防火墙，确保业务隔离及人员隔离，同时各投资组合经理投资决策保持独立。
4. 公司对所有投资组合的交易指令实行集中交易，公司在交易系统中设置公平交易功能，按照时间优先、价格优先的原则执行各账户所有指令；公司建立和完善了对债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易分配制度，以确保相关投资组合能够得到公平对待。
5. 公司建立了《同日反向交易管理办法》，通过事前审批来对反向交易进行事前控制。公司每季度对不同时间窗下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。
6. 公司定期对公平交易执行情况进行监察稽核，并在监察稽核定期报告中做专项说明。公司也会在各投资组合的定期报告中，披露公平交易制度执行情况及异常交易行为专项说明。

### 4.3.2 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。

报告期末，公司共管理了二十七只公募基金及十三只专户产品。统计所有投资组合分投资类别（股票、债券）过去连续 4 个季度内在不同时间窗口（T=1、T=3 和 T=5）存在同向交易价差的样本，并对差价率均值、交易价格占优比率、t 值、贡献率等指标进行分析，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。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司按照《异常交易监控与报告制度》，系统划分了异常交易的类型、异常交易的界定标准、异常交易的识别程序，制订了异常交易的监控办法，并规范了异常交易的分析、报告制度。

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，公司不同投资组合之间未发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况，经公司检查和分析未发现异常情况。

## 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

市场 2016 年开年后遭遇熔断，人民币汇率波动、外储大幅流失是主要诱因。一月底，在政府投资的带动下，经济有所回暖，而市场也在政策扶持下走出反弹行情。虽然上半年利空消息不断，人民币汇率波动、A 股无法加入 MSCI，英国脱欧和美国加息预期等，但市场风险偏好提升，流动性较为宽裕，市场走出一波三折的反弹行情。下半年随着经济数据更为好转，传统周期股走势显著好于成长股，存量资金活跃，保险集中举牌低估值蓝筹，市场延续了上半年的反弹行情。11 月底，随着美国开始第二次加息，市场反弹结束。全年来看，延续着 15 年见顶以后的熊市行情。全年沪深 300 下跌 11.28%，创业板指数下跌 27.71%。从大类资产角度来看，商品期货全年表现最优，A 股整体仍处于熊市状态。

国富沪港深上半年处于建仓期，采取了以绝对收益为主的投资策略，集中持股，波段操作，比较成功的避过了前两个月的市场大跌，并获取了正收益。从投资策略角度来看，运作较为成功。但随着下半年建仓期结束，仓位提升，并配置上偏成长股，导致下半年业绩不佳。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.898 元，成立以来净值下跌 10.20%，同期业绩基准上涨 2.25%，成立以来基金跑输业绩比较基准 12.45 个百分点。本基金上半年操作灵活，

仓位较低是基金跑赢比较基准的主要原因，而随着下半年建仓期结束，仓位提升，并配置上偏成长股，导致下半年业绩不佳。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，宏观经济方面，需求端持续不振，而供给端去产能较慢，传统周期行业仍在缓慢探底，经济增速仍在筑底阶段。财政政策积极，而货币政策保持中性，随着 CPI 的走高，降息空间不大，而降准仍可期。改革创新，激活资本市场的政策预计会保持不变，但市场转折点仍需等待。全年市场预计仍为结构性熊市行情，我们继续看好经济结构调整受益的行业，奉行价值投资的理念，坚持自下而上的选股策略，深度挖掘在“新经济、新技术、新模式”领域下优质公司的投资机会。

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投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据基金合同和相关法律的规定，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

本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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

本报告期内，本基金托管人在对富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金的管理人——国海富兰克林基金管理有限公司在富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国海富兰克林基金管理有限公司编制和披露的富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

会计师出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产         | 本期末              | 上年度末             |
|-------------|------------------|------------------|
|             | 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 12 月 31 日 |
| <b>资 产:</b> |                  |                  |
| 银行存款        | 4,934,852.27     | -                |
| 结算备付金       | 220,434.02       | -                |
| 存出保证金       | 25,484.14        | -                |
| 交易性金融资产     | 23,475,477.01    | -                |
| 其中：股票投资     | 23,475,477.01    | -                |
| 基金投资        | -                | -                |
| 债券投资        | -                | -                |
| 资产支持证券投资    | -                | -                |
| 贵金属投资       | -                | -                |
| 衍生金融资产      | -                | -                |
| 买入返售金融资产    | -                | -                |
| 应收证券清算款     | 3,172,064.05     | -                |
| 应收利息        | 762.70           | -                |
| 应收股利        | -                | -                |
| 应收申购款       | 1,093.44         | -                |
| 递延所得税资产     | -                | -                |
| 其他资产        | -                | -                |
| 资产总计        | 31,830,167.63    | -                |

| 负债和所有者权益    | 本期末              | 上年度末             |
|-------------|------------------|------------------|
|             | 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 12 月 31 日 |
| <b>负 债:</b> |                  |                  |
| 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     | 1.13             | -                |
| 应付赎回款       | 6,622,989.18     | -                |
| 应付管理人报酬     | 47,139.69        | -                |
| 应付托管费       | 7,856.61         | -                |
| 应付销售服务费     | -                | -                |
| 应付交易费用      | 83,147.34        | -                |
| 应交税费        | -                | -                |

|               |               |   |
|---------------|---------------|---|
| 应付利息          | -             | - |
| 应付利润          | -             | - |
| 递延所得税负债       | -             | - |
| 其他负债          | 171,636.52    | - |
| 负债合计          | 6,932,770.47  | - |
| <b>所有者权益:</b> |               |   |
| 实收基金          | 27,724,756.14 | - |
| 未分配利润         | -2,827,358.98 | - |
| 所有者权益合计       | 24,897,397.16 | - |
| 负债和所有者权益总计    | 31,830,167.63 | - |

注:

- 1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.898 元，基金份额总额 27,724,756.14 份。
- 2、本财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 20 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目        | 本期<br>2016 年 1 月 20 日(基<br>金合同生效日)至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|---|--|
| 一、收入       | -1,612,671.23   | -  |
| 1. 利息收入    | 469,229.17  | -  |
| 其中：存款利息收入  | 193,806.27  | -  |
| 债券利息收入     | -   | -  |
| 资产支持证券利息收入 | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入 | 275,422.90  | -  |
| 其他利息收入     | -   | -  |

|                        |               |   |
|------------------------|---------------|---|
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      | -1,883,046.11 | - |
| 其中：股票投资收益              | -1,975,324.21 | - |
| 基金投资收益                 | -             | - |
| 债券投资收益                 | -             | - |
| 资产支持证券投资收益             | -             | - |
| 贵金属投资收益                | -             | - |
| 衍生工具收益                 | -             | - |
| 股利收益                   | 92,278.10     | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -1,336,147.77 | - |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -             | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 1,137,293.48  | - |

|                     |               |   |
|---------------------|---------------|---|
| 减：二、费用              | 1,786,773.11  | - |
| 1. 管理人报酬            | 878,881.45    | - |
| 2. 托管费              | 146,480.19    | - |
| 3. 销售服务费            | -             | - |
| 4. 交易费用             | 498,076.18    | - |
| 5. 利息支出             | -             | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出       | -             | - |
| 6. 其他费用             | 263,335.29    | - |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -3,399,444.34 | - |
| 减：所得税费用             | -             | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   | -3,399,444.34 | - |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                       | 本期   |               |                |
|--------------------------|--|---------------|----------------|
|                          | 2016 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 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）          | 259,399,120.47                             | -             | 259,399,120.47 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | -  | -3,399,444.34 | -3,399,444.34  |

|  |                 |               |                 |
|--|-----------------|---------------|-----------------|
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | -231,674,364.33 | 572,085.36    | -231,102,278.97 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 67,727,377.54   | 1,095,221.45  | 68,822,598.99   |
| 2. 基金赎回款                               | -299,401,741.87 | -523,136.09   | -299,924,877.96 |
| 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)                        | 27,724,756.14   | -2,827,358.98 | 24,897,397.16   |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）                        | -   | -     | -       |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | -     | -       |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列）  | -   | -     | -       |
| 其中：1. 基金申购款                            | -   | -     | -       |
| 2. 基金赎回款                               | -   | -     | -       |
| 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）                        | -   | -     | -       |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 吴显玲      | 吴显玲       | 黄宇虹     |
| _____    | _____     | _____   |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金(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]1338 号《关于准予富兰克林国海沪港深成长

精选股票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《富兰克林国海沪港深成长精选股票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 2015 年 12 月 21 日至 2016 年 1 月 15 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 259,377,419.75 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 074 号验资报告予以验证。经向中国证监会备

案,《富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金基金合同》于 2016 年 1 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 259,399,120.47 份基金份额,其中认购资金利息折合 21,700.72 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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、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)。本基金可根据法律法规和监管机构的规定投资沪港通允许投资的在香港联合交易所上市的股票(包括恒生综合大型股指数的成份股、恒生综合中型股指数的成份股和同时在香港联合交易所、上海证券交易所上市的 A+H 股,其中前述指数成分股内发行人同时在上海证券交易所以外的内地证券交易所上市的 H 股除外。如港股通的股票范围增加、减少或变更,本基金的投资范围将根据有关法律法规作相应调整)。本基金的投资组合比例为:股票资产投资比例为基金资产的 80%-95%;债券、货币市场工具、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具投资比例为基金资产的 5%-20%,其中,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%;权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%;投资于香港市场的股票比例不超过基金资产的 50%。本基金的业绩比较基准为:85% × 沪深 300 指数收益率 + 15% × 中债国债总指数收益率(全价)。

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 2017 年 3 月 23 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《富兰克林国海沪港深成长精选

股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 20 日 (基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 20 日 (基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 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一致。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、

财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

以上内容仅为本文档的试下载部分，为可阅读页数的一半内容。如要下载或阅读全文，请访问：

<https://d.book118.com/547130163121010006>