

富兰克林国海新价值灵活配置混合型证券  
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：招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。

基金托管人招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 1 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	国富新价值混合	
基金主代码	002097	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 12 月 2 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	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	195,343,532.51 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国富新价值混合 A	国富新价值混合 C
下属分级基金的交易代码:	002097	002098
报告期末下属分级基金的份额总额	998,198.58 份	194,345,333.93 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	<p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>本基金从宏观经济环境、国家政策导向、产业转型与变革等多个角度，积极挖掘符合中国经济增长和资本市场发展机遇，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。</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) 股票申购策略</p> <p>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。</p>
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高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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	张燕
	联系电话	021-3855 5555	0755-8319 9084
	电子邮箱	service@ftsfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555	95555
传真		021-6888 3050	0755-8319 5201

### 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		2015 年 12 月 2 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日		2014 年	
	国富新价值混合 A	国富新价值混合 C	国富新价值混合 A	国富新价值混合 C	国富新价值混合 A	国富新价值混合 C
本期已实现收益	19,874.62	15,852,574.37	2,682.71	1,231,101.91	-	-
本期利润	12,571.31	12,987,647.16	2,894.53	1,345,117.22	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0214	0.0271	0.0053	0.0045	-	-
本期基金份额净值增长率	3.58%	2.79%	0.50%	0.40%	-	-
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	0.0413	0.0323	0.0050	0.0041	-	-
期末基金资产净值	1,039,467.42	200,616,725.55	515,703.47	302,150,495.92	-	-
期末基金份额净值	1.041	1.032	1.005	1.004	-	-

注：

1. 本基金合同生效日为 2015 年 12 月 2 日。本基金 2015 年度主要财务指标的计算期间为 2015 年 12 月 2 日(基金合同生效日)-2015 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

国富新价值混合 A

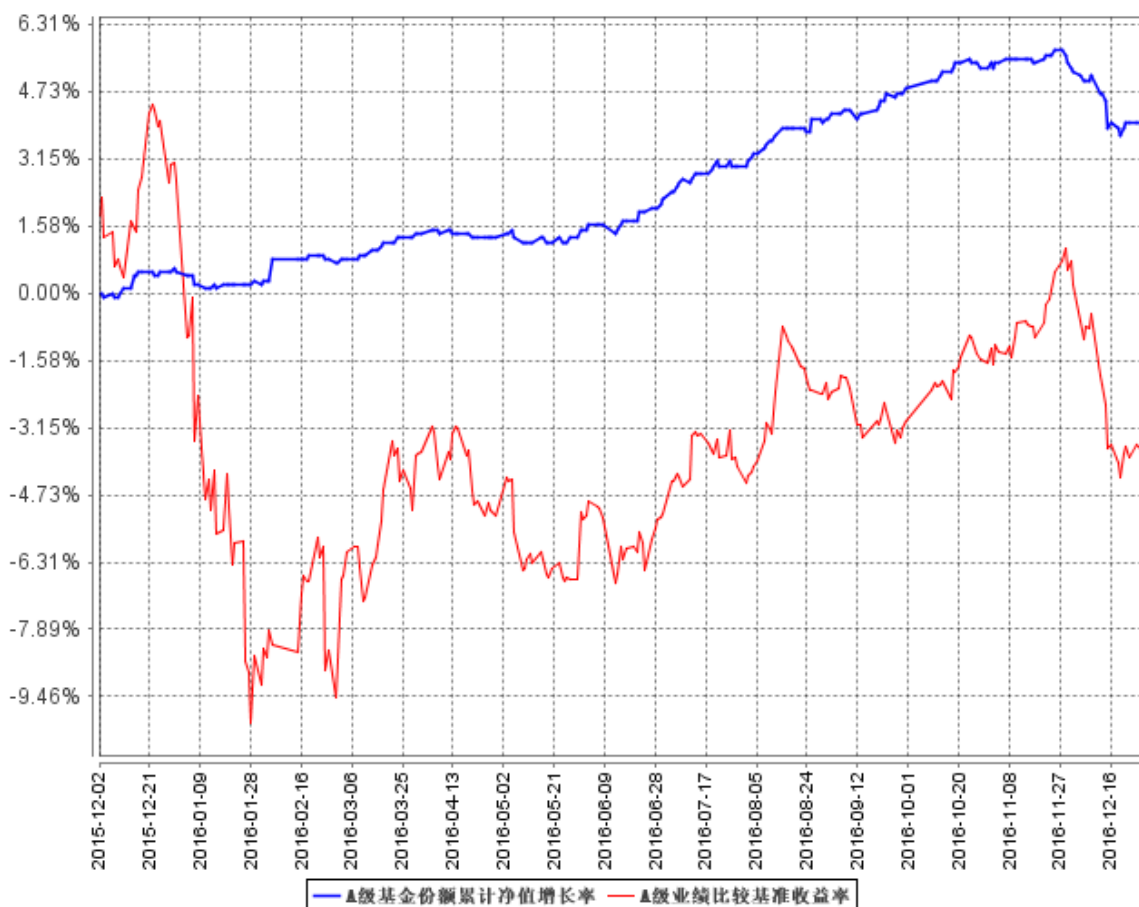
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.67%	0.12%	-0.34%	0.40%	-0.33%	-0.28%
过去六个月	1.96%	0.11%	2.02%	0.41%	-0.06%	-0.30%
过去一年	3.58%	0.09%	-5.81%	0.71%	9.39%	-0.62%
自基金合同生效起至今	4.10%	0.09%	-3.33%	0.71%	7.43%	-0.62%

国富新价值混合 C

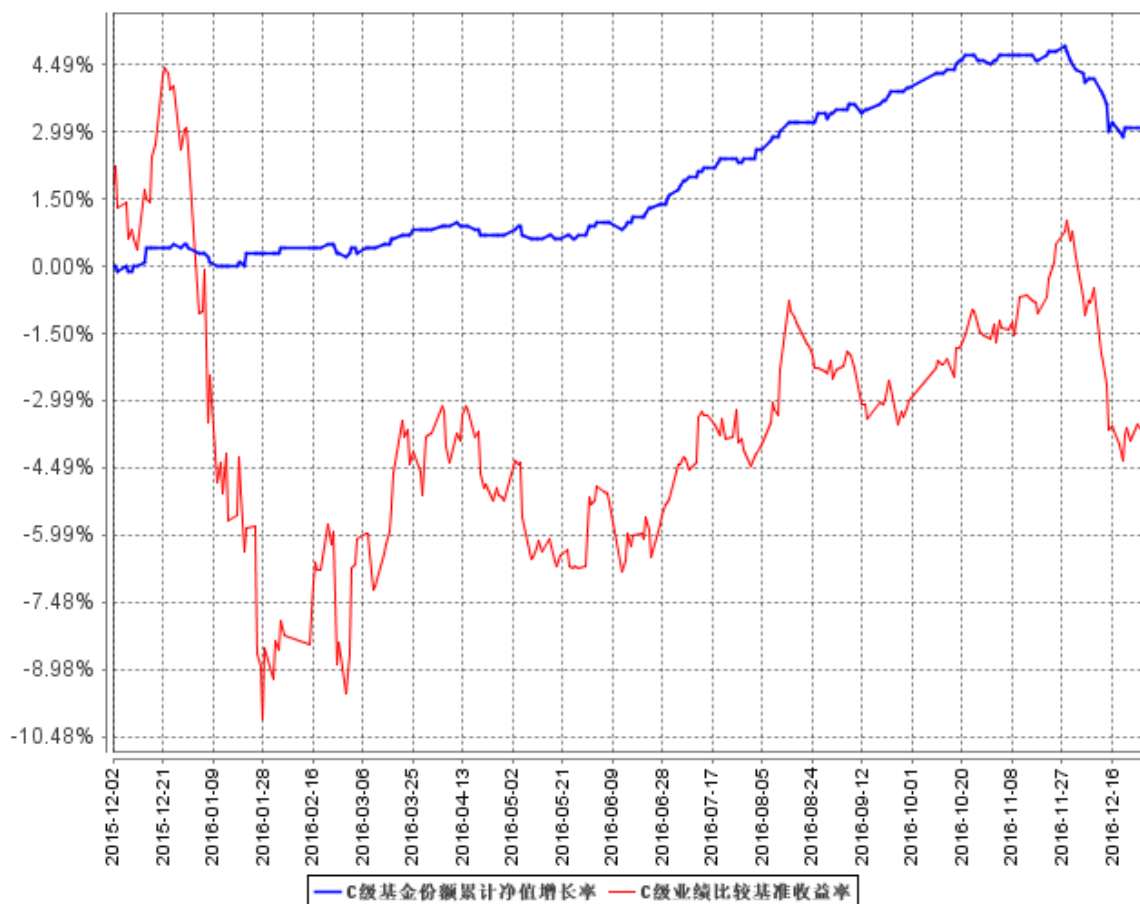
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.77%	0.12%	-0.34%	0.40%	-0.43%	-0.28%
过去六个月	1.67%	0.10%	2.02%	0.41%	-0.35%	-0.31%
过去一年	2.79%	0.09%	-5.81%	0.71%	8.60%	-0.62%
自基金合同生效起至今	3.20%	0.09%	-3.33%	0.71%	6.53%	-0.62%

### 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

**A级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**



C级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

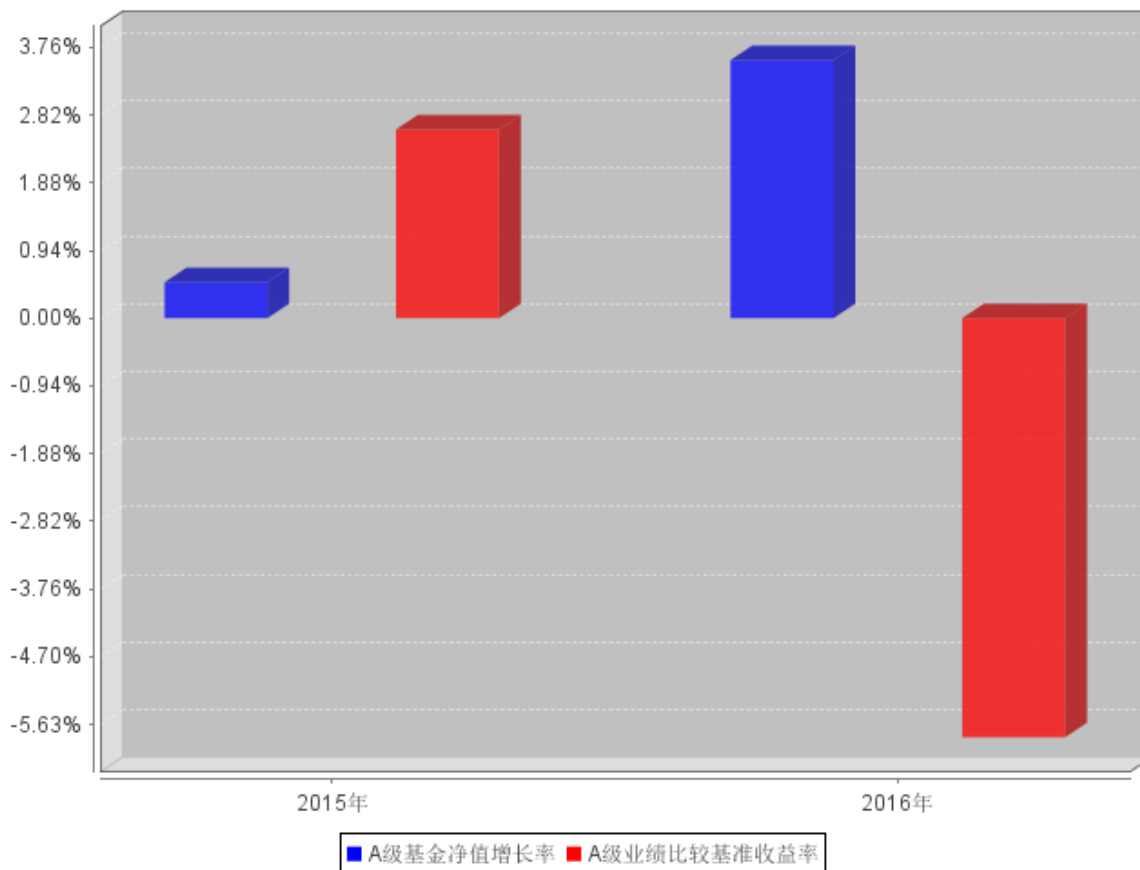


注：本基金的基金合同生效日为 2015 年 12 月 2 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

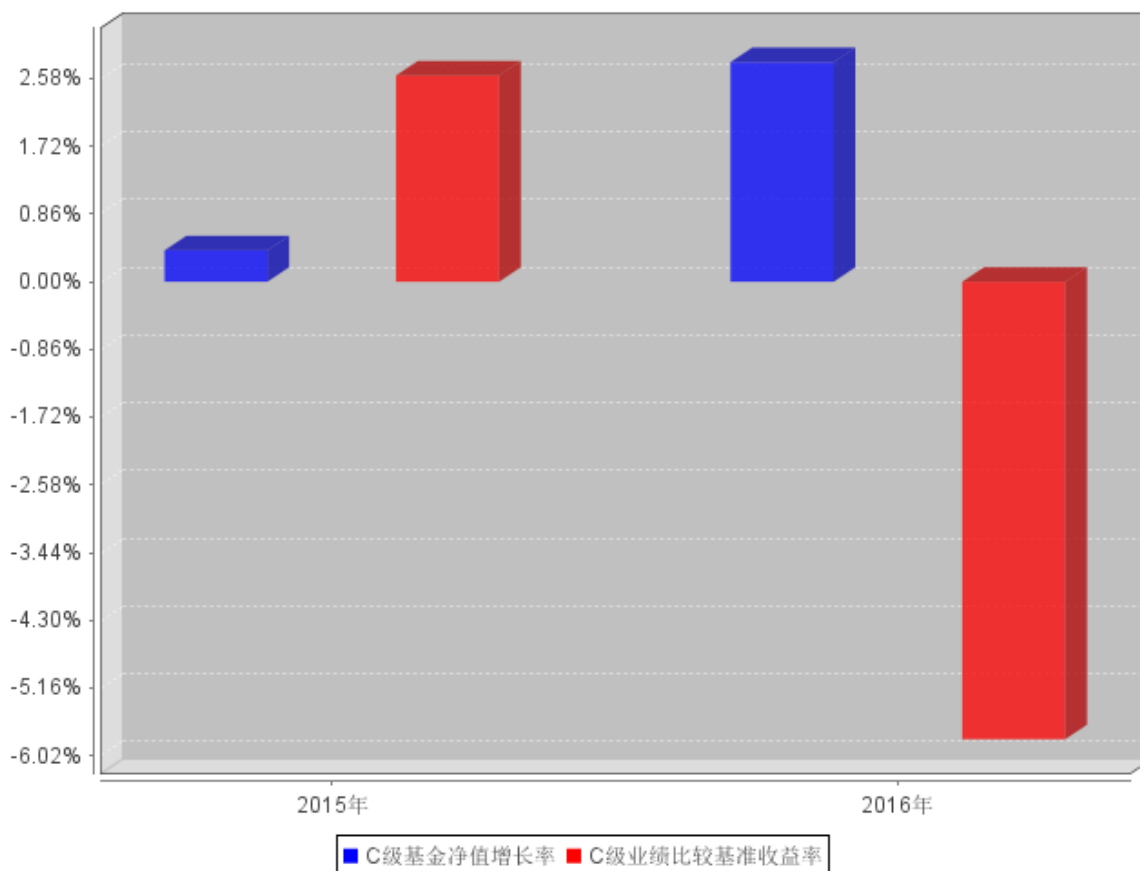


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

**A级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**



### C级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 2015 年 12 月 2 日，故 2015 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

国富新价值混合 A					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

单位：人民币元

国富新价值混合 C					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

注：本基金于 2015 年 12 月 2 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		
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及国富	2015 年 12 月 2 日	-	11 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及国富新活力混合基金的基金经理。

	新活力混合基金的基金经理				
胡永燕	国富日日收益货币基金、国富恒丰定期债券基金、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及国富新活力混合基金的基金经理	2015年12月2日	-	8年	胡永燕女士，中国人民大学金融学硕士。历任华泰资产管理有限公司固定收益组合管理部研究员、投资助理及投资经理，并曾在国海富兰克林基金管理有限公司负责公司投资管理部固定收益小组固定收益类产品的投资与研究。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富日日收益货币基金、国富恒丰定期债券基金、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及国富新活力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及国富新活力混合基金的基金经理	2016年8月6日	-	9年	邓钟锋先生，厦门大学金融学硕士。历任深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及国富新活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《富兰克林国海新价值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。由于未按时足额缴付认购资金，本基金于 2016 年 12 月 1 日至 2017 年 5 月 31 日期间被列入首次公开发行股票网下配售对象黑名单，在此期间，本基金继续通过上市公司网上公开发行参与新股投资。公司对此采取了加强管理的措施。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

2016 年权益市场大幅波动，不同板块体现不同跌幅，大盘蓝筹总体表现相对抗跌，创业板处于挤泡沫阶段，下跌幅度相对较高。上证综指全年下跌 12.31%，以成长型公司为代表的创业板指数下跌 27.71%。经历年初大幅下跌后，全年股市以修复为主，但进入 12 月后受央行货币转向预期、债券市场下跌及年底汇率波动的影响权益市场整体调整较大。债券市场全年大幅波动，主要是受到资产荒驱动、央行调节流动性等因素影响。年末的金融去杠杆引发流动性危机，债券估值大幅下调，组合债券估值受到较大影响。

2016 年全年本基金以低权益仓位操作，权益组合以低估值高分红的大盘蓝筹股为主要配置；债券仓位总体保持中性配置，债券组合以中短期高等级为主要品种。

### 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 A 净值为 1.041 元，净值增长 3.58%，同期业绩基准同期下跌 5.81%，本报告期内基金跑赢业绩比较基准 9.39 个百分点；本基金份额 C 净值为 1.032 元，净值增长 2.79%，同期业绩基准同期下跌 5.81%，本报告期内基金跑赢业绩比较基准 8.6 个

百分点。本基金 2016 度债券配置比例高于业绩比较基准,是基金在报告期内跑赢业绩比较基准的主要原因。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年总体而言,市场机会偏少,考虑到全球混乱的政策预期及经济可能再度触顶回落,市场总体的风险偏好预计将继续下降,权益市场的超额收益预计以供给侧改革带来的部分行业盈利恢复为主线,避险资产可能更受欢迎。债券市场存在机会,但需等待自去年四季度启动的库存周期回落,及美联储结束快速加息的进程。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,本基金管理人进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程,严格开展对基金相关法律文件和对外宣传资料的合规审核,积极加强对各部门、各主要运作环节的风险监控,并通过定期稽核和专项稽核,及时发现需要完善的业务环节,并落实措施。报告期内,本基金管理人特别关注基金投资研究交易、市场销售以及运营的合法合规和风险控制,对保护投资者利益涉及的各项业务环节以及信息技术安全开展了专项自查和采取控制措施。同时,本基金管理人开展多层次的员工合规教育和日常提示等措施,强化员工风控意识,努力营造合规经营文化。此外,本基金管理人依照规定,及时向监管部门、董事会报送监察稽核报告。

报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规,保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将继续深入分析和识别市场变化和潜在风险,积极采取措施,加强事前、事中和事后的内部控制,提高监察稽核工作的科学性和有效性。

#### 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份额持有人数量不满 200 人的情形。



## § 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人--招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 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：富兰克林国海新价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	183,000,693.07	26,614,429.85
结算备付金	353,561.17	-
存出保证金	27,445.19	-
交易性金融资产	118,034,657.41	20,388,927.32
其中：股票投资	2,894,584.00	5,189,425.02
基金投资	-	-
债券投资	115,140,073.41	15,199,502.30
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	-	135,000,000.00
应收证券清算款	-	120,024,419.57
应收利息	2,513,403.74	940,571.84
应收股利	-	-
应收申购款	-	499.50
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	303,929,760.58	302,968,848.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<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	-	-
应付赎回款	101,563,290.47	8,549.98
应付管理人报酬	247,878.97	144,008.43
应付托管费	41,313.15	24,001.44
应付销售服务费	103,515.47	71,875.03
应付交易费用	45,557.08	39,060.41
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	272,012.47	15,153.40
负债合计	102,273,567.61	302,648.69
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	195,343,532.51	301,318,594.10
未分配利润	6,312,660.46	1,347,605.29
所有者权益合计	201,656,192.97	302,666,199.39
负债和所有者权益总计	303,929,760.58	302,968,848.08

注：

1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，国富新价值灵活基金 A 类基金份额净值 1.041 元，C 类基金份额净值 1.032 元；基金份额总额 195,343,532.51 份，其中 A 类基金份额 998,198.58 份，C 类基金份额 194,345,333.93 份。于 2015 年 12 月 31 日，国富新价值灵活基金 A 类基金份额净值 1.005 元，C 类基金份额净值 1.004 元；基金份额总额 301,318,594.10 份，其中 A 类基金份额 512,948.43 份，C 类基金份额 300,805,645.67 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年度和 2015 年 12 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海新价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	18,495,323.14	1,665,756.41
1.利息收入	20,530,851.49	517,171.23
其中：存款利息收入	1,151,270.86	79,296.97
债券利息收入	17,747,195.91	54,932.83
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,632,384.72	382,941.43
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	833,519.11	1,033,148.91
其中：股票投资收益	8,919,091.63	1,033,148.91
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-8,256,471.88	-
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	170,899.36	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,872,230.52	114,227.13
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	3,183.06	1,209.14
<b>减：二、费用</b>	<b>5,495,104.67</b>	<b>317,744.66</b>
1. 管理人报酬	2,942,607.35	144,008.43
2. 托管费	490,434.53	24,001.44
3. 销售服务费	1,449,334.10	71,875.03
4. 交易费用	284,696.45	62,308.24
5. 利息支出	16,471.31	-
其中：卖出回购金融资产支出	16,471.31	-
6. 其他费用	311,560.93	15,551.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>13,000,218.47</b>	<b>1,348,011.75</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>13,000,218.47</b>	<b>1,348,011.75</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海新价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 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）	301,318,594.10	1,347,605.29	302,666,199.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,000,218.47	13,000,218.47
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）	-105,975,061.59	-8,035,163.30	-114,010,224.89
其中：1. 基金申购款	694,598,595.16	7,578,570.82	702,177,165.98

2. 基金赎回款	-800,573,656.75	-15,613,734.12	-816,187,390.87
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）	195,343,532.51	6,312,660.46	201,656,192.97
项目	上年度可比期间 2015年12月2日(基金合同生效日)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）	301,369,848.47	-	301,369,848.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,348,011.75	1,348,011.75
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）	-51,254.37	-406.46	-51,660.83
其中：1. 基金申购款	169,493.62	308.17	169,801.79
2. 基金赎回款	-220,747.99	-714.63	-221,462.62
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）	301,318,594.10	1,347,605.29	302,666,199.39

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：

<u>                    </u> 吴显玲	<u>                    </u> 吴显玲	<u>                    </u> 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

富兰克林国海新价值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]1757号文《关于准予富兰克林国海新价值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《富兰克林国海新价值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，首次募集期间为自 2015 年 11 月 27 日至 2015 年 11 月 30 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 301,363,844.52 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2015)第 1313 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 301,369,848.47 份基金份额，其中认购资金利息折合 6,003.95 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，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

根据《富兰克林国海新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《富兰克林国海新价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，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《富兰克林新价值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)。本基金的投资组合比例为：：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\*50%+中债国债总指数收益率(全价)\*50%。

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》、《富兰克林国海新价值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 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 年度和 2015 年 12 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的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 日和 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度和 2015 年 12 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 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 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明。

### 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[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》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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

#### 7.4.7 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
邓普顿国际股份有限公司（Templeton International, Inc.）	基金管理人的股东
国海富兰克林资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年12月2日(基金合同生效日)至 2015年12月31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	156,979,545.82	89.36%	42,861,979.32	100.00%

#### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31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	162,400.06	89.51%	42,969.02	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年12月2日(基金合同生效日)至2015年12月31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	39,060.41	100.00%	39,060.41	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。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 2 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,942,607.35	144,008.43
其中：支付销售机构的客户维护费	2,796.25	248.05

注：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按前一日基金资产净值 0.60% 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 × 0.60% ÷ 当年天数。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 2 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	490,434.53	24,001.44

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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 × 0.1% ÷ 当年天数。

### 7.4.8.2.3 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		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富新价值混合 A	国富新价值混合 C	合计
国海证券股份有限公司	-	40.37	40.37
国海富兰克林基金管理有限公司	-	1,447,816.00	1,447,816.00
合计	-	1,447,856.37	1,447,856.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 12 月 2 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富新价值混合 A	国富新价值混合 C	合计
国海证券股份有限公司	-	5.22	5.22
国海富兰克林基金管理有限公司	-	71,683.78	71,683.78
合计	-	71,689.00	71,689.00

注：

1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值的年费率 0.3% 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：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值  $\times$  0.3%  $\div$  当年天数。

2、根据《国海富兰克林基金管理有限公司关于富兰克林国海新价值灵活配置混合型证券投资基金销售费率优惠的公告》，2016 年 12 月 23 日至 2017 年 6 月 22 日期间对富兰克林国海新价值灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额（简称“国富新价值 C”，代码：002098）实行销售费率优惠。优惠期间销售服务费率由原先的 0.30% 调整为 0.10%。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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（基金合同生效日 2015 年 12 月 2 日至 2015 年 12 月 31 日）基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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（2015 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。

### 7.4.8.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 12 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	183,000,693.07	607,710.09	26,614,429.85	79,295.97

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

## 7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券等流通受限股票。

### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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 成本总额	期末估值总额	备注
600859	王府井	2016 年 9 月 27 日	重大 资产 重组 停牌	16.28	-	-	177,800	2,998,942.00	2,894,584.00	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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牌的股票，该类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。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.10 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。

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 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 118,034,657.41 元，无属于第一层次和第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 5,189,425.02 元，第二层次 15,199,502.30 元，无属于第三层次的余额)。

##### (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。

##### (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

##### (c) 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	2,894,584.00	0.95
	其中：股票	2,894,584.00	0.95
2	固定收益投资	115,140,073.41	37.88
	其中：债券	115,140,073.41	37.88
	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	183,354,254.24	60.33
7	其他各项资产	2,540,848.93	0.84
8	合计	303,929,760.58	100.00

注：本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,894,584.00	1.44
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	-	-
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	2,894,584.00	1.44

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600859	王府井	177,800	2,894,584.00	1.44

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	600794	保税科技	5,916,855.00	1.95
2	002553	南方轴承	5,847,857.00	1.93
3	601857	中国石油	4,998,578.00	1.65
4	600305	恒顺醋业	4,295,672.00	1.42
5	601939	建设银行	4,099,548.00	1.35
6	002029	七匹狼	3,658,414.00	1.21
7	002308	威创股份	3,507,306.00	1.16
8	601998	中信银行	3,278,817.00	1.08
9	600859	王府井	2,998,942.00	0.99
10	300133	华策影视	2,997,204.20	0.99
11	601169	北京银行	2,388,490.00	0.79
12	600978	宜华生活	2,346,854.00	0.78
13	601588	北辰实业	2,299,644.00	0.76
14	002042	华孚色纺	2,299,172.24	0.76



15	002761	多喜爱	2,194,612.00	0.73
16	600970	中材国际	2,051,566.94	0.68
17	600750	江中药业	1,810,494.00	0.60
18	601566	九牧王	1,803,661.00	0.60
19	603008	喜临门	1,798,336.00	0.59
20	000926	福星股份	1,561,540.00	0.52

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。

#### 8.4.2 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	600794	保税科技	6,742,842.09	2.23
2	002553	南方轴承	6,391,208.08	2.11
3	601857	中国石油	5,096,625.28	1.68
4	002308	威创股份	4,617,962.39	1.53
5	600305	恒顺醋业	4,500,791.37	1.49
6	601939	建设银行	4,208,902.40	1.39
7	002029	七匹狼	3,688,391.00	1.22
8	601998	中信银行	3,482,920.00	1.15
9	300133	华策影视	2,912,872.95	0.96
10	601169	北京银行	2,654,449.94	0.88
11	002042	华孚色纺	2,448,433.56	0.81
12	601588	北辰实业	2,250,639.48	0.74
13	002761	多喜爱	2,245,656.00	0.74
14	600970	中材国际	2,190,490.30	0.72
15	600978	宜华生活	2,125,531.62	0.70
16	600750	江中药业	2,010,179.60	0.66
17	601566	九牧王	1,923,298.00	0.64
18	600313	农发种业	1,687,920.50	0.56
19	600467	好当家	1,655,776.21	0.55
20	603008	喜临门	1,589,760.00	0.53

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。

#### 8.4.3 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	83,447,128.61
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	94,403,416.33
--------------	---------------

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。

### 8.5 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	105,274,073.41	52.20
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,866,000.00	4.89
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	115,140,073.41	57.10

### 8.6 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	136211	16 恒力 01	150,000	14,913,000.00	7.40
2	112281	15 中洲债	99,360	10,014,494.40	4.97
3	112267	15 阳房 02	100,280	9,973,848.80	4.95
4	112367	16 华西 01	100,000	9,892,000.00	4.91
5	112220	14 福星 01	90,110	9,685,923.90	4.80

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1 本基金本期投资的前十名证券中，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、处罚的证券如下：**

凯迪生态环境科技股份有限公司（以下简称“凯迪生态”）因信息披露存在违规现象而收到深交所出具的监管函。湖北证监局在现场检查中发现，金湖科技与凯迪生态大股东阳光凯迪在人员、资金等方面存在特殊关系。按照实质重于形式的原则，金湖科技应为阳光凯迪和凯迪生态的关联方，而凯迪生态并未及时披露与金湖科技的关联关系。除此之外，深交所发现凯迪生态 2015 年年度报告披露财务总监任职信息与事实不符。凯迪生态原财务总监汪军于 2015 年 11 月 30 日已向凯迪生态提出辞职，凯迪生态于 2015 年 12 月 8 日向汪军出具了《离职证明》。然而凯迪生态 2016 年 7 月 14 日《关于财务总监变更的公告》中关于汪军先生辞职时间的表述，与事实不符。

凯迪生态表示，将严格按照湖北证监局的要求，积极整改，切实提高规范运作意识和提升信息披露水平。整改情况和报告将及时上报湖北证监局，并接受湖北证监局的检查和验收。凯迪生态及全体董事、监事和高级管理人员将以此为戒，认真学习上市公司法律法规和规范性文件，严格按照法律法规的要求，规范运作，并及时、准确、完整地履行好信息披露义务。

本基金对 11 凯迪债的投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件对凯迪生态的经营影响有限，对其偿债能力并无重大负面影响。

**8.12.2 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。**

## 8.12.3 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	27,445.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,513,403.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,540,848.93

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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	600859	王府井	2,894,584.00	1.44	重大资产重组停牌

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
国富新价值混合 A	91	10,969.22	-	-	998,198.58	100.00%
国富新价值混合 C	146	1,331,132.42	193,986,420.95	99.82%	358,912.98	0.18%
合计	237	824,234.31	193,986,420.95	99.31%	1,357,111.56	0.69%

### 9.2 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	国富新价值混合 A	5,002.61	0.501164%
	国富新价值混合 C	1,488.36	0.000766%
	合计	6,490.97	0.003323%

### 9.3 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	国富新价值混合 A	0
	国富新价值混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国富新价值混合 A	0~10
	国富新价值混合 C	0~10
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富新价值混合 A	国富新价值混合 C
基金合同生效日（2015 年 12 月 2 日）基金份额总额	550,347.83	300,819,500.64
本报告期期初基金份额总额	512,948.43	300,805,645.67
本报告期基金总申购份额	1,184,644.87	693,413,950.29
减:本报告期基金总赎回份额	699,394.72	799,874,262.03
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	998,198.58	194,345,333.93

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

1、经国海富兰克林基金管理有限公司 2015 年股东会第八次会议审议通过，自 2016 年 1 月 4 日起，吴显玲女士不再担任公司董事长，由 Gregory E. McGowan 先生担任公司董事长。相关公告已于 2016 年 1 月 9 日在《中国证券报》和公司网站披露。

2、经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第二十二次会议审议通过，自 2016 年 1 月 7 日起，吴显玲女士担任公司总经理，全面主持经营管理工作。相关公告已于 2016 年 1 月 9 日在《中国证券报》和公司网站披露。

3、经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第二十六次会议审议通过，自 2016 年 12 月 7 日起，王雷先生担任公司副总经理。相关公告已于 2016 年 12 月 9 日在《中国证券报》和公司网站披露。

4、经公司决定，同意增聘邓钟锋先生为富兰克林国海新价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与现任基金经理胡永燕女士及吴西燕女士共同管理该基金。公司已办理完成上述基金经理的变更手续。详情请参阅 2016 年 8 月 6 日相关公告。

#### (二) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人应支付给会计师事务所的审计费用是人民币 72,000.00 元，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。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### (一) 基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

### (二) 基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	156,979,545.82	89.36%	145,372.36	89.51%	-
东北证券	1	18,685,029.64	10.64%	17,027.70	10.49%	-

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, 本基金新增东北证券深圳交易单元 1 个。

### 11.7.2 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	482,650,681.27	97.08%	2,286,200,000.00	100.00%	-	-
东北证券	14,502,334.56	2.92%	-	-	-	-

国海富兰克林基金管理有限公司

2017年3月28日