

富兰克林国海新趋势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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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.....	7
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	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
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.....	50
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
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.....	67

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§12 备查文件目录.....	68
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	68
12.3 查阅方式.....	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海新趋势灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	国富新趋势混合	
基金主代码	005552	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 2 月 8 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	565,967,013.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国富新趋势混合 A	国富新趋势混合 C
下属分级基金的交易代码:	005552	005553
报告期末下属分级基金的份额总额	404,720,119.56 份	161,246,893.91 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格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>本基金对境内股票及港股通标的股票的选择，将采用“自下而上”精选个股策略，对受益于国家/地区产业政策及经济发展方向的相关上市公司进行深入挖掘，精选具有核心竞争优势和持续成长能力的优质上市公司。主要从行业地位、核心竞争力、盈利能力、公司治理水平、估值水平等五方面对上市公司进行评估。另外，本基金将仅通过港股通投资港股市场，比较个股与 A 股市场同类公司的质地及估值水平等要素，优选具备质地优良、行业景气的公司进行重点配置。</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 x30%+恒生指数收益率 x20%+中债国债总指数收益率（全价）x50%
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉
	联系电话	021-3855 5555
	电子邮箱	service@ftsfund.com
客户服务电话	400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555	95588
传真	021-6888 3050	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	吴显玲	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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

基金级别	国富新趋势混合 A	国富新趋势混合 C
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)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	29,751,101.64	10,692,520.54
本期利润	38,335,394.20	11,629,278.04
加权平均基金份额本期利润	0.0983	0.0778
本期加权平均净值利润率	8.58%	6.81%
本期基金份额净值增长率	7.41%	7.30%
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	68,694,199.77	26,300,439.25
期末可供分配基金份额利润	0.1697	0.1631
期末基金资产净值	482,682,296.80	191,292,723.15
期末基金份额净值	1.1926	1.1863
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	19.26%	18.63%

注：

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国富新趋势混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

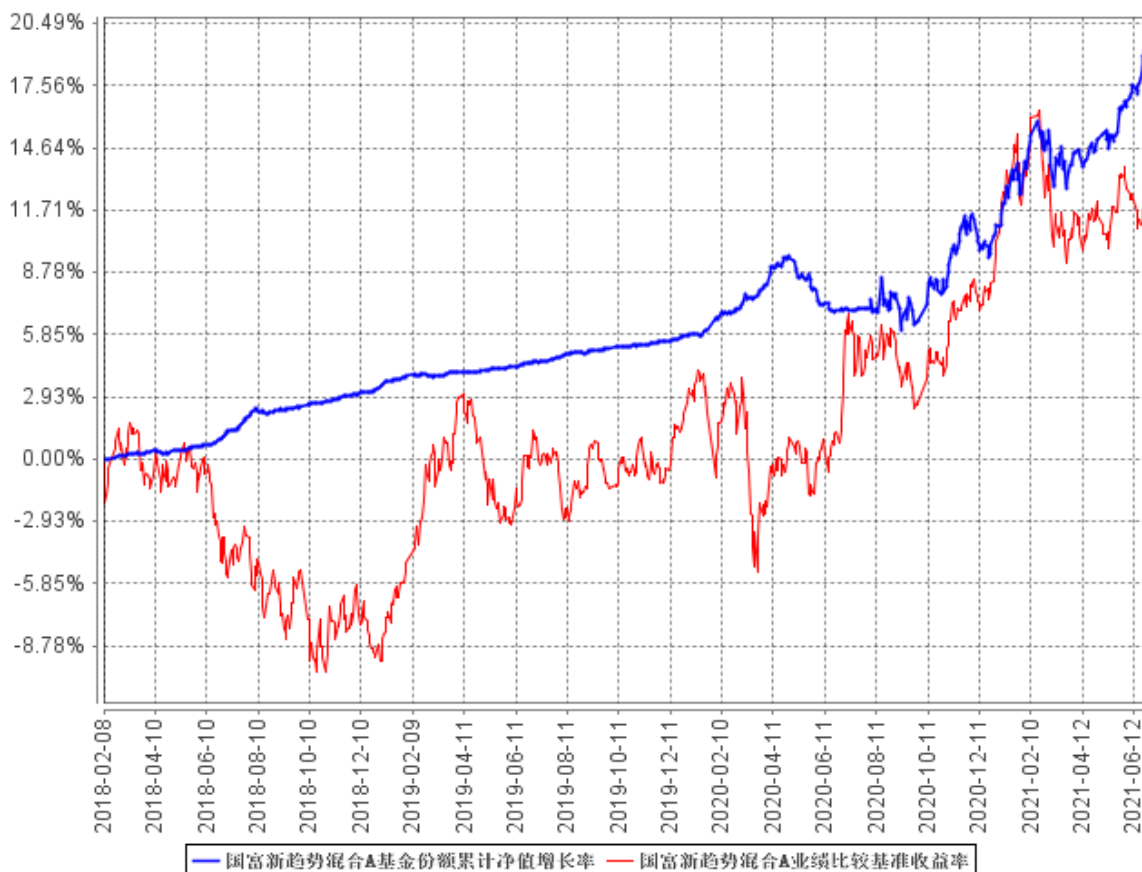
过去一个月	2.23%	0.21%	-1.00%	0.36%	3.23%	-0.15%
过去三个月	4.62%	0.24%	1.63%	0.43%	2.99%	-0.19%
过去六个月	7.41%	0.37%	1.83%	0.58%	5.58%	-0.21%
过去一年	11.42%	0.34%	10.77%	0.56%	0.65%	-0.22%
过去三年	18.01%	0.20%	16.53%	0.59%	1.48%	-0.39%
自基金合同生效起至今	19.26%	0.19%	12.24%	0.59%	7.02%	-0.40%

国富新趋势混合 C

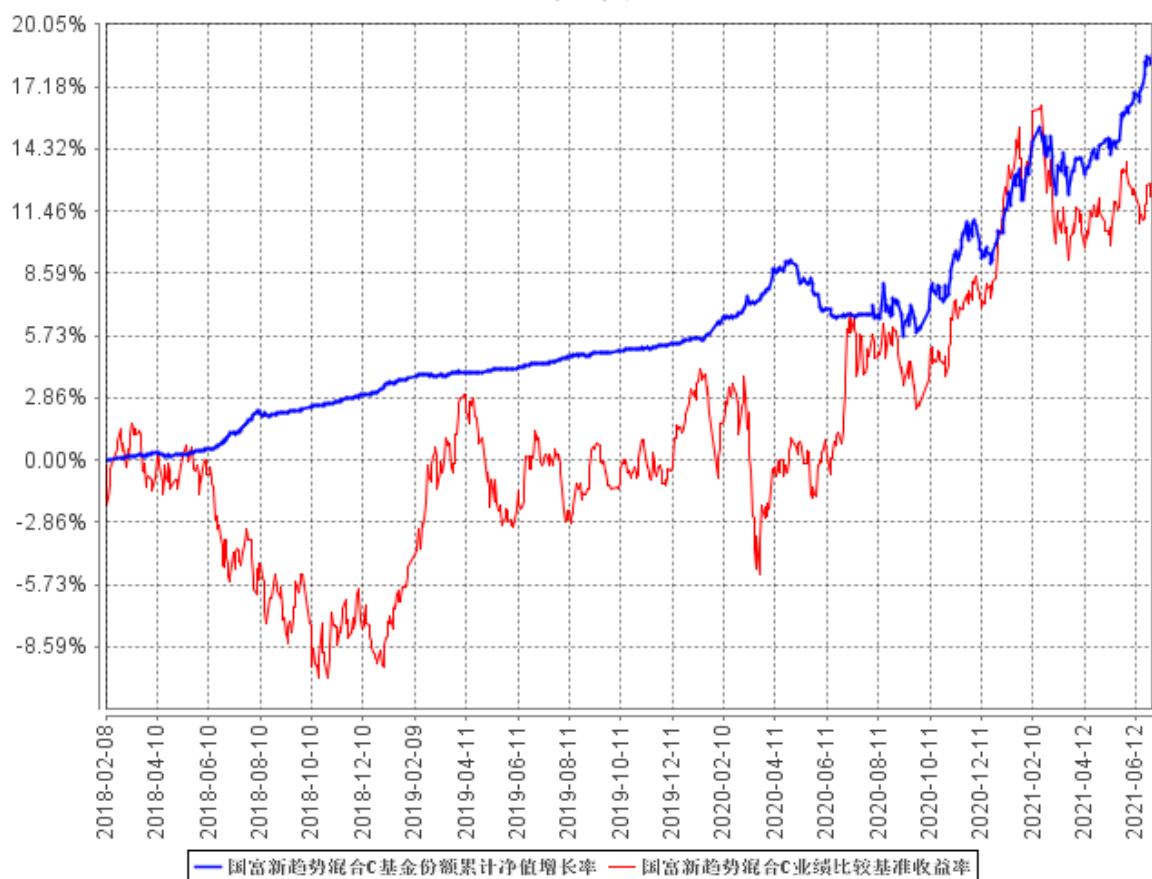
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.21%	0.21%	-1.00%	0.36%	3.21%	-0.15%
过去三个月	4.58%	0.24%	1.63%	0.43%	2.95%	-0.19%
过去六个月	7.30%	0.37%	1.83%	0.58%	5.47%	-0.21%
过去一年	11.20%	0.34%	10.77%	0.56%	0.43%	-0.22%
过去三年	17.51%	0.20%	16.53%	0.59%	0.98%	-0.39%
自基金合同生效起至今	18.63%	0.19%	12.24%	0.59%	6.39%	-0.40%

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

国富新趋势混合A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



国富新趋势混合C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 2018 年 2 月 8 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		
沈竹熙	公司固定收益投资副总监，国富恒裕 6 个月定期开放债券基金、国富新趋势混合基金、国富恒嘉短债债券基金及国富恒博 63 个月定期开放债券基金的基金经理	2018 年 9 月 8 日	-	11 年	沈竹熙女士，长沙理工大学金融学学士。历任平安银行股份有限公司交易员，华融湘江银行股份有限公司交易员及平安证券股份有限公司金融市场部固定收益团队执行副总经理。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副总监，国富恒裕 6 个月定期开放债券基金、国富新趋势混合基金、国富恒嘉短债债券基金及国富恒博 63 个月定期开放债券基金的基金经理。
杜飞	国富成长动力混合基金	2018 年 4 月 20 日	-	10 年	杜飞先生，上海财经大学经济学硕士。历任国海富

	及国富新趋势混合基金的基金经理兼研究员			兰克林基金管理有限公司研究助理、研究员、国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金及国富弹性市值混合基金的基金经理助理、国富新价值混合基金的基金经理兼研究员。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富成长动力混合基金及国富新趋势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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海新趋势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

2021 年上半年国内经济处于疫情后复苏进程中，但结构仍不均衡。上半年国内债市收益率呈现慢牛行情，其中中债总指数上涨 2.09%，中债国债指数上涨 2.17%，中债信用债总指数上涨 2.15%。

从已经公布的关键经济、金融数据上来看，上半年 GDP 累计增长 12.7%，规模以上工业增加值累计增长 15.9%；上半年固定资产投资累计增长 12.6%，制造业投资增长 19.2%，基建增速（全口径）7.15%，地产投资增速 15%；社零累计同比增长 23%。进出口累计同比 37.4%，其中出口累计同比 38.6%，进口累计同比 36%。价格方面，上半年食品价格温和上涨，工业品价格出现较大幅度上行，其中 CPI 累计同比增速 0.5%；PPI 累计同比增速 5.1% 水平。随着降低宏观杠杆率政策的稳步推进，人民币贷款余额与社融存量的同比增速缓步下行至 12.3% 与 11% 的水平。各项关键经济、金融数据显示国内经济仍处于疫情后的缓慢恢复过程中，出口、地产成为拉动经济的主要支撑力量，基建、投资等受政策及预期影响增长不及预期，消费仍较为疲弱。在此基础上，央行货币政策以“降低宏观杠杆率，防控系统性风险”为主基调，采取了宽货币与紧信用的政策组合。银行间资金面整体宽松，债券收益率出现较大幅度下行。

本基金保持适当的持仓和久期，投资品种以利率债、高等级国企信用债、国股存单为主，积极参与转债打新。操作上，随着基金规模扩大，做好底仓的配置。本基金实施固收+权益的投资策略，上半年本基金保持了低换手率，上半年权益仓位平均保持在 22% 左右，持仓主要以精选优质个股为主，行业配置上以盈利扩张的化工、银行和有色等板块为主。

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 A 类份额净值为 1.1926 元，本报告期份额净值上涨 7.41%，同期业绩比较基准上涨 1.83%，跑赢业绩基准 5.58%；本基金 C 类份额净值为 1.1863 元，本报告期份额净值上涨 7.30%，同期业绩比较基准上涨 1.83%，跑赢业绩基准 5.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一、“L”型经济增长趋势下，中长期利率水平呈现中枢下行态势

一是国内经济新旧动能转换，新的经济增长点需要较长时间培育，经济结构调整转型仍在路上。二是中央“房住不炒”的地产政策态度极为坚定，地产周期一定程度上通过调控手段熨平；

三是全球经济景气度仍低，影响实质需求及企业预期。

二、中期金融市场及利率走势呈现震荡格局

一方面国内基本面多空因素交错，叠加国外政治经济政策影响，使得市场参与者较易形成预期差，加速市场波动。国内经济中期朝着疫情缓解，逐步复苏的向好趋势发展，但地产行业受“三道红线”政策影响，对经济的拉动作用势必减弱；中期海外疫情发展存在不确定性，叠加大选、中美贸易判断等因素，海外需求不确定性也将加大，使得国内进出口贸易波动也将加大。

另一方面国内货币及融资政策的调整，使得利率呈现震荡走势。中期货币政策将始终发挥逆周期调节效力，提前预判、操作将成为常态。前期受疫情影响，货币政策保持宽松，宏观杠杆率走高，随着国内疫情得到控制，国债、地方债的持续发行等触发事件影响，资金面周期更迭，加速金融市场以及利率波动。

三、在信用风险不断爆发的当下市场，纯债市场投资品种向高等级、好资质集中成为趋势，政策性金融债信用风险极低，且作为押品被市场资金主要供给方普遍接受认可，质押率较高，品质优异；在此基础上具有绝对收益回报、波动较小特点的打新、固收+产品具有良好的市场需求。

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

本报告期内，本基金托管人在对富兰克林国海新趋势灵活配置混合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，富兰克林国海新趋势灵活配置混合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新趋势灵活配置混合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，富兰克林国海新趋势灵活配置混合型投资基金未进行利润分配。

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新趋势灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海新趋势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	12,665,193.16	8,271,221.84
结算备付金		1,582,231.50	3,674,943.87
存出保证金		125,093.88	109,349.63
交易性金融资产	6.4.7.2	658,577,780.40	580,494,789.05
其中：股票投资		136,779,500.40	162,268,140.25
基金投资		-	-
债券投资		521,798,280.00	418,226,648.80
资产支持证券投资		-	-
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	147,000,223.50	124,300,000.00
应收证券清算款		3,498,438.66	-
应收利息	6.4.7.5	7,215,302.68	5,880,224.03
应收股利		-	-
应收申购款		202,839.73	3,282,679.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		830,867,103.51	726,013,207.52
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		146,500,000.00	-
应付证券清算款		9,305,232.41	1,101,255.07
应付赎回款		245,902.73	-
应付管理人报酬		299,145.65	341,498.27
应付托管费		49,857.59	56,916.37
应付销售服务费		30,438.03	18,858.29
应付交易费用	6.4.7.7	345,651.63	347,338.51
应交税费		12,635.29	15,827.11

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	103,220.23	149,000.00
负债合计		156,892,083.56	2,030,693.62
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	565,967,013.47	652,618,043.59
未分配利润	6.4.7.10	108,008,006.48	71,364,470.31
所有者权益合计		673,975,019.95	723,982,513.90
负债和所有者权益总计		830,867,103.51	726,013,207.52

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，国富新趋势混合 A 基金份额净值 1.1926 元，基金份额总额 404,720,119.56 份；国富新趋势混合 C 基金份额净值 1.1863 元，基金份额总额 161,246,893.91 份。国富新趋势混合份额总额合计为 565,967,013.47 份。

6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海新趋势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		53,896,155.50	1,379,048.02
1.利息收入		7,048,906.30	1,233,910.80
其中：存款利息收入	6.4.7.11	75,855.73	21,903.48
债券利息收入		6,473,632.66	1,141,376.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		499,417.91	70,630.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		37,322,070.58	267,667.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	36,854,100.86	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-804,239.88	267,667.64
资产支持证券投资收益		-	-
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	1,272,209.60	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	9,521,050.06	-165,703.78
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	4,128.56	43,173.36
减：二、费用		3,931,483.26	461,348.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,855,547.91	215,010.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	309,257.98	35,835.13
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	169,195.41	70,806.93
4. 交易费用	6.4.7.18	1,335,513.82	6,018.93
5. 利息支出		128,641.72	39,121.62
其中：卖出回购金融资产支出		128,641.72	39,121.62
6. 税金及附加		11,042.17	1,160.41
7. 其他费用	6.4.7.19	122,284.25	93,394.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		49,964,672.24	917,699.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		49,964,672.24	917,699.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海新趋势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）	652,618,043.59	71,364,470.31	723,982,513.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	49,964,672.24	49,964,672.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-86,651,030.12	-13,321,136.07	-99,972,166.19
其中：1.基金申购款	337,135,205.16	48,975,648.70	386,110,853.86
2.基金赎回款	-423,786,235.28	-62,296,784.77	-486,083,020.05
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）	565,967,013.47	108,008,006.48	673,975,019.95
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）	86,064,214.24	4,796,739.10	90,860,953.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	917,699.71	917,699.71
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）	-41,746,831.83	-2,751,248.73	-44,498,080.56
其中：1.基金申购款	30,007,199.17	2,482,231.22	32,489,430.39
2.基金赎回款	-71,754,031.00	-5,233,479.95	-76,987,510.95
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）	44,317,382.41	2,963,190.08	47,280,572.49

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：

<u>林勇</u>	<u>于意</u>	<u>肖燕</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海新趋势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[2017]1549号《关于准予富兰克林国海新趋势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《富兰克林国海新趋势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 2018 年 1 月 8 日起至 2018 年 2 月 2 日止，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 211,375,180.39 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(2018)第 0100 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 211,393,797.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,617.33 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。

根据《富兰克林国海新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《富兰克林国海新趋势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的，称为 A 类；不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海新趋势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)、港股通标的股票、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)、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)、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金股票占基金资产的比例为 0% - 95%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0%-95%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%)；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(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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 x 30%+恒生指数收益率 x 20%+中债国债总指数收益率(全价) x 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 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》、《富兰克林国海新趋势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[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》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	12,665,193.16
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	12,665,193.16

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	121,233,672.54	136,779,500.40	15,545,827.86
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	392,946,413.30	392,454,280.00	-492,133.30
	银行间市场	129,088,636.45	129,344,000.00	255,363.55
	合计	522,035,049.75	521,798,280.00	-236,769.75
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		643,268,722.29	658,577,780.40	15,309,058.11

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	100,000,000.00	-
银行间市场	47,000,223.50	-
合计	147,000,223.50	-

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	3,386.98
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	640.89
应收债券利息	7,171,283.26
应收买入返售证券利息	39,940.88
应收申购款利息	-
其他	50.67
合计	7,215,302.68

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	343,328.16
银行间市场应付交易费用	2,323.47
合计	345,651.63

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	0.68
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
债券账户维护费	9,000.00
合计	103,220.23

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国富新趋势混合 A		
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	519,698,591.47	519,698,591.47
本期申购	212,038,854.38	212,038,854.38
本期赎回(以“-”号填列)	-327,017,326.29	-327,017,326.29
本期末	404,720,119.56	404,720,119.56

金额单位：人民币元

国富新趋势混合 C	
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	132,919,452.12	132,919,452.12
本期申购	125,096,350.78	125,096,350.78
本期赎回(以“-”号填列)	-96,768,908.99	-96,768,908.99
本期末	161,246,893.91	161,246,893.91

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

国富新趋势混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	50,959,952.89	6,369,217.05	57,329,169.94
本期利润	29,751,101.64	8,584,292.56	38,335,394.20
本期基金份额交易产生的变动数	-12,016,854.76	-5,685,532.14	-17,702,386.90
其中：基金申购款	29,061,162.22	3,602,602.43	32,663,764.65
基金赎回款	-41,078,016.98	-9,288,134.57	-50,366,151.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,694,199.77	9,267,977.47	77,962,177.24

单位：人民币元

国富新趋势混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,355,572.38	1,679,727.99	14,035,300.37
本期利润	10,692,520.54	936,757.50	11,629,278.04
本期基金份额交易产生的变动数	3,252,346.33	1,128,904.50	4,381,250.83
其中：基金申购款	12,199,450.59	4,112,433.46	16,311,884.05
基金赎回款	-8,947,104.26	-2,983,528.96	-11,930,633.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,300,439.25	3,745,389.99	30,045,829.24

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	28,434.44
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	46,411.43
其他	1,009.86
合计	75,855.73

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	475,428,923.34
减：卖出股票成本总额	438,574,822.48
买卖股票差价收入	36,854,100.86

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	-804,239.88
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	-804,239.88

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	820,226,587.59
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	808,943,675.14
减：应收利息总额	12,087,152.33
买卖债券差价收入	-804,239.88

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	1,272,209.60
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,272,209.60

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	9,521,050.06
——股票投资	8,791,514.98
——债券投资	729,535.08
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	9,521,050.06

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	4,110.76
基金转换费收入	17.80
合计	4,128.56

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 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	1,331,736.32
银行间市场交易费用	3,777.50
合计	1,335,513.82

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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
债券账户维护费	18,000.00
银行汇划费用	7,164.70
其他手续费	600.00
律师费	2,300.00
合计	122,284.25

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

中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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

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

金额单位：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	
	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	47,477,711.44	5.47%	-	-

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有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国海证券	44,216.62	5.86%	24,416.27	7.11%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国海证券	-	-	-	-

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。权证交易不计佣金。
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

务等。

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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	1,855,547.91	215,010.55
其中：支付销售机构的客户维护费	118,670.25	125,370.46

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 0.6% 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 0.6% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	309,257.98	35,835.13

注：支付基金托管人中国工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 X 0.1% / 当年天数。

6.4.10.2.3 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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富新趋势混合 A	国富新趋势混合 C	合计
国海富兰克林基金管理	-	131,831.59	131,831.59

有限公司			
国海证券	-	0.39	0.39
合计	-	131,831.98	131,831.98
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	国富新趋势混合 A	国富新趋势混合 C	合计
合计	-	-	-

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 0.30% 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 × 0.30% ÷ 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趋势灵活配置混合型证券投资基金销售服务费率优惠的公告》，自 2018 年 9 月 5 日开始对富兰克林国海新趋势灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额(简称“国富新趋势混合 C”，代码：005553)实行销售服务费率优惠，结束时间国海富兰克林基金管理有限公司届时将另行公告。优惠期间销售服务费率由原先的 0.30% 调整为 0.01%。

3、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趋势灵活配置混合型证券投资基金销售服务费率优惠调整的公告》，自 2019 年 3 月 14 日开始对富兰克林国海新趋势灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额(简称“国富新趋势混合 C”，代码：005553)实行销售服务费率优惠调整，结束时间国海富兰克林基金管理有限公司届时将另行公告。优惠调整期间销售服务费率由 0.01% 调整为 0.20%。

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
中国工商银行	12,665,193.16	28,434.44	2,199,251.88	16,659.70

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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须作说明的其他关联交易事项。

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	可流通日	流通受限	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:	期末成本总额	期末估值总额	备注

		日		类型			股)			
688087	英科再生	2021年6月30日	2022年1月10日	新股锁定	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
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	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
600905	三峡能源	2021年6月	2021年12	新股锁定	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-

		2 日	月 10 日							
688696	极米科技	2021 年 2 月 23 日	2021 年 9 月 3 日	新股锁定	133.73	780.24	1,252	167,429.96	976,860.48	-
688317	之江生物	2021 年 1 月 8 日	2021 年 7 月 19 日	新股锁定	43.22	63.82	5,289	228,590.58	337,543.98	-
688609	九联科技	2021 年 3 月 15 日	2021 年 9 月 23 日	新股锁定	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
688216	气派科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 23 日	新股锁定	14.82	47.64	2,000	29,640.00	95,280.00	-
688633	星球石墨	2021 年 3 月 17 日	2021 年 9 月 24 日	新股锁定	33.62	53.14	1,558	52,379.96	82,792.12	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁定	47.33	251.96	322	15,240.26	81,131.12	-
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	611	20,297.42	53,462.50	-
688260	昀冢科技	2021 年 3 月 25 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁定	9.63	16.41	2,990	28,793.70	49,065.90	-
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	2021 年 12	新股锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-

		8 日	月 17 日							
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	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
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	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
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	2021 年 12	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-

		27 日	月 7 日							
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	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
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	2021	2021	新股	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-

	传媒	年 4 月 28 日	年 11 月 11 日	锁定						
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	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股锁定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
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	-
301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新股锁定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
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	2021	2021	新股	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

	科技	年 6 月 9 日	年 12 月 17 日	锁定						
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	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
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、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。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、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。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 146,500,000.00 元，截至 2021 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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、资产支持证券投资及权证投资等。本基金在日常投资管理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“风险和收益相匹配”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工商银行，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。

本基金固定收益类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	70,205,000.00	119,842,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	61,006,000.00	57,721,214.50
合计	131,211,000.00	177,563,214.50

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	331,367,280.00	112,507,604.90
AAA 以下	30,090,000.00	38,715,029.40
未评级	-	2,023,800.00
合计	361,457,280.00	153,246,434.30

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的同业存单投资

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	29,130,000.00	87,417,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	29,130,000.00	87,417,000.00

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，除卖出回购金融资产款余额中有 146500000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约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、流通受限制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上市公司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	12,665,193.16	-	-	-	12,665,193.16
结算备付金	1,582,231.50	-	-	-	1,582,231.50
存出保证金	125,093.88	-	-	-	125,093.88
交易性金融资产	160,621,280.00	361,008,000.00	169,000.00	136,779,500.40	658,577,780.40
买入返售金融资产	147,000,223.50	-	-	-	147,000,223.50
应收证券清算款	-	-	-	3,498,438.66	3,498,438.66
应收利息	-	-	-	7,215,302.68	7,215,302.68
应收申购款	-	-	-	202,839.73	202,839.73
资产总计	321,994,022.04	361,008,000.00	169,000.00	147,696,081.47	830,867,103.51
负债					

卖出回购金融资产款	146,500,000.00	-	-	-	146,500,000.00
应付证券清算款	-	-	-	9,305,232.41	9,305,232.41
应付赎回款	-	-	-	245,902.73	245,902.73
应付管理人报酬	-	-	-	299,145.65	299,145.65
应付托管费	-	-	-	49,857.59	49,857.59
应付销售服务费	-	-	-	30,438.03	30,438.03
应付交易费用	-	-	-	345,651.63	345,651.63
应交税费	-	-	-	12,635.29	12,635.29
其他负债	-	-	-	103,220.23	103,220.23
负债总计	146,500,000.00	-	-	10,392,083.56	156,892,083.56
利率敏感度缺口	175,494,022.04	361,008,000.00	169,000.00	137,303,997.91	673,975,019.95
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	8,271,221.84	-	-	-	8,271,221.84
结算备付金	3,674,943.87	-	-	-	3,674,943.87
存出保证金	109,349.63	-	-	-	109,349.63
交易性金融资产	327,169,401.50	90,717,088.90	340,158.40	162,268,140.25	580,494,789.05
买入返售金融资产	124,300,000.00	-	-	-	124,300,000.00
应收利息	-	-	-	5,880,224.03	5,880,224.03
应收申购款	-	-	-	3,282,679.10	3,282,679.10
资产总计	463,524,916.84	90,717,088.90	340,158.40	171,431,043.38	726,013,207.52
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,101,255.07	1,101,255.07
应付管理人报酬	-	-	-	341,498.27	341,498.27
应付托管费	-	-	-	56,916.37	56,916.37
应付销售服务费	-	-	-	18,858.29	18,858.29
应付交易费用	-	-	-	347,338.51	347,338.51
应交税费	-	-	-	15,827.11	15,827.11
其他负债	-	-	-	149,000.00	149,000.00
负债总计	-	-	-	2,030,693.62	2,030,693.62
利率敏感度缺口	463,524,916.84	90,717,088.90	340,158.40	169,400,349.76	723,982,513.90

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 157	增加约 65
	市场利率上升 25 个基点	减少约 156	减少约 64

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投资比例为基金总资产的 0-95%，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	136,779,500.40	20.29	162,268,140.25	22.41
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	136,779,500.40	20.29	162,268,140.25	22.41

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）
	业绩比较基准上升5%	增加约1,419	增加约362
	业绩比较基准下降5%	减少约1,419	减少约362

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129,121,101.43元，属于第二层次的余额为529,456,678.97元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次161,201,113.10元，第二层次419,293,675.95元，

无第三层次)。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 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(2021 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	136,779,500.40	16.46
	其中：股票	136,779,500.40	16.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	521,798,280.00	62.80
	其中：债券	521,798,280.00	62.80
	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	147,000,223.50	17.69
	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	14,247,424.66	1.71
8	其他各项资产	11,041,674.95	1.33
9	合计	830,867,103.51	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	88,428,527.18	13.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.77
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	86,628.46	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	5,950,910.00	0.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,903,926.97	0.43
J	金融业	31,334,708.46	4.65
K	房地产业	291,785.00	0.04
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	2,581,344.33	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,262.03	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	136,779,500.40	20.29

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”。

7.2.2 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	002648	卫星石化	539,440	21,140,653.60	3.14
2	600919	江苏银行	2,063,200	14,648,720.00	2.17
3	601677	明泰铝业	616,000	12,042,800.00	1.79
4	000001	平安银行	427,700	9,674,574.00	1.44
5	603901	永创智能	424,606	7,655,646.18	1.14
6	002724	海洋王	524,580	7,139,533.80	1.06
7	601318	中国平安	105,400	6,775,112.00	1.01
8	601717	郑煤机	546,500	6,355,795.00	0.94
9	002928	华夏航空	394,100	5,950,910.00	0.88
10	000338	潍柴动力	311,400	5,564,718.00	0.83
11	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.76
12	300587	天铁股份	154,363	3,465,449.35	0.51
13	000651	格力电器	65,400	3,407,340.00	0.51
14	600315	上海家化	55,900	3,361,826.00	0.50
15	002759	天际股份	88,800	3,298,920.00	0.49
16	002043	兔宝宝	329,590	3,249,757.40	0.48
17	000830	鲁西化工	152,700	2,860,071.00	0.42
18	600426	华鲁恒升	88,700	2,745,265.00	0.41
19	600406	国电南瑞	116,640	2,710,713.60	0.40

20	600323	瀚蓝环境	116,800	2,545,072.00	0.38
21	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.16
22	688696	极米科技	1,252	976,860.48	0.14
23	688063	派能科技	4,124	811,603.20	0.12
24	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.05
25	688317	之江生物	5,289	337,543.98	0.05
26	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.05
27	002968	新大正	6,700	291,785.00	0.04
28	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.04
29	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.04
30	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.03
31	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.02
32	688083	中望软件	277	152,987.10	0.02
33	688575	亚辉龙	3,435	152,514.00	0.02
34	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.02
35	688639	华恒生物	2,302	110,472.98	0.02
36	300919	中伟股份	594	96,822.00	0.01
37	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.01
38	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.01
39	300957	贝泰妮	322	81,131.12	0.01
40	600036	招商银行	1,300	70,447.00	0.01
41	600801	华新水泥	3,160	55,521.20	0.01
42	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
43	300979	华利集团	611	53,462.50	0.01
44	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
45	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.01
46	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
47	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
48	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.01
49	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.01
50	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
51	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
52	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
53	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
54	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
55	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
56	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
57	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
58	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00

59	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
60	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
61	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
62	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
63	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
64	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
65	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
66	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
67	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
68	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
69	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
70	600486	扬农化工	100	11,177.00	0.00
71	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
72	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
73	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
74	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
75	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
76	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
77	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
78	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
79	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
80	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
81	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
82	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
83	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
84	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
85	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
86	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
87	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
88	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
89	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
90	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
91	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
92	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
93	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
94	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
95	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
96	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
97	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00

98	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
99	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
100	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
101	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
102	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
103	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
104	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
105	601601	中国太保	100	2,897.00	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	300587	天铁股份	25,187,681.16	3.48
2	601677	明泰铝业	17,068,919.00	2.36
3	600919	江苏银行	15,766,170.00	2.18
4	000001	平安银行	14,599,338.22	2.02
5	601166	兴业银行	14,507,311.00	2.00
6	600456	宝钛股份	14,209,518.18	1.96
7	603901	永创智能	14,061,541.00	1.94
8	002648	卫星石化	13,068,180.20	1.81
9	002078	太阳纸业	12,855,097.00	1.78
10	000338	潍柴动力	10,048,328.43	1.39
11	601601	中国太保	9,460,073.00	1.31
12	300059	东方财富	7,210,251.03	1.00
13	600536	中国软件	7,206,046.88	1.00
14	000333	美的集团	7,181,992.00	0.99
15	000066	中国长城	7,146,394.90	0.99
16	000651	格力电器	6,978,207.00	0.96
17	002064	华峰化学	6,749,096.00	0.93
18	000932	华菱钢铁	6,654,413.00	0.92
19	002724	海洋王	6,269,851.60	0.87
20	002928	华夏航空	6,241,861.78	0.86

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	300587	天铁股份	28,249,839.20	3.90
2	601166	兴业银行	24,593,798.01	3.40
3	000001	平安银行	23,633,882.95	3.26
4	000651	格力电器	19,864,342.09	2.74
5	600048	保利地产	18,817,466.00	2.60
6	000002	万科A	14,652,105.07	2.02
7	601318	中国平安	13,500,044.33	1.86
8	600690	海尔智家	13,153,753.00	1.82
9	600456	宝钛股份	11,765,007.43	1.63
10	002064	华峰化学	11,119,644.88	1.54
11	002493	荣盛石化	10,900,271.21	1.51
12	002078	太阳纸业	10,488,612.00	1.45
13	000932	华菱钢铁	9,759,737.80	1.35
14	601899	紫金矿业	9,596,958.00	1.33
15	002648	卫星石化	9,241,336.00	1.28
16	600036	招商银行	9,195,378.00	1.27
17	603901	永创智能	9,098,561.00	1.26
18	600660	福耀玻璃	9,058,082.99	1.25
19	002043	兔宝宝	8,717,772.40	1.20
20	300059	东方财富	7,804,590.00	1.08

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	404,294,667.65
卖出股票收入（成交）总额	475,428,923.34

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	41,000,000.00	6.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	351,285,280.00	52.12
5	企业短期融资券	60,196,000.00	8.93
6	中期票据	40,018,000.00	5.94
7	可转债（可交换债）	169,000.00	0.03
8	同业存单	29,130,000.00	4.32
9	其他	-	-
10	合计	521,798,280.00	77.42

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	175122	20 中金 07	500,000	50,620,000.00	7.51
2	163105	20 国君 G1	500,000	50,225,000.00	7.45
3	188035	21 中财 G3	500,000	50,170,000.00	7.44
4	019640	20 国债 10	410,000	41,000,000.00	6.08
5	163085	19 诚通 01	300,000	30,150,000.00	4.47

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

本基金本期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本期投资的前十名证券中，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：

2021 年 3 月 24 日，海通证券股份有限公司（以下简称“公司”）及相关责任人员分别收到了中国证券监督管理委员会上海监管局（以下简称“上海证监局”）出具的行政监管措施事先告知书，具体情况如下：

公司在业务开展过程中存在以下行为：

一是公司在开展部分投资顾问、私募资产管理业务过程中，未按照审慎经营原则，有效控制和防范风险，未能审慎评估公司经营管理行为对证券市场的影响。上述行为违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条第一款、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令第 151 号）第三条第二款和《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 133 号，经证监会令第 166 号修正，以下简称《合规办法》）第六条第八项的规定。

二是公司未将相关业务行为纳入全面合规风控体系，合规风控机制存在缺失，违反了《合规办法》第三条和《证券公司风险控制指标管理办法》（证监会令第 125 号，经证监会令第 166 号修正）第六条第一款的规定。

三是公司投资银行业务内部控制存在漏洞，债券承销与资产管理等业务缺少有效隔离，利益冲突审查机制存在缺失，不符合《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》（银发[2017]302 号）第二条第二项和《证券公司投资银行类业务内部控制指引》（证监会公告[2018]6 号）第四十五条的规定，违反了《合规办法》第六条第六项的规定。

上海证监局拟做出如下监督管理措施决定：

一是责令海通证券股份有限公司自监督管理措施决定作出之日起 1 年内，每 3 个月开展一次内部合规检查，并在每次检查后 10 个工作日内，向上海证监局报送合规检查报告。

二是要求海通证券自决定作出之日起 1 年内增加内部合规检查次数并提交合规检查报告，自决定作出之日起 12 个月内暂停为机构投资者提供债券投资顾问业务。

本基金对海通证券投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件仅对海通证券短期经营有一定影响，不改变长期投资价值。同时由于本基金看好海通证券长期发展，因此买入海通证券。本基金管理人对该股的投资决策遵循公司的投资决策制度。

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	125,093.88
2	应收证券清算款	3,498,438.66
3	应收股利	-
4	应收利息	7,215,302.68
5	应收申购款	202,839.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	11,041,674.95
---	----	---------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国富新趋势混合 A	223	1,814,888.43	403,867,127.89	99.79%	852,991.67	0.21%
国富新趋势混合 C	2,865	56,281.64	133,314,759.03	82.68%	27,932,134.88	17.32%
合计	3,088	183,279.47	537,181,886.92	94.91%	28,785,126.55	5.09%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国富新趋势混合 A	0
	国富新趋势混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国富新趋势混合 A	0
	国富新趋势混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富新趋势混合 A	国富新趋势混合 C
基金合同生效日（2018 年 2 月 8 日）基金份额总额	48,239,095.58	163,154,702.14
本报告期期初基金份额总额	519,698,591.47	132,919,452.12
本报告期基金总申购份额	212,038,854.38	125,096,350.78
减：本报告期基金总赎回份额	327,017,326.29	96,768,908.99
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	404,720,119.56	161,246,893.91

§ 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

中国工商银行股份有限公司根据工作需要, 任命刘彤女士担任资产托管部总经理。李勇先生不再担任资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

(一) 基金管理人及高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形:

本报告期内, 基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

(二) 基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国海证券	2	47,477,711.44	5.47%	44,216.62	5.86%	-
申万宏源	1	66,392,304.90	7.65%	61,831.15	8.20%	-
国泰君安	1	84,126,551.62	9.69%	78,347.26	10.39%	-
海通证券	1	192,744,650.98	22.20%	179,502.24	23.81%	-

国金证券	2	47,946,264.58	5.52%	44,652.08	5.92%	-
东北证券	1	1,329,076.40	0.15%	1,237.61	0.16%	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	163,008,887.78	18.78%	119,209.19	15.81%	-
广发证券	1	155,706,277.76	17.94%	145,010.15	19.23%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	52,638,552.16	6.06%	38,494.54	5.11%	-
西部证券	1	56,695,679.82	6.53%	41,461.89	5.50%	-
东方证券	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，本基金租用华安证券深圳交易单元 1 个、西部证券深圳交易单元 1 个、东方证券深圳交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国海证券	491,936,357.25	78.42%	190,000.00	0.00%	-	-
申万宏源	16,879,012.17	2.69%	1,409,200,000.00	26.97%	-	-
国泰君安	-	-	494,000.00	0.01%	-	-
海通证券	96,028,171.40	15.31%	2,726,500,000.00	52.19%	-	-
国金证券	1,183.71	0.00%	-	-	-	-
东北证券	88,111.00	0.01%	191,000.00	0.00%	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
国盛证券	918,060.88	0.15%	40,135,000.00	0.77%	-	-
广发证券	21,473,169.18	3.42%	1,047,500,000.00	20.05%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	41,000.00	0.00%	-	-
西部证券	-	-	253,000.00	0.00%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

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	富兰克林国海新趋势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奕丰基金销售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 1 月 26 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务、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 3 月 22 日
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关于修订旗下部分公募基金法律文件的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 3 月 30 日
8	富兰克林国海新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 3 月 30 日
9	富兰克林国海新趋势灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 3 月 30 日
10	富兰克林国海新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 3 月 30 日
11	富兰克林国海新趋势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 3 月 30 日
12	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
13	富兰克林国海新趋势灵活配	中国证监会指定报	2021 年 3 月 31 日

	置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	刊及指定网站	
14	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
15	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
16	富兰克林国海新趋势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
17	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
18	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西部证券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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	富兰克林国海新趋势灵活配	中国证监会指定报	2021 年 6 月 30 日

	置混合型证券投资基金更新 招募说明书（2021 年 2 号）	刊及指定网站	
--	-----------------------------------	--------	--

§ 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 2 月 26 日至 2021 年 6 月 30 日	89,733,488.87	44,009,330.16	-	133,742,819.03	23.63%
	2	2021 年 3 月 4 日至 2021 年 4 月 20 日	-	98,732,015.59	-	98,732,015.59	17.44%
	3	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 3 月 3 日	214,751,633.99	-	214,751,633.99	-	-
	4	2021 年 3 月 4 日至 2021 年 6 月 17 日	102,706,816.06	-	-	102,706,816.06	18.15%

产品特有风险

1. 流动性风险

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

2. 估值风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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投资风险，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新趋势灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海新趋势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海新趋势灵活配置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