

富兰克林国海估值优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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>46</b>
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.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	61
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>64</b>
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.....	64

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海估值优势灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国富估值优势混合
基金主代码	006039
交易代码	006039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 8 月 22 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	263,217,605.75 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极优选 A 股和港股通标的股票当中具有明显估值优势且质地优良的股票，同时通过严格风险控制来追求稳健收益，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金贯彻“自上而下”的资产配置策略。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。在股票投资上，本基金管理人将坚持自上而下的行业配置与自下而上的个股精选相结合的策略；在债券投资上，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、国债期货及中小企业私募债投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+恒生指数收益率×30%+中债综合指数收益率×30%
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	135,218,116.17
本期利润	88,069,615.80
加权平均基金份额本期利润	0.3342
本期加权平均净值利润率	12.81%
本期基金份额净值增长率	17.12%
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	379,457,757.42
期末可供分配基金份额利润	1.4416
期末基金资产净值	730,120,088.61
期末基金份额净值	2.7738
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	177.38%

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

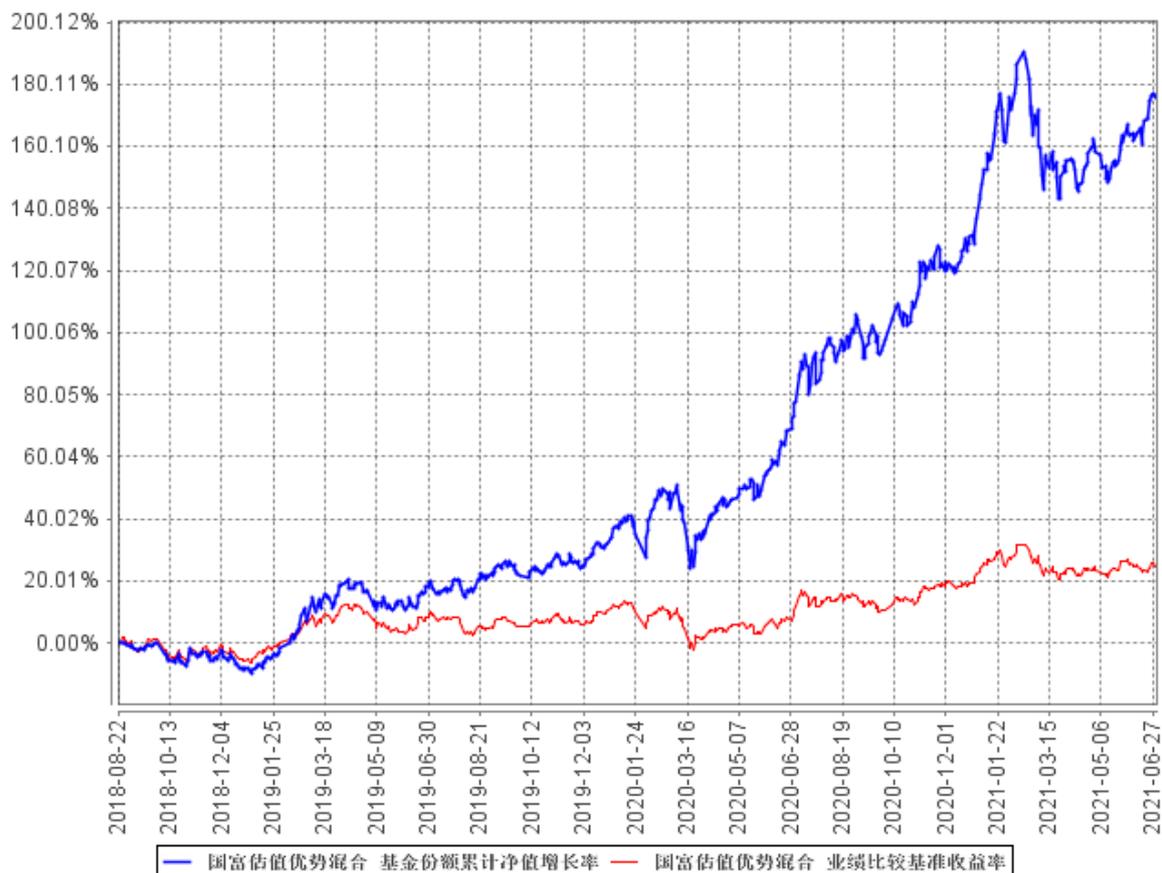
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.79%	0.88%	-1.14%	0.50%	5.93%	0.38%
过去三个月	10.01%	0.92%	2.08%	0.59%	7.93%	0.33%
过去六个月	17.12%	1.44%	2.31%	0.80%	14.81%	0.64%

过去一年	60.95%	1.45%	15.71%	0.78%	45.24%	0.67%
自基金合同生效起至今	177.38%	1.34%	24.89%	0.85%	152.49%	0.49%

### 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

国富估值优势混合 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 2018 年 8 月 22 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		
徐成	公司 QDII 投资总监，国富亚洲机会股票(QDII)基金、国富大中华精选混合(QDII)基金、国富美元债定期债券(QDII)基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金、国富全球科技互联混合(QDII)基金	2018年8月22日	-	15年	徐成先生，CFA，朴茨茅斯大学（英国）金融决策分析硕士。历任永丰金证券（亚洲）有限公司上海办事处研究员，新加坡东京海上国际资产管理有限公司上海办事处研究员、高级研究员、首席代表，国海富兰克林基金管理有限公司 QDII 投资副总监。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司 QDII 投资总监，国富亚洲机会股票(QDII)基金、国富大中华精选混合(QDII)基金、国富美元债定期债券(QDII)基金、国富沪港深成长精选股票基金、国

	及国富港股通远见价值混合基金的基金经理				富估值优势混合基金、国富全球科技互联混合(QDII)基金及国富港股通远见价值混合基金的基金经理。
--	---------------------	--	--	--	--

注：

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海估值优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。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，中国经济继续延续良好的复苏势头，顺周期板块表现较好；此外，新能源、电动车板块也有不错的发展空间。本基金也逐步买入优质、估值合理的美国和台湾的科技股，这些企业有望得益于行业发展所带来的新机遇。总体策略上，本基金均衡配置优质成长股和顺周期行业。

行业配置上，主要超配顺周期、新能源、硬科技、物业、生物医药以及大消费等行业。

### 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 2.7738 元，本报告期基金份额净值上涨 17.12%，同期业绩比较基准上涨 2.31%，跑赢业绩比较基准 14.81%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济处在转型期，新经济方兴未艾、未来发展的空间较大；老经济中的龙头企业市场份额不断扩大，中长期来看核心企业盈利能力有望逐步得到改善。

目前港股估值仍并不高，市盈率低于美国、欧洲以及亚洲其它市场。相对于 A 股，港股在平均估值上仍有优势。A 股也有不少优质的企业值得重点关注。

2021 年，欧美经济可能先从疫情复苏，全球经济也有望逐步企稳回升。但仍不能忽视疫情二次来袭的可能性。

本基金将关注有结构性增长机会的行业，如新能源、电动车、生物医药、硬科技以及大消费等；同时，也将继续关注得益于经济企稳回升的顺周期。

## 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，根据基金合同和相关法律的规定，本基金无应分配但尚未分配的利润。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海估值优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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	89,766,744.94	61,653,112.83
结算备付金		817,768.32	243,341.87
存出保证金		292,682.74	284,285.79
交易性金融资产	6.4.7.2	653,322,333.79	570,811,148.66
其中：股票投资		620,239,092.69	562,821,548.66
基金投资		-	-
债券投资		33,083,241.10	7,989,600.00
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	-	28,900,000.00
应收证券清算款		-	415,689.09
应收利息	6.4.7.5	601,042.35	90,986.30
应收股利		1,079,913.58	137,600.00
应收申购款		1,360,435.16	245,242.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		747,240,920.88	662,781,407.49
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,952,477.55	27,839,458.31
应付赎回款		1,872,899.89	496,370.85
应付管理人报酬		788,412.13	761,014.21
应付托管费		131,402.04	126,835.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,278,501.34	503,516.31
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	97,139.32	114,669.67
负债合计		17,120,832.27	29,841,865.06
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	263,217,605.75	267,238,705.61
未分配利润	6.4.7.10	466,902,482.86	365,700,836.82
所有者权益合计		730,120,088.61	632,939,542.43
负债和所有者权益总计		747,240,920.88	662,781,407.49

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.7738 元，基金份额总额 263,217,605.75 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海估值优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
<b>一、收入</b>		98,908,447.22	13,001,198.39
1.利息收入		806,166.81	54,192.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	325,983.17	19,741.25
债券利息收入		476,976.36	34,451.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,207.28	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		144,634,685.79	8,942,132.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	141,621,394.99	8,515,335.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-60,596.91	4,360.80
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	3,073,887.71	422,435.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-47,148,500.37	3,982,201.22
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	616,094.99	22,672.13
<b>减：二、费用</b>		10,838,831.42	918,470.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,147,812.89	351,824.43
2. 托管费	6.4.10.2.2	857,968.83	58,637.43
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.18	4,712,585.78	439,489.59
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.05
7. 其他费用	6.4.7.19	120,463.92	68,518.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		88,069,615.80	12,082,728.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		88,069,615.80	12,082,728.31

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海估值优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）	267,238,705.61	365,700,836.82	632,939,542.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	88,069,615.80	88,069,615.80
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）	-4,021,099.86	13,132,030.24	9,110,930.38
其中：1.基金申购款	252,495,907.75	410,889,048.36	663,384,956.11
2.基金赎回款	-256,517,007.61	-397,757,018.12	-654,274,025.73
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）	263,217,605.75	466,902,482.86	730,120,088.61
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		



于 2018 年 8 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 545,563,004.37 份基金份额，其中认购资金利息折合 143,012.11 份基金份额。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(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《富兰克林国海估值优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，包括内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、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、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 0%-95%，港股投资比例不得超过股票资产的 50%；其中权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；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(现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40%+恒生指数收益率×30%+中债综合指数收益率×30%。

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》、《富兰克林国海估值优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	89,766,744.94
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	89,766,744.94

#### 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	570,691,528.47	620,239,092.69	49,547,564.22
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	33,083,241.10	-21,786.40
	银行间市场	-	-
	合计	33,083,241.10	-21,786.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	603,796,555.97	653,322,333.79	49,525,777.82

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 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	13,956.83
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	1,779.28
应收债券利息	584,947.40
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	358.84
合计	601,042.35

#### 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	1,278,501.34
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,278,501.34

#### 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	3,379.17
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
债券账户维护费	4,500.00
合计	97,139.32

#### 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	267,238,705.61	267,238,705.61
本期申购	252,495,907.75	252,495,907.75

本期赎回(以“-”号填列)	-256,517,007.61	-256,517,007.61
本期末	263,217,605.75	263,217,605.75

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	254,921,624.95	110,779,211.87	365,700,836.82
本期利润	135,218,116.17	-47,148,500.37	88,069,615.80
本期基金份额交易产生的变动数	-10,681,983.70	23,814,013.94	13,132,030.24
其中：基金申购款	337,414,140.89	73,474,907.47	410,889,048.36
基金赎回款	-348,096,124.59	-49,660,893.53	-397,757,018.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	379,457,757.42	87,444,725.44	466,902,482.86

#### 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	247,499.35
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	71,236.54
其他	7,247.28
合计	325,983.17

#### 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	1,415,194,526.25
减：卖出股票成本总额	1,273,573,131.26
买卖股票差价收入	141,621,394.99

### 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	-60,596.91
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	-60,596.91

#### 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	49,550,922.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	48,959,287.50
减：应收利息总额	652,232.03
买卖债券差价收入	-60,596.91

### 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	3,073,887.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,073,887.71

### 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	-47,148,500.37
——股票投资	-47,138,013.97
——债券投资	-10,486.40
——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	-47,148,500.37

#### 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	613,630.35
基金转换费收入	2,464.64
合计	616,094.99

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	4,712,585.78
银行间市场交易费用	-
合计	4,712,585.78

#### 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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
债券账户维护费	9,000.00
银行汇划费用	22,203.77
合计	120,463.92

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

### 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	5,147,812.89	351,824.43
其中：支付销售机构的客户维护费	685,654.56	103,676.80

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 1.50% 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 × 1.50% / 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	857,968.83	58,637.43

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 × 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
农业银行	89,766,744.94	247,499.35	1,564,936.43	12,227.31

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

本基金本报告期内无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
000403	派林	2021 年	2021	非公	33.33	30.23	127,813	4,260,007.29	3,863,786.99	-

	生物	2月22日	年8月23日	发行的股份锁定							
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	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	-	

			日								
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	-	
688686	奥普特	2020年12月24日	2021年7月1日	新股锁定	78.49	451.00	2,330	182,881.70	1,050,830.00	-	
688665	四方光电	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	-	
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	251.96	539	25,510.87	135,806.44	-	
688661	和林微纳	2021年3月19日	2021年9月29日	新股锁定	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-	
688689	银河微电	2021年1月15日	2021年7月27日	新股锁定	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	-	
688625	呈和科技	2021年5月31日	2021年12月7日	新股锁定	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-	
688575	亚辉龙	2021年5月10日	2021年11月17日	新股锁定	14.80	32.09	3,435	50,838.00	110,229.15	-	
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	-	
688355	明志科技	2021年4月30日	2021年11月12日	新股锁定	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-	
688616	西力科技	2021年3月10日	2021年9月22日	新股锁定	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	-	

			日							
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	-
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	-

			日							
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	-
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	C嘉益	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

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的固定收益品种(2020 年 12 月 31 日：同)。

### 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产和债券投资等

##### 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	89,766,744.94	-	-	-	89,766,744.94

结算备付金	817,768.32	-	-	-	817,768.32
存出保证金	292,682.74	-	-	-	292,682.74
交易性金融资产	33,083,241.10	-	-	-620,239,092.69	653,322,333.79
应收利息	-	-	-	601,042.35	601,042.35
应收股利	-	-	-	1,079,913.58	1,079,913.58
应收申购款	-	-	-	1,360,435.16	1,360,435.16
资产总计	123,960,437.10	-	-	-623,280,483.78	747,240,920.88
负债					
应付证券清算款	-	-	-	12,952,477.55	12,952,477.55
应付赎回款	-	-	-	1,872,899.89	1,872,899.89
应付管理人报酬	-	-	-	788,412.13	788,412.13
应付托管费	-	-	-	131,402.04	131,402.04
应付交易费用	-	-	-	1,278,501.34	1,278,501.34
其他负债	-	-	-	97,139.32	97,139.32
负债总计	-	-	-	17,120,832.27	17,120,832.27
利率敏感度缺口	123,960,437.10	-	-	-606,159,651.51	730,120,088.61
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	61,653,112.83	-	-	-	61,653,112.83
结算备付金	243,341.87	-	-	-	243,341.87
存出保证金	284,285.79	-	-	-	284,285.79
交易性金融资产	7,989,600.00	-	-	-562,821,548.66	570,811,148.66
买入返售金融资产	28,900,000.00	-	-	-	28,900,000.00
应收证券清算款	-	-	-	415,689.09	415,689.09
应收利息	-	-	-	90,986.30	90,986.30
应收股利	-	-	-	137,600.00	137,600.00
应收申购款	-	-	-	245,242.95	245,242.95
资产总计	99,070,340.49	-	-	-563,711,067.00	662,781,407.49
负债					
应付证券清算款	-	-	-	27,839,458.31	27,839,458.31
应付赎回款	-	-	-	496,370.85	496,370.85
应付管理人报酬	-	-	-	761,014.21	761,014.21
应付托管费	-	-	-	126,835.71	126,835.71
应付交易费用	-	-	-	503,516.31	503,516.31
其他负债	-	-	-	114,669.67	114,669.67
负债总计	-	-	-	29,841,865.06	29,841,865.06
利率敏感度缺口	99,070,340.49	-	-	-533,869,201.94	632,939,542.43

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**

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.53% (2020 年 12 月 31 日：1.26%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 年 12 月 31 日：同)。

**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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

**6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口**

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民 币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	301,946,278.93	-	301,946,278.93
应收股利	-	1,079,913.58	-	1,079,913.58
资产合计	-	303,026,192.51	-	303,026,192.51
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	303,026,192.51	-	303,026,192.51
项目	上年度末			
	2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计

以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	268,588,815.10	-	268,588,815.10
应收股利	-	137,600.00	-	137,600.00
资产合计	-	268,726,415.10	-	268,726,415.10
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	268,726,415.10	-	268,726,415.10

#### 6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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）
	所有外币相对人民币升值5%	增加约1,515	增加约1,343
	所有外币相对人民币贬值5%	减少约1,515	减少约1,343

#### 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资产的 0%-95%，港股投资比例不得超过股票资产的 50%；其中权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%（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	620,239,092.69	84.95	562,821,548.66	88.92
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	620,239,092.69	84.95	562,821,548.66	88.92

#### 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 5,762	增加约 4,8740
	业绩比较基准下降 5%	减少约 5,762	减少约 4,8740

#### 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 608,485,000.72 元，属于第二层次的余额为 44,837,333.07 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层为 557,921,241.65 元，第二层次为 12,889,907.01 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、债券和资产支持证券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(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) 其他

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	620,239,092.69	83.00
	其中：股票	620,239,092.69	83.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	33,083,241.10	4.43
	其中：债券	33,083,241.10	4.43
	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	90,584,513.26	12.12
8	其他各项资产	3,334,073.83	0.45
9	合计	747,240,920.88	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	272,400,382.53	37.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.71
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	-	-
H	住宿和餐饮业	9,544,000.00	1.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,202,132.17	3.31
J	金融业	6,837,990.30	0.94
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	36,272.33	0.00
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	318,292,813.76	43.59

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

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
消费者非必需品	111,080,605.63	15.21
公用事业	4,905,094.96	0.67
电信业务	-	0.00
信息技术	77,505,036.18	10.62
金融	29,331,153.66	4.02
医疗保健	15,743,203.22	2.16
原材料	-	0.00
工业	-	0.00
能源	9,918,809.64	1.36
消费者常用品	7,692,438.15	1.05
房地产	45,769,937.49	6.27
合计	301,946,278.93	41.36

注：以上分类采用 GICS 行业分类标准。

### 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	878,892	34,443,777.48	4.72
2	00700 HK	腾讯控股	52,000	25,268,605.44	3.46
3	688018	乐鑫科技	103,445	24,146,131.90	3.31
4	03690 HK	美团-W	75,000	19,994,882.40	2.74
5	00868 HK	信义玻璃	754,000	19,856,840.33	2.72
6	02382 HK	舜宇光学科技	97,100	19,827,085.15	2.72
7	002241	歌尔股份	447,100	19,109,054.00	2.62
8	688008	澜起科技	303,053	18,904,446.14	2.59
9	300274	阳光电源	146,500	16,856,290.00	2.31

10	09926 HK	康方生物— B	302,000	15,743,203.22	2.16
11	002833	弘亚数控	390,096	15,116,220.00	2.07
12	601678	滨化股份	1,762,900	13,944,539.00	1.91
13	01658 HK	邮储银行	3,150,000	13,708,101.96	1.88
14	02869 HK	绿城服务	1,300,000	13,045,350.24	1.79
15	603218	日月股份	472,639	12,799,064.12	1.75
16	06110 HK	滔搏	1,176,000	12,446,851.74	1.70
17	002601	龙麟佰利	350,000	12,103,000.00	1.66
18	601615	明阳智能	745,600	12,071,264.00	1.65
19	01995 HK	永升生活服务	750,000	12,031,876.80	1.65
20	03888 HK	金山软件(二 百)	300,000	11,619,997.20	1.59
21	601311	骆驼股份	1,000,000	11,570,000.00	1.58
22	601636	旗滨集团	609,865	11,319,094.40	1.55
23	600176	中国巨石	721,453	11,189,736.03	1.53
24	01999 HK	敏华控股	720,000	11,179,161.22	1.53
25	300751	迈为股份	21,860	9,939,742.00	1.36
26	00883 HK	中国海洋石 油	1,350,000	9,918,809.64	1.36
27	01928 HK	金沙中国有 限公司	362,000	9,849,663.79	1.35
28	03606 HK	福耀玻璃	216,000	9,831,191.62	1.35
29	600258	首旅酒店	400,000	9,544,000.00	1.31
30	000830	鲁西化工	500,000	9,365,000.00	1.28
31	06098 HK	碧桂园服务	130,000	9,075,496.56	1.24
32	09909 HK	宝龙商业	395,500	8,984,092.57	1.23
33	603501	韦尔股份	27,900	8,983,800.00	1.23
34	02388 HK	中银香港	400,500	8,781,085.85	1.20
35	01691 HK	J S 环球生 活	475,500	8,645,040.77	1.18
36	002386	天原股份	828,200	8,530,460.00	1.17
37	01458 HK	周黑鸭	993,000	7,692,438.15	1.05
38	002353	杰瑞股份	167,700	7,496,190.00	1.03
39	00354 HK	中国软件国 际	600,000	7,069,351.68	0.97
40	00590 HK	六福集团	313,000	6,979,819.87	0.96
41	00981 HK	中芯国际	350,000	6,960,349.20	0.95
42	002475	立讯精密	150,004	6,900,184.00	0.95

43	01299 HK	友邦保险	85,200	6,841,195.34	0.94
44	300059	东方财富	207,480	6,803,269.20	0.93
45	01211 HK	比亚迪股份	35,000	6,762,314.16	0.93
46	00268 HK	金蝶国际	308,000	6,752,994.86	0.92
47	002541	鸿路钢构	110,700	6,459,345.00	0.88
48	002597	金禾实业	177,100	6,145,370.00	0.84
49	688005	容百科技	47,924	5,808,388.80	0.80
50	02331 HK	李宁	70,000	5,521,682.88	0.76
51	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.70
52	01083 HK	港华燃气	1,027,000	4,905,094.96	0.67
53	000403	派林生物	127,813	3,863,786.99	0.53
54	002254	泰和新材	189,919	3,849,658.13	0.53
55	002511	中顺洁柔	105,083	2,895,036.65	0.40
56	01109 HK	华润置地	100,000	2,616,891.60	0.36
57	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.14
58	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.03
59	300957	贝泰妮	539	135,806.44	0.02
60	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.02
61	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.02
62	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.02
63	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.02
64	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
65	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
66	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.01
67	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
68	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.01
69	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
70	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
71	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
72	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
73	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
74	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
75	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
76	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
77	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
78	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
79	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
80	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
81	02669 HK	中海物业	2,350	16,229.72	0.00

82	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
83	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
84	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
85	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
86	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
87	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
88	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
89	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
90	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
91	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
92	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
93	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
94	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
95	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
96	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
97	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
98	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
99	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
100	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
101	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
102	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
103	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
104	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
105	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
106	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
107	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
108	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
109	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
110	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
111	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
112	06690 HK	海尔智家	320	7,215.80	0.00
113	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
114	301004	C 嘉益	312	6,845.28	0.00
115	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
116	00522 HK	ASM PACIFIC	76	6,652.65	0.00
117	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
118	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
119	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
120	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00

121	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
122	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
123	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
124	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
125	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
126	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
127	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
128	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
129	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
130	00751 HK	创维集团	1,800	3,265.08	0.00
131	00921 HK	海信家电	300	2,675.97	0.00
132	06881 HK	中国银河	200	770.51	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	03690 HK	美团-W	59,589,126.68	9.41
2	002648	卫星石化	48,804,082.20	7.71
3	002601	龙佰集团	46,982,516.00	7.42
4	00700 HK	腾讯控股	40,939,449.88	6.47
5	00868 HK	信义玻璃	33,107,545.36	5.23
6	300124	汇川技术	29,313,176.00	4.63
7	300274	阳光电源	28,945,393.12	4.57
8	688008	澜起科技	26,909,305.42	4.25
9	002241	歌尔股份	26,827,448.97	4.24
10	02382 HK	舜宇光学科技	24,995,359.36	3.95
11	601838	成都银行	24,020,728.00	3.80
12	300413	芒果超媒	23,708,404.00	3.75
13	03888 HK	金山软件(二百)	21,177,334.00	3.35
14	601636	旗滨集团	21,019,035.78	3.32
15	603501	韦尔股份	18,100,484.00	2.86
16	09926 HK	康方生物-B	17,959,030.48	2.84

17	601311	骆驼股份	17,697,128.60	2.80
18	01765 HK	希望教育	16,597,773.94	2.62
19	002304	洋河股份	16,171,137.00	2.55
20	000830	鲁西化工	15,771,341.00	2.49
21	300308	中际旭创	15,718,296.90	2.48
22	300378	鼎捷软件	15,645,366.00	2.47
23	002833	弘亚数控	15,377,424.20	2.43
24	300751	迈为股份	15,334,650.00	2.42
25	000338	潍柴动力	15,006,116.30	2.37
26	01458 HK	周黑鸭	14,544,915.06	2.30
27	600258	首旅酒店	14,417,410.00	2.28
28	603881	数据港	14,096,806.95	2.23
29	01995 HK	永升生活服务	14,009,858.02	2.21
30	00883 HK	中国海洋石油	13,804,178.86	2.18
31	02869 HK	绿城服务	13,493,160.77	2.13
32	06110 HK	滔搏	13,476,525.46	2.13
33	06160 HK	百济神州	13,381,440.05	2.11
34	688018	乐鑫科技	13,363,457.00	2.11
35	03968 HK	招商银行	13,286,966.62	2.10
36	00753 HK	中国国航	12,999,749.79	2.05
37	06098 HK	碧桂园服务	12,987,198.43	2.05
38	601166	兴业银行	12,952,917.51	2.05
39	601318	中国平安	12,821,247.00	2.03

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	002601	龙佰集团	55,039,847.96	8.70
2	002648	卫星石化	52,934,399.71	8.36
3	300274	阳光电源	48,389,053.00	7.65
4	03690 HK	美团-W	41,563,266.34	6.57
5	00700 HK	腾讯控股	39,185,862.76	6.19
6	03888 HK	金山软件（二百）	31,634,793.37	5.00

7	300124	汇川技术	30,055,363.25	4.75
8	601838	成都银行	26,028,829.00	4.11
9	300413	芒果超媒	25,322,780.00	4.00
10	601166	兴业银行	24,822,208.00	3.92
11	03968 HK	招商银行	23,143,773.85	3.66
12	01772 HK	赣锋锂业	23,024,708.08	3.64
13	01458 HK	周黑鸭	20,459,330.79	3.23
14	000830	鲁西化工	20,168,261.00	3.19
15	000001	平安银行	19,938,546.40	3.15
16	601318	中国平安	19,383,038.00	3.06
17	02899 HK	紫金矿业	17,742,550.98	2.80
18	00868 HK	信义玻璃	17,634,797.64	2.79
19	603833	欧派家居	16,931,890.00	2.68
20	03606 HK	福耀玻璃	16,739,989.85	2.64
21	06098 HK	碧桂园服务	16,400,771.18	2.59
22	002304	洋河股份	16,282,051.00	2.57
23	02013 HK	微盟集团	15,353,855.40	2.43
24	600258	首旅酒店	14,545,917.00	2.30
25	01211 HK	比亚迪股份	14,319,495.21	2.26
26	002756	永兴材料	14,215,243.99	2.25
27	002415	海康威视	13,832,932.00	2.19
28	000338	潍柴动力	13,770,485.00	2.18
29	601636	旗滨集团	13,679,359.00	2.16
30	01347 HK	华虹半导体	13,521,210.64	2.14
31	01765 HK	希望教育	13,425,600.82	2.12
32	01813 HK	合景泰富集团	13,411,931.41	2.12
33	00881 HK	中升控股	13,356,122.76	2.11
34	600563	法拉电子	13,057,850.00	2.06
35	00966 HK	中国太平	12,955,362.59	2.05

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	1,378,128,689.26
卖出股票收入（成交）总额	1,415,194,526.25

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	33,083,241.10	4.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	33,083,241.10	4.53

## 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	019645	20 国债 15	329,810	33,083,241.10	4.53

## 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

本基金本报告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：**

浙江卫星石化股份有限公司（以下简称“卫星石化”）于 2020 年 11 月 26 日受到深圳证券交易所（以下简称“交易所”）通报批评处分，主要违规事实公告如下：一、船舶期租协议未履行审议程序且未及时对外披露；二、造船承接协议未履行审议程序且未及时对外披露；鉴于上述违规事实及情节，依据交易所《股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 17.2 条、第 17.3 条、第 17.4 条和交易所《上市公司纪律处分实施标准（试行）》第十六条的规定，经交易所纪律处分委员会审议通过，交易所作出如下处分决定：一、对浙江卫星石化股份有限公司给予通报批评的处分。二、对浙江卫星石化股份有限公司董事长兼总裁杨卫东、董事会秘书沈晓炜给予通报批评的处分。对于浙江卫星石化股份有限公司及相关当事人的上述违规行为及本所给予的处分，交易所将记入上市公司诚信档案，并向社会公开。

本基金对卫星石化投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件不改变长期投资价值。同时由于本基金看好卫星石化长期发展，因此买入。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	292,682.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,079,913.58
4	应收利息	601,042.35
5	应收申购款	1,360,435.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,334,073.83

**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**

本基金本期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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
24,354	10,807.98	184,940,392.85	70.26%	78,277,212.90	29.74%

### 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	158,455.51	0.060199%

### 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	0~10
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（2018年8月22日）基金份额总额	545,563,004.37
本报告期期初基金份额总额	267,238,705.61
本报告期基金总申购份额	252,495,907.75
减：本报告期基金总赎回份额	256,517,007.61
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	263,217,605.75

## § 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	
中金公司	2	581,412,281.10	20.93%	501,251.13	20.95%	-
华安证券	1	425,465,419.68	15.32%	344,507.53	14.40%	-
中信证券	2	411,289,797.74	14.81%	347,172.09	14.51%	-
方正证券	1	305,979,999.22	11.02%	284,959.64	11.91%	-
兴业证券	1	300,619,809.28	10.82%	266,407.80	11.13%	-

东兴证券	1	271,989,107.84	9.79%	249,862.04	10.44%	-
华泰证券	2	178,869,167.17	6.44%	154,901.28	6.47%	-
西藏东方财富证券	2	113,493,838.11	4.09%	82,997.48	3.47%	-
高华证券	1	90,140,854.74	3.25%	83,950.81	3.51%	-
中泰证券	3	72,076,717.37	2.60%	52,709.87	2.20%	-
海通证券	1	13,725,217.71	0.49%	12,782.24	0.53%	-
中信建投	1	12,230,575.76	0.44%	11,390.63	0.48%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
招商证券	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
中金公司	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	13,688,260.80	11.20%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	31,211,321.60	25.54%	-	-	-	-
东兴证券	49,233,493.40	40.29%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-

富证券						
高华证券	28,065,351.30	22.97%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
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	富兰克林国海估值优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	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021年2月24日
5	关于增加中泰证券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5日
6	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	中国证监会指定报刊及指定网站	2021年3月9日

	并实施申购和定期定额投资费率优惠的公告		
7	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
8	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
9	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
10	富兰克林国海估值优势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
11	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
12	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
13	富兰克林国海估值优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
14	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
15	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
16	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
17	富兰克林国海估值优势灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、定期定额投资以及转换转入	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 5 月 20 日

	业务的公告		
18	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
19	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
20	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
21	关于在招商银行招赢通平台开通公司旗下部分基金销售业务并参加其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 22 日
22	关于增加宁波银行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、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 6 月 24 日
23	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
24	富兰克林国海估值优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 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 1 月 1 日至 2021 年 5 月 17 日	112,815,320.40	-	112,815,320.40	-	-
	2	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 1 月 25 日	56,407,378.16	-	56,407,378.16	-	-
	3	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 1 月 25 日	56,407,378.16	-	56,407,378.16	-	-
产品特有风险							
<p>1. 流动性风险</p> <p>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。</p> <p>2. 估值风险</p> <p>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。</p>							

### 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估值优势灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海估值优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海估值优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海估值优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](http://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](http://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