

富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金
2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 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。本中期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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	62

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国富焦点驱动混合
基金主代码	000065
交易代码	000065
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 5 月 7 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	111,948,594.76 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极进行资产配置和灵活运用多种投资策略，并通过深入挖掘和把握市场投资机会来确定本基金的投资焦点，同时合理控制组合风险，力争获取较高的绝对回报。
投资策略	本基金贯彻“自上而下”的资产配置策略。在进行资产配置时，重点考察宏观经济状况、国家政策、资金流动性、资产估值水平和市场因素这五个方面。在股票投资上，本基金所关注的投资焦点将从宏观经济、政策制度、行业发展前景及地位、公司治理结构和管理层评价、核心竞争力、盈利能力和估值等多个角度进行挖掘。在债券投资策略上，本基金采取久期调整、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。 本基金也可进行股指期货及权证投资。
业绩比较基准	60% × 沪深 300 指数收益率 + 40% × 中债国债总指数收益率（全价）
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中风险收益特征的证券投资基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	秦一楠
	联系电话	021-3855 5555	010-6606 0069

	电子邮箱	service@ftsfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555	95599
传真		021-6888 3050	010-6812 1816
注册地址		广西南宁市西乡塘区总部 路 1 号中国-东盟科技企业 孵化基地一期 A-13 栋三层 306 号房	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 9 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		吴显玲	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	www.ftsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国海富兰克林基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海 国金中心二期 9 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	208,288,063.38
本期利润	78,702,935.83
加权平均基金份额本期利润	0.1255
本期加权平均净值利润率	6.52%
本期基金份额净值增长率	9.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	114,621,930.09
期末可供分配基金份额利润	1.0239
期末基金资产净值	226,570,524.85
期末基金份额净值	2.024
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	128.86%

注：

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

3.2 基金净值表现

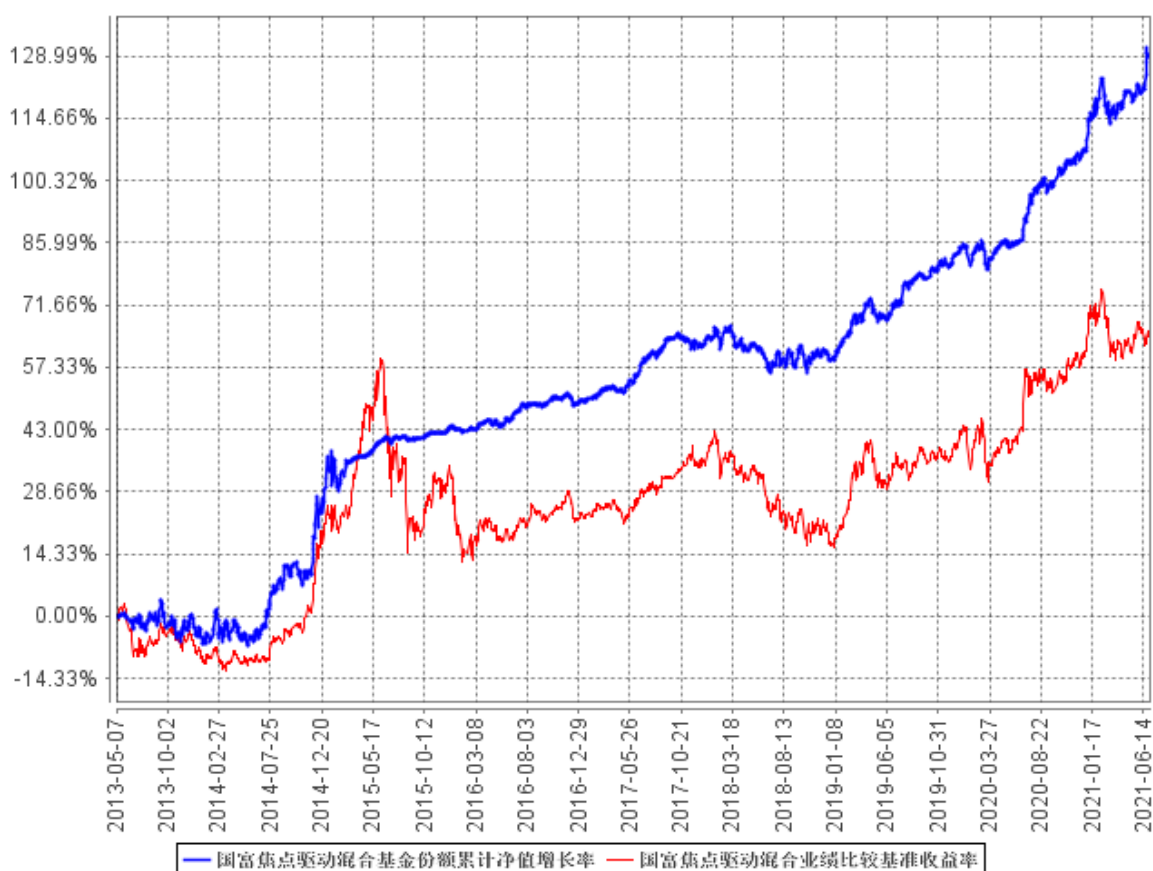
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.05%	0.49%	-1.34%	0.49%	4.39%	0.00%
过去三个月	5.69%	0.37%	2.30%	0.59%	3.39%	-0.22%
过去六个月	9.11%	0.47%	0.65%	0.79%	8.46%	-0.32%

过去一年	22.22%	0.40%	14.75%	0.79%	7.47%	-0.39%
过去三年	44.78%	0.38%	30.73%	0.81%	14.05%	-0.43%
自基金合同生效起至今	128.86%	0.55%	65.29%	0.88%	63.57%	-0.33%

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

国富焦点驱动混合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 2013 年 5 月 7 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国海富兰克林基金管理有限公司成立于 2004 年 11 月，由国海证券股份有限公司和富兰克林邓普顿投资集团全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建，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。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，在全球市场具备超过 70 年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿投资集团享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系，借助国海证券股份有限公司的综合业务优势，力争成为国内一流的基金管理公司。

国海富兰克林基金管理有限公司具有丰富的基金管理经验，截至 2021 年 6 月末，公司旗下合计管理 36 只公募基金产品。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵晓东	公司权益投资总监、职工监事，国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金、国富弹性市值混合基金、国富恒瑞债券基金、国富基本面优选混合基金、国富兴海回报混合基金及国富竞争优势三年持有期混合基金的基金经	2013年5月7日	-	18年	赵晓东先生，香港大学MBA。历任淄博矿业集团项目经理，浙江证券分析员，上海交大高新技术股份有限公司高级投资经理，国海证券有限责任公司行业研究员，国海富兰克林基金管理有限公司研究员、高级研究员、国富弹性市值混合基金及国富潜力组合混合基金的基金经理助理、国富沪深300指数增强基金的基金经理、国海富兰克林基金管理有限公司QDII投资总监。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司权益投资总监、职工监事，国富

	理				中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金、国富弹性市值混合基金、国富恒瑞债券基金、国富基本面优选混合基金、国富兴海回报混合基金及国富竞争优势三年持有期混合基金的基金经理。
刘怡敏	公司固定收益投资总监，国富强化收益债券基金、国富恒久信用债券基金、国富恒利债券（LOF）基金及国富焦点驱动混合基金的基金经理	2019年1月3日	-	17年	刘怡敏女士，CFA，四川大学金融学硕士。历任西南证券研究发展中心债券研究员、富国基金管理有限公司债券研究员、国海富兰克林基金管理有限公司国富中国收益混合基金的基金经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司固定收益投资总监，国富强化收益债券基金、国富恒久信用债券基金、国富恒利债券（LOF）基金及国富焦点驱动混合基金的基金经理。
刘晓	国富深化价值混合基金、国富新机遇混合基金、国富天颐混合基金及国富焦点驱动混合基金的基金经理兼研究员	2019年1月25日	-	14年	刘晓女士，上海财经大学金融学硕士。历任国海富兰克林基金管理有限公司研究助理、研究员、研究员兼基金经理助理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富深化价值混合基金、国富新机遇混合基金、国富天颐混合基金及国富焦点驱动混合基金的基金经理兼研究员。

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《富兰克林国海焦点驱动混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内公司严格执行《公平交易管理制度》，明确了公平交易的原则和目标，制订了实现公平交易的具体措施，并在技术上按照公平交易原则实现了严格的交易公平分配。

报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。

报告期内公司不存在投资组合之间发生的同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，我国经济增长呈现稳固态势，出口继续走好，固定资产投资结构有所分化，但消费复苏态势总体仍低于预期。一季度，伴随着海外疫苗注射推进和需求复苏，进出口同比增速在低基数的效应下创出新高。一季度地产销售火爆，推动地产投资维持高位。一季度 GDP 较 2019 年两年平均同比增长 5%，显示宏观经济增速修复动能有所降低。二季度，国内国外商品价格上涨压力上升，主要是由于疫情对于商品供给形成限制，同时全球宽松的货币政策推升通胀预期。从国内政策来看，远期达成“碳减排”、“碳中和”目标与控制当前通胀有一定的冲突。二季度国内商品价格涨幅较大，6 月 PPI 同比上涨 8.8%，上半年 PPI 累计同比上涨 5.5%。

上半年央行公开市场操作总体平稳，银行间市场货币环境较为宽松，货币财政总体保持平稳。“紧信用”的政策在二季度边际上有所放松。社融和 M2 增速继续回落，二者增速的缺口在二季度继续缩小，主要缘于政府债券及信用债融资量同比走低较多。或许是考虑到需求端的修复并不强

劲，通胀压力与输入型压力相关，二季度央行货币政策取向中性偏宽松，并未采取紧缩型货币政策应对通胀压力。

一季度国际市场动荡加剧，主要由于美债收益率的快速上行，引起全球范围资产价格估值的下降。A 股市场在一季度呈现波动，以茅指数来看核心资产先涨后跌。一季度债市先跌后涨，中债总全价指数下跌 0.20%。二季度市场对经济运行走低和货币宽松逐步形成预期，股票市场来看，创业板指及茅指数分别上涨 25.47 和 11.00%，沪深 300 指数仅上涨 2.54%，结构分化显著。二季度债市呈上涨，中债总全价指数上涨 0.45%。

整个上半年市场波动较大，风格分化严重，A 股市场沪深 300 指数上涨仅 2.16%，而创业板指则大幅上涨 19.88%。行业方面，电气设备、钢铁、化工涨幅最大，家电、非银、军工和地产跌幅较大。

回顾上半年，海外疫情呈现多次反复且各国进展并不同步，国内也有零星案例出现，经济在疫情的反复中艰难前行，市场情绪在乐观与悲观中反复切换。从年初对企业盈利及流动性的极度乐观，到春节后疫情缓解后对流动性快速收紧的担忧导致市场大幅调整，之后，随着海外疫情二次爆发，流动性收紧的担忧阶段性消除，市场再次上涨，且市场选择了长期成长性最强且不易受经济周期波动影响的新能源板块，演绎出极致的板块行情。

上半年，本基金维持中性偏低的权益仓位，目前组合中，化工、银行、食品饮料、电气设备等配置相对较多，总体在行业和风格配置上保持均衡，继续自下而上的深入研究挖掘个股。

报告期内，债券组合久期围绕中性水平有所波动，3-4 月提高了久期和仓位，在二季度获取较好投资收益，考虑到二季度通胀压力有所上升，逐步进行减仓。信用债方面未下沉评级，总体表现战胜比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.024 元，本报告期份额净值上涨 9.11%，同期业绩比较基准上涨 0.65%，本基金跑赢业绩比较基准 8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，影响债市的负面因素方面，首先是通胀的压力有所缓解，除原油的国内外商品涨势趋缓，体现为通胀上行的斜率明显变小。国内方面，政策当局力争通过扩大供给等方式控制价格上涨，政策减少了通胀通过货币政策收紧进行对冲的概率，因此，在上涨斜率趋缓和影响路径变化的双方面影响下，债市对通胀压力的反应区域钝化。其次是出口方面，截止 6 月末，新出口订单指数见顶已 7 个月，且近三个月持续回落，意味着当前出口的强劲势头在下半年未必能得到延

续。

7月9日，央行宣布普遍下调存款准备金率0.5%。我们认为，此次降准主要目的是契合国会提出的加强金融对实体经济支持，降低融资成本。实体经济的增速在去年四季度见顶。今年二季度以来，价格上涨，生产承压，消费不振。另一方面，实体经济融资需求回落，结构性风险凸显，继续“紧信用”有限。此次降准对上半年“紧信用”的政策做出修正，意味着下半年政策可能从“紧信用”过渡到“稳信用”。

总体而言，未来半年国内宏观经济增长压力较上半年有所上升。受制于地产“三条红线”融资政策及银行信贷额度影响，地产销售逐步走弱，将带动地产投资增速趋于下行。地方政府隐性债务清理整顿压力较大，《银行保险机构进一步做好地方政府隐性债务风险防范化解工作的指导意见》的严格执行将使平台融资受限。同时，受海外经济逐步复苏，产能恢复的影响，我国出口增长动能趋弱。预计下半年国内宏观经济复苏动能趋缓。

此次降准扭转了市场对于货币政策紧缩的预期，降准后收益率快速下行，体现出一定程度继续宽松的预期。当前收益率曲线水平在基准利率维持不变的情境下较为合理，但已缺乏足够安全边际。

随着疫苗接种率的提高，全球经济逐渐从新冠阴霾中复苏，经过一季度的大幅调整，市场关注点从对全球流动性收缩的担忧转为行业景气度和个股成长性的追逐。由于大宗商品的涨幅超出市场预期，并对广泛的中游制造业利润空间产生显著挤压，而国内消费需求恢复不充分，难以充分消化原材料上涨的压力，消费和大部分传统中游制造业景气度下行。而此时新能源和科技类板块成为仅有的确定性高成长板块，受到市场资金的追逐。此消彼长下，市场风格分化严重，另外，A股市场经历过去近两年大幅上涨后，部分板块和个股估值处在历史高位，一定程度上透支了未来的空间，需要等待利润增长的不消化。

展望三季度，经济基本面的韧性仍然较强，但流动性收紧预期仍然会反复发酵，另外，海外多国疫情的再次爆发也将影响各国的经济恢复和货币政策，进而为市场增添新的变数，需重点关注疫苗接种后对变种病毒的有效性。大宗商品价格阶段性见顶，对中下游的压制因素会逐步减弱。市场关注点或将从一两个行业扩展到其他行业，进一步回归到个股的业绩和基本面逻辑。从投资角度，应更加重视结构性机会，选股上会更考虑下档风险。

中长期看全球经济复苏趋势确定性较大，中国制造业通过过去几十年的不断积累，国内产业结构调整和技术进步非常显著，先进制造业受益工程师红利和产业链配套的完整，在国际市场上的产品竞争力大幅提升，相信未来会有一大批优质企业从中国龙头公司成长为世界龙头公司。另外，流动性上看，GDP增速将长期维持低速增长态势，流动性适度或宽松的状态或将长期持续。

而从市场参与者结构看，机构化和外资比例的在提升，对 A 股市场也形成实质性的长期利好。

从投资策略的角度看，GDP 增速下台阶后，未来依靠自上而下大的周期波动赚钱的概率下降，未来研究的重心应更多的放在自下而上的角度，重视业绩增长和估值匹配的逻辑，长期重点关注金融、高端制造和消费升级。本基金会在行业和风格配置上保持均衡，继续自下而上的深入研究挖掘个股。

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《投资产品估值管理办法》。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由总经理或其任命者负责，成员包括投研、风险控制、监察稽核、交易、基金核算方面的部门主管，相关人员均具有丰富的证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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《中华人民共和国证券投资基金法》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—国海富兰克林基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 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。

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、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开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《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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国海富兰克林基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集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中期报告中的财务指标、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

会计主体：富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	19,685,985.95	8,536,747.42
结算备付金		3,072,678.23	1,243,876.41
存出保证金		106,169.30	88,007.58
交易性金融资产	6.4.7.2	163,535,424.54	1,461,720,053.32
其中：股票投资		44,948,533.64	375,876,844.22
基金投资		-	-
债券投资		118,586,890.90	1,075,821,209.10
资产支持证券投资		-	10,022,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	6,000,000.00
应收证券清算款		26,715.58	-
应收利息	6.4.7.5	1,079,298.04	13,459,903.23
应收股利		-	-
应收申购款		70,083,468.19	5,783.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		257,589,739.83	1,491,054,371.06
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		16,756,161.03	3,434,357.29
应付赎回款		13,239,683.50	6,163.69
应付管理人报酬		269,507.07	1,113,319.12
应付托管费		74,863.07	309,255.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	365,322.06	101,562.83
应交税费		146,869.21	175,320.48

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	166,809.04	229,020.38
负债合计		31,019,214.98	5,368,999.09
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	111,948,594.76	800,910,277.05
未分配利润	6.4.7.10	114,621,930.09	684,775,094.92
所有者权益合计		226,570,524.85	1,485,685,371.97
负债和所有者权益总计		257,589,739.83	1,491,054,371.06

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.024 元，基金份额总额 111,948,594.76 份。

6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		87,080,494.18	29,646,410.43
1.利息收入		12,235,151.61	17,413,478.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	79,390.94	67,724.69
债券利息收入		11,292,730.55	17,053,939.03
资产支持证券利息收入		58,986.70	-
买入返售金融资产收入		804,043.42	291,815.06
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		204,385,843.28	42,340,484.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	194,363,812.17	26,630,263.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,255,311.07	12,072,769.12
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	38,010.96	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	728,709.08	3,637,451.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-129,585,127.55	-30,112,534.26
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	44,626.84	4,981.70
减：二、费用		8,377,558.35	8,214,940.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,471,396.95	5,846,770.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,519,832.46	1,624,102.75
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.18	1,058,998.40	343,682.28
5. 利息支出		170,988.90	226,520.47
其中：卖出回购金融资产支出		170,988.90	226,520.47
6. 税金及附加		16,133.18	29,625.86
7. 其他费用	6.4.7.19	140,208.46	144,238.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		78,702,935.83	21,431,470.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		78,702,935.83	21,431,470.06

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	800,910,277.05	684,775,094.92	1,485,685,371.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	78,702,935.83	78,702,935.83
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）	-688,961,682.29	-648,856,100.66	-1,337,817,782.95
其中：1.基金申购款	116,042,760.03	116,202,952.92	232,245,712.95
2.基金赎回款	-805,004,442.32	-765,059,053.58	-1,570,063,495.90
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）	111,948,594.76	114,621,930.09	226,570,524.85
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	800,925,458.46	504,110,223.17	1,305,035,681.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	21,431,470.06	21,431,470.06
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)	-2,382,012.56	-1,522,452.12	-3,904,464.68
其中:1.基金申购款	1,561,277.48	988,297.38	2,549,574.86
2.基金赎回款	-3,943,290.04	-2,510,749.50	-6,454,039.54
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)	798,543,445.90	524,019,241.11	1,322,562,687.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

林勇 于意 肖燕
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“国富焦点驱动混合基金”)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[2013]206号《关于核准富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合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照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海焦点驱动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2013年4月8日至2013年5月3日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集561,110,302.16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(2013)第255号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2013

年 5 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 561,200,226.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 89,923.94 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(以下简称“中国农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海焦点驱动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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、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)。本基金的投资组合比例为：股票等权益类证券投资比例为基金资产的 0%-95%，其中权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；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基金投资的其他金融工具不低于基金资产的 5%，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，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{中债国债总指数收益率(全价)}$ 。

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 2021 年 8 月 31 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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》、《富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进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纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	19,685,985.95
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	19,685,985.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	39,030,427.22	44,948,533.64	5,918,106.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	48,797,491.47	49,070,890.90
	银行间市场	69,240,694.53	69,516,000.00
	合计	118,038,186.00	118,586,890.90
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	157,068,613.22	163,535,424.54	6,466,811.32

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,527.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,243.35
应收债券利息	1,070,484.30

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	42.93
合计	1,079,298.04

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	349,871.83
银行间市场应付交易费用	15,450.23
合计	365,322.06

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	48,713.10
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
债券账户维护费	9,000.00
合计	166,809.04

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	800,910,277.05	800,910,277.05
本期申购	116,042,760.03	116,042,760.03
本期赎回(以“-”号填列)	-805,004,442.32	-805,004,442.32
本期末	111,948,594.76	111,948,594.76

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	467,855,195.73	216,919,899.19	684,775,094.92
本期利润	208,288,063.38	-129,585,127.55	78,702,935.83
本期基金份额交易产生的变动数	-546,018,872.53	-102,837,228.13	-648,856,100.66
其中：基金申购款	120,979,544.55	-4,776,591.63	116,202,952.92
基金赎回款	-666,998,417.08	-98,060,636.50	-765,059,053.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	130,124,386.58	-15,502,456.49	114,621,930.09

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	62,897.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	15,892.55
其他	600.71
合计	79,390.94

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	477,930,726.27
减：卖出股票成本总额	283,566,914.10
买卖股票差价收入	194,363,812.17

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	9,255,311.07
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	9,255,311.07

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,623,293,165.24
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,594,083,464.46
减：应收利息总额	19,954,389.71
买卖债券差价收入	9,255,311.07

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	10,154,000.00
减：卖出资产支持证券成本总额	10,000,000.00
减：应收利息总额	115,989.04
资产支持证券投资收益	38,010.96

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	728,709.08

基金投资产生的股利收益	-
合计	728,709.08

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-129,585,127.55
——股票投资	-127,338,059.57
——债券投资	-2,225,067.98
——资产支持证券投资	-22,000.00
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-129,585,127.55

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	44,295.77
转换费收入	331.07
合计	44,626.84

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,042,065.90
银行间市场交易费用	16,932.50

合计	1,058,998.40
----	--------------

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
债券账户维护费	18,000.00
银行汇划费用	12,512.52
其他手续费	600.00
合计	140,208.46

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司“中国农业银行”	基金托管人、基金销售机构
国海证券股份有限公司（“国海证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,471,396.95	5,846,770.05
其中：支付销售机构的客户维护费	106,403.56	65,996.21

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 0.90% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.90% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,519,832.46	1,624,102.75

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 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发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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（2020 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。

6.4.10.5 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	19,685,985.95	62,897.68	4,585,768.11	54,190.67

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配情况。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	新股锁定	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688660	电气风电	2021年5月11日	2021年11月19日	新股锁定	5.44	7.26	51,238	278,734.72	371,987.88	-
688276	百克生物	2021年6月17日	2021年12月27日	新股锁定	36.35	79.48	3,298	119,882.30	262,125.04	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688630	芯碁微装	2021年3月25日	2021年10月8日	新股锁定	15.23	58.42	3,397	51,736.31	198,452.74	-
688677	海泰新光	2021年2月18日	2021年8月26日	新股锁定	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-
688687	凯因科技	2021年1月29日	2021年8月9日	新股锁定	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92	-
688315	诺禾	2021年	2021	新股	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-

	致源	4月2日	2021年10月13日	锁定						
688319	欧林生物	2021年5月31日	2021年12月8日	新股锁定	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
688316	青云科技	2021年3月5日	2021年9月16日	新股锁定	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00	-
688628	优利德	2021年1月22日	2021年8月2日	新股锁定	19.11	32.62	2,789	53,297.79	90,977.18	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688314	康拓医疗	2021年5月11日	2021年11月18日	新股锁定	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文	2021年	2021	新股	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-

	电能	4月19日	年10月27日	锁定							
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34		-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66		-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02		-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24		-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36		-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28		-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62		-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24		-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80		-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12		-
300966	共同	2021年	2021	新股	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44		-

	药业	3月31日	年10月11日	锁定						
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	其中108股为锁定期送股的股份
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远	2021年	2021	新股	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-

	新能	4月21日	2021年10月29日	锁定						
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波	2021年	2021	新股	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-

	方正	5月25日	2021年12月2日	锁定						
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

注：

- 1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。
- 2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币

市场基金，属于中风险收益特征的证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险控制部负责投资风险管理与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，主要是发掘各类风险的风险点，判断风险发生的频度和损失，对风险实行分级管理。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的分析报告，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时对各种风险进行监控和评估，并通过风险处置流程，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金固定收益品种投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	29,910,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	11,908,100.70	183,953,493.20
合计	11,908,100.70	213,863,493.20

注：未评级部分为国债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	46,412,572.20	548,863,558.70
AAA 以下	307,224.80	9,683,157.20
未评级	59,959,000.00	303,411,000.00
合计	106,678,797.00	861,957,715.90

注：未评级部分为国债和政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，

以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,685,985.95	-	-	-	19,685,985.95
结算备付金	3,072,678.23	-	-	-	3,072,678.23
存出保证金	106,169.30	-	-	-	106,169.30
交易性金融资产	21,465,100.70	88,061,865.70	9,059,924.50	44,948,533.64	163,535,424.54
应收证券清算款	-	-	-	26,715.58	26,715.58
应收利息	-	-	-	1,079,298.04	1,079,298.04
应收申购款	-	-	-	70,083,468.19	70,083,468.19

资产总计	44,329,934.18	88,061,865.70	9,059,924.50	116,138,015.45	257,589,739.83
负债					
应付证券清算款	-	-	-	16,756,161.03	16,756,161.03
应付赎回款	-	-	-	13,239,683.50	13,239,683.50
应付管理人报酬	-	-	-	269,507.07	269,507.07
应付托管费	-	-	-	74,863.07	74,863.07
应付交易费用	-	-	-	365,322.06	365,322.06
应交税费	-	-	-	146,869.21	146,869.21
其他负债	-	-	-	166,809.04	166,809.04
负债总计	-	-	-	31,019,214.98	31,019,214.98
利率敏感度缺口	44,329,934.18	88,061,865.70	9,059,924.50	85,118,800.47	226,570,524.85
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,536,747.42	-	-	-	8,536,747.42
结算备付金	1,243,876.41	-	-	-	1,243,876.41
存出保证金	88,007.58	-	-	-	88,007.58
交易性金融资产	500,012,882.00	413,491,749.90	172,338,577.20	375,876,844.22	1,461,720,053.32
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应收利息	-	-	-	13,459,903.23	13,459,903.23
应收申购款	-	-	-	5,783.10	5,783.10
资产总计	515,881,513.41	413,491,749.90	172,338,577.20	389,342,530.55	1,491,054,371.06
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,434,357.29	3,434,357.29
应付赎回款	-	-	-	6,163.69	6,163.69
应付管理人报酬	-	-	-	1,113,319.12	1,113,319.12
应付托管费	-	-	-	309,255.30	309,255.30
应付交易费用	-	-	-	101,562.83	101,562.83
应交税费	-	-	-	175,320.48	175,320.48
其他负债	-	-	-	229,020.38	229,020.38
负债总计	-	-	-	5,368,999.09	5,368,999.09
利率敏感度缺口	515,881,513.41	413,491,749.90	172,338,577.20	383,973,531.46	1,485,685,371.97

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）

			日)
	市场利率下降 25 个基点	增加约 25	增加约 754
	市场利率上升 25 个基点	减少约 25	减少约 726

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票等权益类资产占基金资产的 0%-95%，其中权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；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基金投资的其他金融工具不低于基金资产的 5%，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，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	44,948,533.64	19.84	375,876,844.22	25.30
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	44,948,533.64	19.84	375,876,844.22	25.30

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	-	增加约 2,600
	2. 业绩比较基准下降 5%	-	减少约 2,600

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 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 47,397,442.86 元，属于第二层次的余额为 116,137,981.68 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 388,777,482.33 元，第二层次 1,072,942,570.99 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票、债券和资产支持证券，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、债券和资产支持证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、债券和资产支持证券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	44,948,533.64	17.45
	其中：股票	44,948,533.64	17.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	118,586,890.90	46.04
	其中：债券	118,586,890.90	46.04
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,758,664.18	8.84
8	其他各项资产	71,295,651.11	27.68
9	合计	257,589,739.83	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,008,729.00	0.45
C	制造业	24,011,989.77	10.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,930,500.21	3.50
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	19,516.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	680,805.00	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,952,531.27	0.86
J	金融业	7,980,298.49	3.52
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	145,471.20	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	1,193,321.33	0.53
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	44,948,533.64	19.84

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未通过港股通交易机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	2.27
2	600036	招商银行	43,471	2,355,693.49	1.04
3	601966	玲珑轮胎	44,059	1,927,140.66	0.85
4	600900	长江电力	70,900	1,463,376.00	0.65
5	601838	成都银行	113,900	1,439,696.00	0.64
6	603899	晨光文具	15,900	1,344,504.00	0.59
7	600483	福能股份	125,400	1,315,446.00	0.58
8	600919	江苏银行	178,900	1,270,190.00	0.56
9	002648	卫星石化	32,140	1,259,566.60	0.56
10	600600	青岛啤酒	10,500	1,214,325.00	0.54
11	600323	瀚蓝环境	53,100	1,157,049.00	0.51
12	600660	福耀玻璃	20,600	1,150,510.00	0.51
13	300059	东方财富	35,000	1,147,650.00	0.51
14	600406	国电南瑞	49,000	1,138,760.00	0.50
15	600519	贵州茅台	500	1,028,350.00	0.45
16	601012	隆基股份	11,500	1,021,660.00	0.45
17	601899	紫金矿业	104,100	1,008,729.00	0.45
18	600309	万华化学	9,000	979,380.00	0.43
19	002142	宁波银行	24,100	939,177.00	0.41
20	002812	恩捷股份	3,800	889,580.00	0.39
21	002271	东方雨虹	15,100	835,332.00	0.37
22	000001	平安银行	36,600	827,892.00	0.37
23	000012	南玻A	76,800	786,432.00	0.35
24	002601	龙蟠佰利	22,600	781,508.00	0.34

25	300274	阳光电源	6,500	747,890.00	0.33
26	600350	山东高速	110,700	680,805.00	0.30
27	600570	恒生电子	7,300	680,725.00	0.30
28	600690	海尔智家	26,200	678,842.00	0.30
29	688008	澜起科技	10,749	670,522.62	0.30
30	000932	华菱钢铁	98,500	650,100.00	0.29
31	000858	五粮液	1,700	506,413.00	0.22
32	300750	宁德时代	900	481,320.00	0.21
33	000651	格力电器	9,200	479,320.00	0.21
34	003022	联泓新科	15,500	475,850.00	0.21
35	000830	鲁西化工	24,600	460,758.00	0.20
36	601678	滨化股份	58,100	459,571.00	0.20
37	603260	合盛硅业	5,900	453,769.00	0.20
38	600176	中国巨石	29,100	451,341.00	0.20
39	600438	通威股份	10,300	445,681.00	0.20
40	688660	电气风电	51,238	371,987.88	0.16
41	002459	晶澳科技	7,000	343,000.00	0.15
42	603806	福斯特	3,100	325,903.00	0.14
43	002386	天原股份	29,400	302,820.00	0.13
44	688276	百克生物	3,298	262,125.04	0.12
45	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.10
46	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.09
47	688161	威高骨科	1,941	205,843.05	0.09
48	000708	中信特钢	9,700	202,148.00	0.09
49	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.09
50	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.08
51	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.07
52	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.06
53	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.04
54	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.04
55	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.04
56	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.04
57	300979	华利集团	925	80,937.50	0.04
58	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.04
59	300894	火星人	628	42,704.00	0.02
60	300973	立高食品	360	41,655.60	0.02
61	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
62	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
63	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01

64	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
65	300932	三友联众	492	15,601.32	0.01
66	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
67	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.01
68	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
69	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
70	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
71	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
72	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
73	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
74	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
75	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
76	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
77	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
78	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
79	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
80	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
81	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
82	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
83	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
84	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
85	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
86	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
87	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
88	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
89	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
90	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
91	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
92	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
93	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
94	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
95	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
96	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
97	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
98	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
99	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
100	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
101	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
102	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00

103	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
104	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
105	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
106	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

注：鉴于部分股票占基金资产净值的比例过于微小，四舍五入后无法通过小数点后两位数据加以列示，故标注为“0.00”。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买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	000932	华菱钢铁	7,660,481.88	0.52
2	600323	瀚蓝环境	7,395,870.00	0.50
3	600483	福能股份	6,031,384.76	0.41
4	601838	成都银行	4,576,257.00	0.31
5	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.23
6	000338	潍柴动力	3,063,700.00	0.21
7	600282	南钢股份	2,341,275.00	0.16
8	688008	澜起科技	2,186,241.25	0.15
9	600031	三一重工	1,574,615.00	0.11
10	601601	中国太保	1,544,378.00	0.10
11	000656	金科股份	1,543,240.00	0.10
12	600900	长江电力	1,456,712.18	0.10
13	601727	上海电气	1,354,666.56	0.09
14	603899	晨光文具	1,340,171.00	0.09
15	600919	江苏银行	1,283,633.70	0.09
16	600036	招商银行	1,257,559.82	0.08
17	600600	青岛啤酒	1,193,986.00	0.08
18	600660	福耀玻璃	1,182,665.00	0.08
19	300059	东方财富	1,130,830.00	0.08
20	600406	国电南瑞	1,127,976.00	0.08

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601966	玲珑轮胎	97,451,926.94	6.56
2	600036	招商银行	48,397,855.98	3.26
3	000568	泸州老窖	18,333,067.00	1.23
4	000651	格力电器	16,593,128.82	1.12
5	600597	光明乳业	14,936,529.64	1.01
6	300274	阳光电源	13,244,639.35	0.89
7	600887	伊利股份	11,942,274.16	0.80
8	601166	兴业银行	10,922,342.01	0.74
9	002304	洋河股份	10,860,381.98	0.73
10	601012	隆基股份	10,727,042.19	0.72
11	000001	平安银行	8,933,033.00	0.60
12	600298	安琪酵母	8,740,583.13	0.59
13	000932	华菱钢铁	8,497,807.00	0.57
14	002415	海康威视	8,354,361.00	0.56
15	002271	东方雨虹	8,174,259.12	0.55
16	002352	顺丰控股	7,800,120.00	0.53
17	603899	晨光文具	7,622,364.15	0.51
18	002648	卫星石化	7,551,867.64	0.51
19	002044	美年健康	7,428,504.34	0.50
20	600048	保利地产	7,394,744.88	0.50

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	79,976,663.09
卖出股票收入（成交）总额	477,930,726.27

注：“买入股票成本总额”及“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	21,949,100.70	9.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,918,000.00	22.03
	其中：政策性金融债	49,918,000.00	22.03
4	企业债券	19,766,140.00	8.72
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,557,000.00	4.22
7	可转债（可交换债）	17,396,650.20	7.68
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	118,586,890.90	52.34

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	092118002	21 农发清发 02	200,000	20,070,000.00	8.86
2	200303	20 进出 03	200,000	19,780,000.00	8.73
3	175715	21 招证 G3	100,000	10,081,000.00	4.45
4	190305	19 进出 05	100,000	10,068,000.00	4.44
5	200013	20 付息国债 13	100,000	10,041,000.00	4.43

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本期投资的前十名证券中，无报告期内发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	106,169.30
2	应收证券清算款	26,715.58
3	应收股利	-
4	应收利息	1,079,298.04
5	应收申购款	70,083,468.19

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	71,295,651.11

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113044	大秦转债	8,007,427.10	3.53
2	110059	浦发转债	701,645.50	0.31
3	128107	交科转债	307,224.80	0.14
4	127012	招路转债	72,780.40	0.03

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	2.27	新股锁定

§ 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

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
3,780	29,616.03	90,563,149.77	80.90%	21,385,444.99	19.10%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	361,888.94	0.323263%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年5月7日）基金份额总额	561,200,226.10
本报告期期初基金份额总额	800,910,277.05
本报告期基金总申购份额	116,042,760.03
减：本报告期基金总赎回份额	805,004,442.32
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	111,948,594.76

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(一) 基金管理人重大人事变动
本报告期内，本基金基金管理人无重大人事变动。

(二) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自成立以来对其进行审计的均是普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

(一) 基金管理人及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。
(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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	1	152,442,337.15	28.24%	141,968.32	29.04%	-
中信证券	2	109,429,179.89	20.27%	101,912.25	20.84%	-
兴业证券	1	72,034,088.03	13.34%	67,084.57	13.72%	-
方正证券	1	64,127,750.28	11.88%	59,721.90	12.21%	-
西藏东方财富证券	2	53,757,275.79	9.96%	39,313.09	8.04%	-

中金公司	2	51,994,067.94	9.63%	48,422.09	9.90%	-
中泰证券	2	15,214,689.60	2.82%	11,126.43	2.28%	-
海通证券	1	8,840,176.76	1.64%	8,233.05	1.68%	-
高华证券	1	6,715,709.49	1.24%	6,254.13	1.28%	-
华安证券	1	5,097,975.82	0.94%	4,747.73	0.97%	-
华泰证券	2	159,004.91	0.03%	148.09	0.03%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

注：管理人对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其他相关因素后决定的。报告期内，本基金交易单元无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东兴证券	110,148,094.78	16.97%	915,700,000.00	30.71%	-	-
中信证券	129,400,902.36	19.94%	700,000,000.00	23.48%	-	-
兴业证券	135,692,402.34	20.91%	935,300,000.00	31.37%	-	-
方正证券	2,528,409.60	0.39%	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2,047,435.97	0.32%	140,500,000.00	4.71%	-	-
中金公司	219,500.00	0.03%	-	-	-	-

中泰证券	1,970.00	0.00%	-	-	-	-
海通证券	24,732,689.60	3.81%	50,000,000.00	1.68%	-	-
高华证券	53,475,617.35	8.24%	240,000,000.00	8.05%	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	150,360,248.89	23.17%	-	-	-	-
国海证券	40,348,696.99	6.22%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021年1月22日
2	富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021年1月22日
3	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加海通证券股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021年3月4日
4	国海富兰克林基金关于与通联支付合作开通招商银行借记卡支付并实施申购和定期定额投资费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021年3月9日
5	关于增加中国国际金融股份有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业	中国证监会指定报刊及指定网站	2021年3月22日

	务、定期定额投资业务的公告		
6	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 3 月 26 日
7	国海富兰克林基金管理有限公司 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 3 月 31 日
8	富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 3 月 31 日
9	关于增加爱建证券有限责任公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 4 月 21 日
10	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 4 月 21 日
11	富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 4 月 21 日
12	关于增加海通期货有限责任公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 5 月 18 日
13	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金在申万宏源证券股份有限公司开通定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 5 月 19 日
14	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中信建投证券股份有限公司申购、定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 5 月 21 日
15	关于增加上海中欧财富基金销售有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 5 月 22 日
16	国海富兰克林基金管理有限公司关于调整个人账户开户证件类型类型的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 6 月 15 日
17	关于增加宁波银行为国海富兰克	中国证监会指定报	2021 年 6 月 24 日

	林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	刊及指定网站	
18	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加交通银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 6 月 30 日
19	富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年 1 号）	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021 年 6 月 28 日至 2021 年 6 月 30 日	-	24,654,339.25	-	24,654,339.25	22.02%
	2	2021 年 6 月 21 日至 2021 年 6 月 23 日	-	10,208,779.99	-	10,208,779.99	9.12%
	3	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 20 日	785,979,737.61	-	785,979,737.61	-	-

产品特有风险

1. 流动性风险

投资者大额赎回所持有的基金份额时，为了实现基金资产的迅速变现，在基金交易过程中可能存在无法实现交易价格最优；亦或导致基金仓位调整困难，基金资产不能迅速转变成现金，产生流动性风险。一旦引发巨额赎回，当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，可能出现比例赎回、延期支付赎回款等情形。管理人有权根据本基金合同和招募说明书的约定，基于投资者保护原则，暂停或拒绝申购、暂停赎回。该基金投资者集中度较高，管理人将积极通过持续营销优化持有人结构，审慎办理大额申购和赎回。

2. 估值风险

投资者大额赎回所持有的基金份额时，基金份额净值可能受到尾差和部分赎回费归入基金资产的影响，从而导致非市场因素的净值异常波动。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于公司治理风险、流动性风险、退市风险、股价波动风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海焦点驱动混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海焦点驱动混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海焦点驱动混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海焦点驱动混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站：www.ftsfund.com。

12.3 查阅方式

- 1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件。
- 2、登陆基金管理人网站 www.ftsfund.com 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日