

富兰克林国海基本面优选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：招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。

基金托管人招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

|  |           |
|--|-----------|
| <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>47</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 47        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 47        |
| 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.....     | 48        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 52        |
| 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..... | 55        |
| 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.....    | 55        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 55        |
| 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.....                           | 60        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>63</b> |
| 11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....                   | 63        |

|                         |           |
|-------------------------|-----------|
| <b>§12 备查文件目录</b> ..... | <b>64</b> |
| 12.1 备查文件目录.....        | 64        |
| 12.2 存放地点.....          | 64        |
| 12.3 查阅方式.....          | 64        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 基金名称       | 富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 国富基本面优选混合            |
| 基金主代码      | 008515               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式               |
| 基金合同生效日    | 2020 年 2 月 13 日      |
| 基金管理人      | 国海富兰克林基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司           |
| 报告期末基金份额总额 | 1,859,995,574.28 份   |
| 基金合同存续期    | 不定期                  |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金通过基本面指标精选质地优良的公司，在严控组合风险及考虑流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。   |
| 投资策略   | 本基金通过基本面指标精选质地优良的公司，在严控组合风险及考虑流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。在股票投资上，本基金对内地股票及港股通标的股票，选用长期有效且稳定的基本面选股指标对个股进行筛选，再进一步研究分析加以精选，以选择质地优良、盈利能力突出、增长稳定持续的个股构建投资组合，并合理控制组合的风险暴露，在控制风险的同时最大程度获得收益。在债券投资上，本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。本基金也可进行股指期货及国债期货投资。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率× 50% +恒生指数收益率 ×20% +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 | 招商银行股份有限公司 |

|         |      |  |                          |
|---------|------|--|--------------------------|
|         |      | 限公司  |                          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 储丽莉  | 张燕                       |
|         | 联系电话 | 021-3855 5555  | 0755-8319 9084           |
|         | 电子邮箱 | service@ftsfund.com  | yan_zhang@cmbchina.com   |
| 客户服务电话  |      | 400-700-4518、9510-5680<br>和 021-38789555                   | 95555                    |
| 传真      |      | 021-6888 3050  | 0755-8319 5201           |
| 注册地址    |      | 广西南宁市西乡塘区总部<br>路 1 号中国-东盟科技企业<br>孵化基地一期 A-13 栋三层<br>306 号房 | 深圳市深南大道 7088 号招商银<br>行大厦 |
| 办公地址    |      | 上海市浦东新区世纪大道 8<br>号上海国金中心二期 9 层                             | 深圳市深南大道 7088 号招商银<br>行大厦 |
| 邮政编码    |      | 200120   | 518040                   |
| 法定代表人   |      | 吴显玲  | 缪建民                      |

## 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<br>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<br>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       | 257,236,042.51              |
| 本期利润          | 202,350,807.01              |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1168                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 7.22%                       |
| 本期基金份额净值增长率   | 10.64%                      |
| 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      | 961,657,045.86              |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.5170                      |
| 期末基金资产净值      | 2,980,700,432.69            |
| 期末基金份额净值      | 1.6025                      |
| 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   | 60.25%                      |

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

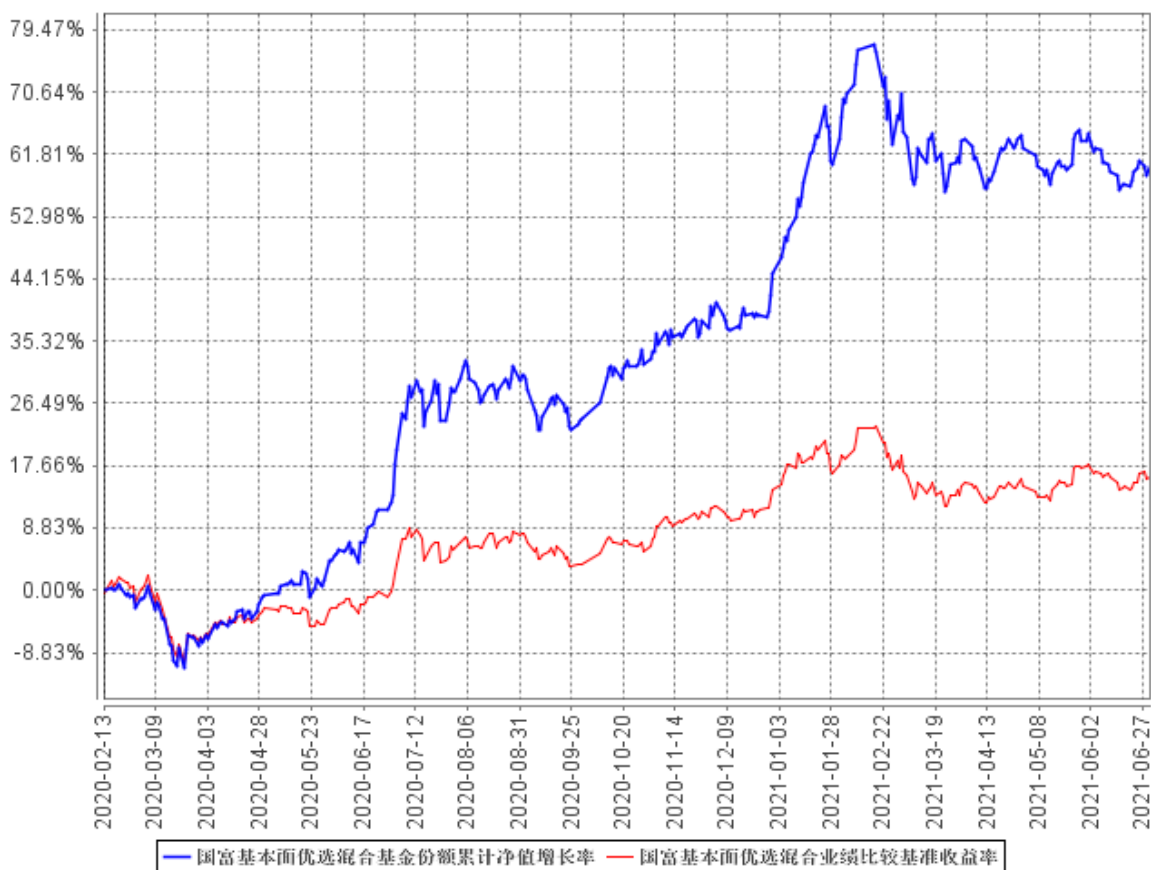
| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -2.10%   | 0.63%       | -1.23%     | 0.51%         | -0.87% | 0.12% |
| 过去三个月 | -0.27%   | 0.80%       | 2.26%      | 0.61%         | -2.53% | 0.19% |
| 过去六个月 | 10.64%   | 1.28%       | 1.75%      | 0.83%         | 8.89%  | 0.45% |
| 过去一年  | 42.51%   | 1.27%       | 16.40%     | 0.82%         | 26.11% | 0.45% |



|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 60.25% | 1.25% | 16.16% | 0.87% | 44.09% | 0.38% |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|

### 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

国富基本面优选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 2020 年 2 月 13 日。截止本报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国海富兰克林基金管理有限公司成立于 2004 年 11 月，由国海证券股份有限公司和富兰克林邓普顿投资集团全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建，国海证券股份有限公司持有 51% 的股份，邓普顿国际股份有限公司持有 49% 的股份。目前公司注册资本 2.2 亿元人民币。

国海证券股份有限公司是国内 A 股市场第 16 家上市券商，是拥有全业务牌照，营业网点遍布中国主要城市的全国性综合类证券公司。富兰克林邓普顿投资集团是世界知名基金管理公司，在全球市场具备超过 70 年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿投资集团享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系，借助国海证券股份有限公司的综合业务优势，力争成为国内一流的基金管理公司。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务  | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|---|-----------------|------|--------|--|
|     |   | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 赵晓东 | 公司权益投资总监、职工监事，国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金、国富弹性市值混合基金、国富恒瑞债券基金、国富基本面优选混合基金、 | 2020 年 2 月 13 日 | -    | 18 年   | 赵晓东先生，香港大学 MBA。历任淄博矿业集团项目经理，浙江证券分析员，上海交大高新技术股份有限公司高级投资经理，国海证券有限责任公司行业研究员，国海富兰克林基金管理有限公司研究员、高级研究员、国富弹性市值混合基金及国富潜力组合混合基金的基金经理助理、国富沪深 300 指数增强基金的基金经理、国海富兰克林基金管理有限公司 QDII 投资总监。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司权益投资总监、职工监事，国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金、国富弹 |

|  |                                 |  |  |   |
|--|---------------------------------|--|--|---|
|  | 国富兴海回报混合基金及国富竞争优势三年持有期混合基金的基金经理 |  |  | 性市值混合基金、国富恒瑞债券基金、国富基本面优选混合基金、国富兴海回报混合基金及国富竞争优势三年持有期混合基金的基金经理。 |
|--|---------------------------------|--|--|---|

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《富兰克林国海基本面优选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，经济继续维持复苏的状态，尤其出口继续超预期增长，消费仍在恢复中，房地产表现较好，流动性依然保持宽松。但海外受到疫情二次爆发的影响，继续保持超宽松的流动性，但海外的经济恢复依然强劲。通胀方面，国内通胀依然不高，但受到产业链影响，海外持续走高。

证券市场，投资者的风险偏好继续提升，新能源，半导体和医疗服务等行业大幅跑赢市场，地产和制造业等蓝筹走弱市场。上半年沪深 300 指数，中证 500 指数和创业板指数分别上涨 2.16%，8.6%和 19.88%，中小创股走势明显好于大盘指数。

上半年，本基金总体维持了较高的权益仓位，行业配置较为均衡，金融，制造业等配置相对较多，投资上进一步加强自下而上的选股。

### 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 1.6025 元，本报告期份额净值上涨 10.64%，同期业绩基准上涨 1.75%，跑赢业绩比较基准 8.89%。由于本基金在一季度锁定较多涨幅较高的个股收益，是报告期内领先业绩基准的主要原因。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，考虑到基数原因，预计国内经济下半年经济将回落到正常增长的区间。下半年虽然新冠疫情存在反复的可能，但国内和国际经济复苏的总态势依然强劲。预计下半年，国内货币政策依然保持相对宽裕状态，但企业的盈利可能受到大宗商品影响，增速有所回落。

下半年，预计资本市场可能出现波动，但从中长期投资的角度看，中国的资本市场依然具有很强的吸引力。

在投资策略上，我们始终坚持基本面投资的方向，坚持“安全边际”选股，在控制风险的前提下，重点持有和关注公司治理好、管理团队优秀、业务成长空间大、议价能力强、估值合理的公司。同时提高组合的均衡和分散，致力于在长期中带来超额的收益。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会（简称“估值委员会”），并已制订了《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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，招商银行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：富兰克林国海基本面优选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<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 360,892,550.01                 | 282,360,348.52                   |
| 结算备付金           |            | 11,656,635.49                  | 3,751,128.41                     |
| 存出保证金           |            | 640,713.28                     | 939,440.60                       |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 2,625,418,995.99               | 1,770,740,680.76                 |
| 其中：股票投资         |            | 2,464,173,742.59               | 1,769,666,680.76                 |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 161,245,253.40                 | 1,074,000.00                     |
| 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    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 41,429,528.95                  | 1,527,622.40                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 3,361,715.14                   | 35,870.95                        |
| 应收股利            |            | 13,830,205.41                  | 160,000.00                       |
| 应收申购款           |            | 1,717,238.21                   | 504,776.11                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 3,058,947,582.48               | 2,060,019,867.75                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>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         |            | 10,818,402.70                  | 30,328,148.46                    |
| 应付赎回款           |            | 61,562,044.68                  | 21,934,640.80                    |
| 应付管理人报酬         |            | 3,821,623.64                   | 2,502,175.49                     |
| 应付托管费           |            | 636,937.28                     | 417,029.27                       |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 1,139,988.54                   | 730,867.97                       |
| 应交税费            |            | 4.70                           | 2.82                             |

|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利息          |          | -                | -                |
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 268,148.25       | 297,963.10       |
| 负债合计          |          | 78,247,149.79    | 56,210,827.91    |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 1,859,995,574.28 | 1,383,428,845.52 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 1,120,704,858.41 | 620,380,194.32   |
| 所有者权益合计       |          | 2,980,700,432.69 | 2,003,809,039.84 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 3,058,947,582.48 | 2,060,019,867.75 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6025 元，基金份额总额 1,859,995,574.28 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海基本面优选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<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 2 月 13 日(基<br>金合同生效日)至<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |          | 232,069,606.94                           | 453,349,408.61  |
| 1.利息收入                |          | 2,336,963.60                             | 5,251,644.85  |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11 | 502,514.47                               | 1,904,713.41  |
| 债券利息收入                |          | 1,834,449.13                             | 18,466.64   |
| 资产支持证券利息收入            |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |          | -  | 3,328,464.80  |
| 其他利息收入                |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 282,527,849.92                           | 44,238,103.34   |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12 | 251,578,482.04                           | 18,883,489.79   |
| 基金投资收益                |          | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13 | 2,862,463.41                             | -   |
| 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 | 28,086,904.47                            | 25,354,613.55   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -54,885,235.50                           | 401,202,314.24  |
| 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 | 2,090,028.92                             | 2,657,346.18  |
| <b>减：二、费用</b>         |          | 29,718,799.93                            | 32,484,348.78   |



|                            |            |                |                |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 20,835,731.65  | 21,144,725.30  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 3,472,621.92   | 3,524,120.89   |
| 3. 销售服务费                   |            | -              | -              |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18   | 5,249,649.48   | 7,695,081.73   |
| 5. 利息支出                    |            | -              | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -              | -              |
| 6. 税金及附加                   |            | 17.93          | -              |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.19   | 160,778.95     | 120,420.86     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 202,350,807.01 | 420,865,059.83 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 202,350,807.01 | 420,865,059.83 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海基本面优选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<br>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）                        | 1,383,428,845.52                      | 620,380,194.32   | 2,003,809,039.84  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 202,350,807.01   | 202,350,807.01    |
| 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）      | 476,566,728.76                        | 297,973,857.08   | 774,540,585.84    |
| 其中：1.基金申购款                             | 1,139,663,880.12                      | 698,798,053.93   | 1,838,461,934.05  |
| 2.基金赎回款                                | -663,097,151.36                       | -400,824,196.85  | -1,063,921,348.21 |
| 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）                        | 1,859,995,574.28                      | 1,120,704,858.41 | 2,980,700,432.69  |



3,914,634,665.57 份基金份额，其中认购资金利息折合 126,687.35 份基金份额。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海基本面优选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(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“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、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他经中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、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、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(含存托凭证)投资比例为基金资产的 60%-95%，港股通标的股票最高投资比例不得超过股票资产的 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，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+恒生指数收益率×20%+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》、《富兰克林国海基本面优选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。

对基金通过沪港通或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。基金通过沪港通或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。基金通过沪港通或深港通买卖、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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 360,892,550.01         |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                      |
| 其他存款           | -                      |

|     |                |
|-----|----------------|
| 合计: | 360,892,550.01 |
|-----|----------------|

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021年6月30日 |                  |                |
|---------------|-------------------|------------------|----------------|
|               | 成本                | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            | 2,136,800,050.77  | 2,464,173,742.59 | 327,373,691.82 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场             | 1,074,000.00     | 1,105,253.40   |
|               | 银行间市场             | 160,076,050.00   | 160,140,000.00 |
|               | 合计                | 161,150,050.00   | 161,245,253.40 |
| 资产支持证券        | -                 | -                | -              |
| 基金            | -                 | -                | -              |
| 其他            | -                 | -                | -              |
| 合计            | 2,297,950,100.77  | 2,625,418,995.99 | 327,468,895.22 |

#### 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<br>2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 38,572.76         |
| 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  | 864.22            |
| 应收债券利息     | 3,322,093.05      |
| 应收买入返售证券利息 | -                 |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 185.11            |

|    |              |
|----|--------------|
| 合计 | 3,361,715.14 |
|----|--------------|

#### 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<br>2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,139,813.54      |
| 银行间市场应付交易费用 | 175.00            |
| 合计          | 1,139,988.54      |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 145,092.91        |
| 审计费用        | 54,547.97         |
| 信息披露费       | 59,507.37         |
| 债券账户维护费     | 9,000.00          |
| 合计          | 268,148.25        |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 1,383,428,845.52           | 1,383,428,845.52 |
| 本期申购          | 1,139,663,880.12           | 1,139,663,880.12 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -663,097,151.36            | -663,097,151.36  |
| 本期末           | 1,859,995,574.28           | 1,859,995,574.28 |

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           | 496,051,047.41  | 124,329,146.91 | 620,380,194.32   |
| 本期利润           | 257,236,042.51  | -54,885,235.50 | 202,350,807.01   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 208,369,955.94  | 89,603,901.14  | 297,973,857.08   |
| 其中：基金申购款       | 510,326,448.82  | 188,471,605.11 | 698,798,053.93   |
| 基金赎回款          | -301,956,492.88 | -98,867,703.97 | -400,824,196.85  |
| 本期已分配利润        | -               | -              | -                |
| 本期末            | 961,657,045.86  | 159,047,812.55 | 1,120,704,858.41 |

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 405,406.82                 |
| 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 | 85,335.21                  |
| 其他        | 11,772.44                  |
| 合计        | 502,514.47                 |

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 1,459,888,095.90           |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,208,309,613.86           |
| 买卖股票差价收入   | 251,578,482.04             |



**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<br>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 | 2,862,463.41               |
| 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                            | 2,862,463.41               |

**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<br>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   | 63,145,542.70              |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 60,249,321.57              |
| 减：应收利息总额                | 33,757.72                  |
| 买卖债券差价收入                | 2,862,463.41               |

**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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 28,086,904.47              |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 28,086,904.47              |

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -54,885,235.50                        |
| ——股票投资     | -54,980,438.90                        |
| ——债券投资     | 95,203.40                             |
| ——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         | -54,885,235.50                        |

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 2,005,928.09                          |
| 基金转换费收入 | 84,100.83                             |
| 合计      | 2,090,028.92                          |

注：

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

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 5,248,199.48                          |
| 银行间市场交易费用 | 1,450.00                              |
| 合计        | 5,249,649.48                          |

### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 54,547.97                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 债券账户维护费 | 18,000.00                  |
| 银行汇划费用  | 28,123.61                  |
| 其他手续费   | 600.00                     |
| 合计      | 160,778.95                 |

### 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

| 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 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人、基金销售机构          |
| 国海证券股份有限公司（“国海证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构       |

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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2020年2月13日(基金合同生效日)至<br>2020年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|---|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额  | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 国海证券  | 14,582,943.70              | 0.44%            | 2,691,608,022.89                              | 53.81%           |

### 6.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>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  | 11,666.35                                 | 0.46%      | -        | -            |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年2月13日(基金合同生效日)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  | 2,344,401.93                              | 55.88%     | -        | -            |

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 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<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2020年2月13日(基金合同生效日)<br>至2020年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---|
|                 | 当期发生的基金应支付的管理费                 | 20,835,731.65                                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 9,743,063.23                   | 14,375,439.53                                 |

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 X 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |        | 上年度可比期间<br>2020年2月13日(基金合同生效日)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 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,472,621.92               |        | 3,524,120.89                              |        |

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未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. 本报告期内和上年度可比期间（基金合同生效日 2020 年 2 月 13 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2020年2月13日(基金合同生效日)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       |
| 招商银行  | 360,892,550.01             | 405,406.82 | 412,531,150.44                            | 1,706,265.12 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

**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**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**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<br>(单位：股) | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
| 000338               | 潍柴动力 | 2021年5月27日 | 2021年12月1日  | 非公开发行的股份锁定 | 16.40 | 16.75  | 3,658,537    | 60,000,006.80 | 61,280,494.75 | -  |
| 600059               | 古越龙山 | 2021年4月28日 | 2021年10月26日 | 非公开发行的股份锁定 | 9.31  | 12.15  | 4,296,455    | 39,999,996.05 | 52,201,928.25 | -  |
| 000403               | 派林生物 | 2021年2月22日 | 2021年8月23日  | 非公开发行的股份锁定 | 33.33 | 30.23  | 300,030      | 9,999,999.90  | 9,069,906.90  | -  |
| 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   | 2021年6月    | 2022年1      | 新股锁定       | 8.86  | 8.86   | 555          | 4,917.30      | 4,917.30      | -  |

|        |      |                 |                  |       |       |        |         |              |              |   |
|--------|------|-----------------|------------------|-------|-------|--------|---------|--------------|--------------|---|
|        | 平民   | 23 日            | 月 5 日            |       |       |        |         |              |              |   |
| 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 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 | - |
| 688425 | 铁建重工 | 2021 年 6 月 11 日 | 2021 年 12 月 22 日 | 新股锁定  | 2.87  | 4.75   | 135,282 | 388,259.34   | 642,589.50   | - |
| 688131 | 皓元医药 | 2021 年 6 月 1 日  | 2021 年 12 月 8 日  | 新股锁定  | 64.99 | 247.10 | 1,955   | 127,055.45   | 483,080.50   | - |
| 688076 | 诺    | 2021            | 2021             | 新股    | 15.57 | 48.55  | 4,984   | 77,600.88    | 241,973.20   | - |

|        |      |                 |                  |      |       |        |       |           |            |   |
|--------|------|-----------------|------------------|------|-------|--------|-------|-----------|------------|---|
|        | 泰生物  | 年 5 月 12 日      | 年 11 月 22 日      | 锁定   |       |        |       |           |            |   |
| 300957 | 贝泰妮  | 2021 年 3 月 18 日 | 2021 年 9 月 27 日  | 新股锁定 | 47.33 | 251.96 | 853   | 40,372.49 | 214,921.88 | - |
| 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  | - |
| 688113 | 联测科技 | 2021 年 4 月 26 日 | 2021 年 11 月 8 日  | 新股锁定 | 19.14 | 49.29  | 1,415 | 27,083.10 | 69,745.35  | - |
| 688533 | 上声电子 | 2021 年 4 月 9 日  | 2021 年 10 月 19 日 | 新股锁定 | 7.72  | 19.11  | 3,493 | 26,965.96 | 66,751.23  | - |
| 688117 | 圣诺生物 | 2021 年 5 月 26 日 | 2021 年 12 月 3 日  | 新股锁定 | 17.90 | 35.97  | 1,672 | 29,928.80 | 60,141.84  | - |
| 688655 | 迅捷兴  | 2021 年 4 月 28 日 | 2021 年 11 月 11 日 | 新股锁定 | 7.59  | 15.77  | 3,083 | 23,399.97 | 48,618.91  | - |
| 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  | - |
| 688092 | 爱科科技 | 2021 年 3 月 12 日 | 2021 年 9 月 22 日  | 新股锁定 | 19.11 | 33.21  | 1,137 | 21,728.07 | 37,759.77  | - |
| 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    | 2021            | 2021             | 新股   | 21.31 | 49.94  | 399   | 8,502.69  | 19,926.06  | - |



|        |      |            |             |      |       |       |       |           |           |   |  |
|--------|------|------------|-------------|------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|--|
|        | 识科技  | 2021年2月2日  | 2021年8月9日   | 锁定   |       |       |       |           |           |   |  |
| 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    | 2021       | 2021        | 新股   | 16.53 | 46.07 | 232   | 3,834.96  | 10,688.24 | - |  |

|        |      |                 |                  |      |       |       |     |          |          |   |                   |
|--------|------|-----------------|------------------|------|-------|-------|-----|----------|----------|---|-------------------|
|        | 亨家化  | 年 3 月 16 日      | 年 9 月 24 日       | 锁定   |       |       |     |          |          |   |                   |
| 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 年 4 月      | 2021 年 11 月      | 新股锁定 | 6.79  | 26.81 | 301 | 2,043.79 | 8,069.81 | - |                   |

|        |      |                  |                  |      |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------------|------------------|------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
|        | 传媒   | 28 日             | 月 11 日           |      |       |       |     |          |          |   |
| 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 年 6 月       | 2021 年 12 月      | 新股锁定 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |

|        |      |                 |                  |      |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|-----------------|------------------|------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
|        | 科技   | 9 日             | 月 17 日           |      |       |       |     |          |          |   |
| 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。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。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招商银行，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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.04%（2020 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的固定收益品种占基金资产净值的比例为 0.05%）。

#### 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。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，本基金未持有流动性受限资产。

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<br>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              | 360,892,550.01 | -    | -            | -                | 360,892,550.01   |
| 结算备付金             | 11,656,635.49  | -    | -            | -                | 11,656,635.49    |
| 存出保证金             | 640,713.28     | -    | -            | -                | 640,713.28       |
| 交易性金融资产           | 160,140,000.00 | -    | 1,105,253.40 | 2,464,173,742.59 | 2,625,418,995.99 |
| 应收证券清算款           | -              | -    | -            | 41,429,528.95    | 41,429,528.95    |
| 应收利息              | -              | -    | -            | 3,361,715.14     | 3,361,715.14     |
| 应收股利              | -              | -    | -            | 13,830,205.41    | 13,830,205.41    |
| 应收申购款             | -              | -    | -            | 1,717,238.21     | 1,717,238.21     |
| 资产总计              | 533,329,898.78 | -    | 1,105,253.40 | 2,524,512,430.30 | 3,058,947,582.48 |
| 负债                |                |      |              |                  |                  |
| 应付证券清算款           | -              | -    | -            | 10,818,402.70    | 10,818,402.70    |



|                          |                |               |                  |                  |                  |
|--------------------------|----------------|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 应付赎回款                    | -              | -             | -                | 61,562,044.68    | 61,562,044.68    |
| 应付管理人报酬                  | -              | -             | -                | 3,821,623.64     | 3,821,623.64     |
| 应付托管费                    | -              | -             | -                | 636,937.28       | 636,937.28       |
| 应付交易费用                   | -              | -             | -                | 1,139,988.54     | 1,139,988.54     |
| 应交税费                     | -              | -             | -                | 4.70             | 4.70             |
| 其他负债                     | -              | -             | -                | 268,148.25       | 268,148.25       |
| 负债总计                     | -              | -             | -                | 78,247,149.79    | 78,247,149.79    |
| 利率敏感度缺口                  | 533,329,898.78 | -1,105,253.40 | 2,446,265,280.51 | 2,980,700,432.69 |                  |
| 上年度末<br>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                     | 282,360,348.52 | -             | -                | -                | 282,360,348.52   |
| 结算备付金                    | 3,751,128.41   | -             | -                | -                | 3,751,128.41     |
| 存出保证金                    | 939,440.60     | -             | -                | -                | 939,440.60       |
| 交易性金融资产                  | -              | -1,074,000.00 | 1,769,666,680.76 | -                | 1,770,740,680.76 |
| 应收证券清算款                  | -              | -             | -                | 1,527,622.40     | 1,527,622.40     |
| 应收利息                     | -              | -             | -                | 35,870.95        | 35,870.95        |
| 应收股利                     | -              | -             | -                | 160,000.00       | 160,000.00       |
| 应收申购款                    | -              | -             | -                | 504,776.11       | 504,776.11       |
| 资产总计                     | 287,050,917.53 | -1,074,000.00 | 1,771,894,950.22 | 2,060,019,867.75 |                  |
| 负债                       |                |               |                  |                  |                  |
| 应付证券清算款                  | -              | -             | -                | 30,328,148.46    | 30,328,148.46    |
| 应付赎回款                    | -              | -             | -                | 21,934,640.80    | 21,934,640.80    |
| 应付管理人报酬                  | -              | -             | -                | 2,502,175.49     | 2,502,175.49     |
| 应付托管费                    | -              | -             | -                | 417,029.27       | 417,029.27       |
| 应付交易费用                   | -              | -             | -                | 730,867.97       | 730,867.97       |
| 应交税费                     | -              | -             | -                | 2.82             | 2.82             |
| 其他负债                     | -              | -             | -                | 297,963.10       | 297,963.10       |
| 负债总计                     | -              | -             | -                | 56,210,827.91    | 56,210,827.91    |
| 利率敏感度缺口                  | 287,050,917.53 | -1,074,000.00 | 1,715,684,122.31 | 2,003,809,039.84 |                  |

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 5.41% (2020 年 12 月 31 日：0.05%)，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<br>2021年6月30日   |                  |                   |                  |
|-------------------|---------------------|------------------|-------------------|------------------|
|                   | 美元<br>折合人民<br>币     | 港币<br>折合人民币      | 其他币种<br>折合人民<br>币 | 合计               |
| 以外币计价的资产          |                     |                  |                   |                  |
| 交易性金融资产           | -                   | 1,215,314,896.54 | -                 | 1,215,314,896.54 |
| 应收股利              | -                   | 13,830,205.41    | -                 | 13,830,205.41    |
| 资产合计              | -                   | 1,229,145,101.95 | -                 | 1,229,145,101.95 |
| 以外币计价的负债          |                     |                  |                   |                  |
| 负债合计              | -                   | -                | -                 | -                |
| 资产负债表外汇风险敞口<br>净额 | -                   | 1,229,145,101.95 | -                 | 1,229,145,101.95 |
| 项目                | 上年度末<br>2020年12月31日 |                  |                   |                  |
|                   | 美元<br>折合人民币         | 港币<br>折合人民币      | 其他币种<br>折合人民币     | 合计               |
| 以外币计价的资产          |                     |                  |                   |                  |
| 交易性金融资产           | -                   | 868,107,457.07   | -                 | 868,107,457.07   |
| 应收股利              | -                   | 160,000.00       | -                 | 160,000.00       |
| 资产合计              | -                   | 868,267,457.07   | -                 | 868,267,457.07   |
| 以外币计价的负债          |                     |                  |                   |                  |
| 负债合计              | -                   | -                | -                 | -                |
| 资产负债表外汇风险敞口<br>净额 | -                   | 868,267,457.07   | -                 | 868,267,457.07   |

**6.4.13.4.2.2 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<br>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<br>升值 5% | 增加约 6,146                        | 增加约 4,341         |
|    | 所有外币相对人民币<br>贬值 5% | 减少约 6,146                        | 减少约 4,341         |

**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 60%-95%，港股投资比例不得超过股票资产的 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<br>2021 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 2,464,173,742.59       | 82.67                    | 1,769,666,680.76         | 88.32                 |
| 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            | 2,464,173,742.59       | 82.67                    | 1,769,666,680.76         | 88.32                 |

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                              |                        |
|----|----------------------|------------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动            | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元） |                        |
|    |                      | 本期末（2021 年 6 月 30 日）         | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|    | 1. 业绩比较基准上升 5%       | 增加约 10,215                   | 0.00                   |
|    | 2. 业绩比较基准下降 5%       | 减少约 10,215                   | 0.00                   |

## 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 2,334,956,471.42 元，属于第二层次的余额为 290,462,524.57 元，无属于第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：第一层次 1,763,177,240.76 元，第二层次 7,563,440.00 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（2020 年 12 月 31 日：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。



## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 2,464,173,742.59 | 80.56         |
|    | 其中：股票             | 2,464,173,742.59 | 80.56         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 161,245,253.40   | 5.27          |
|    | 其中：债券             | 161,245,253.40   | 5.27          |
|    | 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      | 372,549,185.50   | 12.18         |
| 8  | 其他各项资产            | 60,979,400.99    | 1.99          |
| 9  | 合计                | 3,058,947,582.48 | 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         | 26,856.80      | 0.00          |
| B  | 采矿业              | -              | -             |
| C  | 制造业              | 770,088,819.45 | 25.84         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,160,036.60   | 0.17          |
| E  | 建筑业              | 25,371.37      | 0.00          |
| F  | 批发和零售业           | 86,628.46      | 0.00          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 52,185,540.16  | 1.75          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 70,749,581.47  | 2.37          |
| J  | 金融业              | 303,402,626.87 | 10.18         |
| K  | 房地产业             | 29,770,753.82  | 1.00          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 15,994.06      | 0.00          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 17,310,364.66  | 0.58          |
| 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        | 1,248,858,846.05 | 41.90 |

注：鉴于部分行业分类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（%） |
|------|------------------|--------------|
| 可选消费 | 86,368,905.51    | 2.90         |
| 公用事业 | -                | -            |
| 电信服务 | 75,947,269.92    | 2.55         |
| 信息技术 | 482,124,775.46   | 16.17        |
| 金融   | 373,403,189.03   | 12.53        |
| 医疗保健 | 18,705,158.40    | 0.63         |
| 材料   | 39,460,561.92    | 1.32         |
| 工业   | 32,313,826.80    | 1.08         |
| 能源   | 776,031.09       | 0.03         |
| 日常消费 | 21,857,077.44    | 0.73         |
| 房地产  | 84,358,100.97    | 2.83         |
| 合计   | 1,215,314,896.54 | 40.77        |

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  | 00700 HK | 腾讯控股       | 398,000    | 193,402,018.56 | 6.49         |
| 2  | 601966   | 玲珑轮胎       | 4,215,772  | 184,397,867.28 | 6.19         |
| 3  | 601166   | 兴业银行       | 6,857,482  | 140,921,255.10 | 4.73         |
| 4  | 000338   | 潍柴动力       | 5,946,837  | 102,172,415.75 | 3.43         |
| 4  | 02338 HK | 潍柴动力       | 2,250,000  | 32,313,826.80  | 1.08         |
| 5  | 002142   | 宁波银行       | 3,092,129  | 120,500,267.13 | 4.04         |
| 6  | 01658 HK | 邮储银行       | 24,820,000 | 108,011,139.89 | 3.62         |
| 7  | 02382 HK | 舜宇光学科<br>技 | 513,200    | 104,791,556.10 | 3.52         |
| 8  | 01988 HK | 民生银行       | 29,685,000 | 91,885,096.66  | 3.08         |
| 8  | 600016   | 民生银行       | 2,700,000  | 11,907,000.00  | 0.40         |
| 9  | 00998 HK | 中信银行       | 31,150,000 | 95,382,994.56  | 3.20         |



|    |          |          |            |               |      |
|----|----------|----------|------------|---------------|------|
| 10 | 03888 HK | 金山软件     | 2,089,000  | 80,913,913.84 | 2.71 |
| 11 | 002304   | 洋河股份     | 389,900    | 80,787,280.00 | 2.71 |
| 12 | 00941 HK | 中国移动     | 1,880,000  | 75,947,269.92 | 2.55 |
| 13 | 600309   | 万华化学     | 681,400    | 74,149,948.00 | 2.49 |
| 14 | 688018   | 乐鑫科技     | 302,860    | 70,693,581.20 | 2.37 |
| 15 | 02400 HK | 心动公司     | 1,098,600  | 62,617,431.53 | 2.10 |
| 16 | 000403   | 派林生物     | 1,946,801  | 60,317,420.42 | 2.02 |
| 17 | 600059   | 古越龙山     | 4,299,313  | 52,238,967.93 | 1.75 |
| 18 | 002352   | 顺丰控股     | 770,702    | 52,176,525.40 | 1.75 |
| 19 | 06862 HK | 海底捞      | 1,500,000  | 51,048,108.00 | 1.71 |
| 20 | 600660   | 福耀玻璃     | 801,500    | 44,763,775.00 | 1.50 |
| 21 | 600438   | 通威股份     | 1,013,921  | 43,872,361.67 | 1.47 |
| 22 | 00981 HK | 中芯国际     | 2,031,500  | 40,399,855.43 | 1.36 |
| 23 | 02202 HK | 万科企业     | 1,987,600  | 40,188,365.65 | 1.35 |
| 24 | 03323 HK | 中国建材     | 5,200,000  | 39,460,561.92 | 1.32 |
| 25 | 00388 HK | 香港交易所    | 100,000    | 38,508,662.40 | 1.29 |
| 26 | 603899   | 晨光文具     | 454,715    | 38,450,700.40 | 1.29 |
| 27 | 601601   | 中国太保     | 1,038,112  | 30,074,104.64 | 1.01 |
| 27 | 02601 HK | 中国太保     | 380,000    | 7,730,855.28  | 0.26 |
| 28 | 03690 HK | 美团-W     | 120,000    | 31,991,811.84 | 1.07 |
| 29 | 06818 HK | 中国光大银行   | 12,088,000 | 31,884,440.24 | 1.07 |
| 30 | 01918 HK | 融创中国     | 1,280,000  | 28,383,912.96 | 0.95 |
| 31 | 688639   | 华恒生物     | 485,487    | 23,298,521.13 | 0.78 |
| 32 | 600298   | 安琪酵母     | 380,668    | 20,700,725.84 | 0.69 |
| 33 | 02319 HK | 蒙牛乳业     | 500,000    | 19,533,078.00 | 0.66 |
| 34 | 002415   | 海康威视     | 300,000    | 19,350,000.00 | 0.65 |
| 35 | 000002   | 万科A      | 800,000    | 19,048,000.00 | 0.64 |
| 36 | 01093 HK | 石药集团     | 2,000,000  | 18,705,158.40 | 0.63 |
| 37 | 300012   | 华测检测     | 527,832    | 16,827,284.16 | 0.56 |
| 38 | 01995 HK | 永升生活服务   | 984,000    | 15,785,822.36 | 0.53 |
| 39 | 002064   | 华峰化学     | 897,100    | 12,738,820.00 | 0.43 |
| 40 | 600823   | 世茂股份     | 2,651,648  | 10,712,657.92 | 0.36 |
| 41 | 002891   | 中宠股份     | 160,281    | 6,571,521.00  | 0.22 |
| 42 | 600905   | 三峡能源     | 907,763    | 5,147,016.21  | 0.17 |
| 43 | 00069 HK | 香格里拉(亚洲) | 426,000    | 2,693,942.21  | 0.09 |
| 44 | 01458 HK | 周黑鸭      | 300,000    | 2,323,999.44  | 0.08 |

|    |          |        |         |              |      |
|----|----------|--------|---------|--------------|------|
| 45 | 300957   | 贝泰妮    | 8,523   | 2,298,784.18 | 0.08 |
| 46 | 688008   | 澜起科技   | 14,500  | 904,510.00   | 0.03 |
| 47 | 02883 HK | 中海油田服务 | 134,000 | 776,031.09   | 0.03 |
| 48 | 300896   | 爱美客    | 851     | 671,336.88   | 0.02 |
| 49 | 688425   | 铁建重工   | 135,282 | 642,589.50   | 0.02 |
| 50 | 06110 HK | 滔搏     | 60,000  | 635,043.46   | 0.02 |
| 51 | 688131   | 皓元医药   | 1,955   | 483,080.50   | 0.02 |
| 52 | 688076   | 诺泰生物   | 4,984   | 241,973.20   | 0.01 |
| 53 | 300919   | 中伟股份   | 610     | 99,430.00    | 0.00 |
| 54 | 301004   | 嘉益股份   | 3,115   | 90,654.98    | 0.00 |
| 55 | 300979   | 华利集团   | 925     | 80,937.50    | 0.00 |
| 56 | 688113   | 联测科技   | 1,415   | 69,745.35    | 0.00 |
| 57 | 688533   | 上声电子   | 3,493   | 66,751.23    | 0.00 |
| 58 | 688117   | 圣诺生物   | 1,672   | 60,141.84    | 0.00 |
| 59 | 688087   | 英科再生   | 2,469   | 54,219.24    | 0.00 |
| 60 | 300910   | 瑞丰新材   | 474     | 49,556.70    | 0.00 |
| 61 | 301017   | 漱玉平民   | 5,550   | 49,173.00    | 0.00 |
| 62 | 688655   | 迅捷兴    | 3,083   | 48,618.91    | 0.00 |
| 63 | 301020   | 密封科技   | 4,210   | 44,794.40    | 0.00 |
| 64 | 300894   | 火星号    | 628     | 42,704.00    | 0.00 |
| 65 | 300973   | 立高食品   | 360     | 41,655.60    | 0.00 |
| 66 | 688092   | 爱科科技   | 1,137   | 37,759.77    | 0.00 |
| 67 | 605339   | 南侨食品   | 864     | 37,307.52    | 0.00 |
| 68 | 300900   | 广联航空   | 879     | 32,857.02    | 0.00 |
| 69 | 605089   | 味知香    | 370     | 32,197.40    | 0.00 |
| 70 | 301021   | 英诺激光   | 2,899   | 27,424.54    | 0.00 |
| 71 | 605296   | 神农集团   | 569     | 26,856.80    | 0.00 |
| 72 | 300953   | 震裕科技   | 240     | 23,964.00    | 0.00 |
| 73 | 605080   | 浙江自然   | 374     | 23,487.20    | 0.00 |
| 74 | 001207   | 联科科技   | 682     | 22,581.02    | 0.00 |
| 75 | 301009   | 可靠股份   | 801     | 22,339.89    | 0.00 |
| 76 | 300911   | 亿田智能   | 309     | 21,407.52    | 0.00 |
| 77 | 001206   | 依依股份   | 321     | 20,389.92    | 0.00 |
| 78 | 300941   | 创识科技   | 399     | 19,926.06    | 0.00 |
| 79 | 605305   | 中际联合   | 368     | 19,364.16    | 0.00 |
| 80 | 603511   | 爱慕股份   | 553     | 18,249.00    | 0.00 |
| 81 | 301015   | 百洋医药   | 462     | 17,939.46    | 0.00 |
| 82 | 688226   | 威腾电气   | 2,693   | 17,289.06    | 0.00 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 83  | 300908 | 仲景食品 | 285   | 16,983.15 | 0.00 |
| 84  | 300909 | 汇创达  | 386   | 16,636.60 | 0.00 |
| 85  | 300913 | 兆龙互连 | 630   | 16,506.00 | 0.00 |
| 86  | 605300 | 佳禾食品 | 576   | 16,012.80 | 0.00 |
| 87  | 603836 | 海程邦达 | 733   | 15,994.06 | 0.00 |
| 88  | 300925 | 法本信息 | 600   | 15,774.00 | 0.00 |
| 89  | 300932 | 三友联众 | 492   | 15,601.32 | 0.00 |
| 90  | 300982 | 苏文电能 | 317   | 14,356.93 | 0.00 |
| 91  | 605180 | 华生科技 | 384   | 14,208.00 | 0.00 |
| 92  | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 93  | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 94  | 300940 | 南极光  | 307   | 13,317.66 | 0.00 |
| 95  | 300614 | 百川畅银 | 329   | 13,285.02 | 0.00 |
| 96  | 300937 | 药易购  | 244   | 13,105.24 | 0.00 |
| 97  | 300942 | 易瑞生物 | 443   | 12,634.36 | 0.00 |
| 98  | 603171 | 税友股份 | 637   | 12,230.40 | 0.00 |
| 99  | 003036 | 泰坦股份 | 776   | 11,958.16 | 0.00 |
| 100 | 300933 | 中辰股份 | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |
| 101 | 301002 | 崧盛股份 | 201   | 11,581.62 | 0.00 |
| 102 | 300918 | 南山智尚 | 1,063 | 11,065.83 | 0.00 |
| 103 | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 104 | 300955 | 嘉亨家化 | 232   | 10,688.24 | 0.00 |
| 105 | 605259 | 绿田机械 | 295   | 10,516.75 | 0.00 |
| 106 | 605005 | 合兴股份 | 634   | 10,321.52 | 0.00 |
| 107 | 605189 | 富春染织 | 423   | 10,190.07 | 0.00 |
| 108 | 300917 | 特发服务 | 365   | 10,095.90 | 0.00 |
| 109 | 300922 | 天秦装备 | 287   | 9,996.21  | 0.00 |
| 110 | 300956 | 英力股份 | 371   | 9,571.80  | 0.00 |
| 111 | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 112 | 301016 | 雷尔伟  | 275   | 9,069.50  | 0.00 |
| 113 | 300966 | 共同药业 | 286   | 9,020.44  | 0.00 |
| 114 | 001202 | 炬申股份 | 459   | 9,014.76  | 0.00 |
| 115 | 300948 | 冠中生态 | 324   | 8,884.08  | 0.00 |
| 116 | 300931 | 通用电梯 | 672   | 8,809.92  | 0.00 |
| 117 | 300961 | 深水海纳 | 394   | 8,695.58  | 0.00 |
| 118 | 300950 | 德固特  | 219   | 8,569.47  | 0.00 |
| 119 | 605162 | 新中港  | 1,377 | 8,358.39  | 0.00 |
| 120 | 300986 | 志特新材 | 264   | 8,070.48  | 0.00 |
| 121 | 300987 | 川网传媒 | 301   | 8,069.81  | 0.00 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 122 | 300978 | 东箭科技 | 593 | 8,064.80 | 0.00 |
| 123 | 300926 | 博俊科技 | 359 | 7,969.80 | 0.00 |
| 124 | 300993 | 玉马遮阳 | 410 | 7,908.90 | 0.00 |
| 125 | 300930 | 屹通新材 | 322 | 7,882.56 | 0.00 |
| 126 | 300985 | 致远新能 | 295 | 7,318.95 | 0.00 |
| 127 | 300971 | 博亚精工 | 245 | 6,931.05 | 0.00 |
| 128 | 300991 | 创益通  | 254 | 6,733.54 | 0.00 |
| 129 | 300975 | 商络电子 | 492 | 6,410.76 | 0.00 |
| 130 | 300963 | 中洲特材 | 283 | 6,364.67 | 0.00 |
| 131 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 132 | 300943 | 春晖智控 | 255 | 5,867.55 | 0.00 |
| 133 | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 134 | 300960 | 通业科技 | 234 | 5,396.04 | 0.00 |
| 135 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 136 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 137 | 301007 | 德迈仕  | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 138 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 139 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 140 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 141 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 0.00 |
| 142 | 600196 | 复星医药 | 28  | 2,019.64 | 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  | 000651   | 格力电器 | 146,266,219.15 | 7.30           |
| 2  | 000338   | 潍柴动力 | 97,075,484.44  | 4.84           |
| 3  | 601166   | 兴业银行 | 80,070,238.00  | 4.00           |
| 4  | 600309   | 万华化学 | 74,662,004.40  | 3.73           |
| 5  | 01988 HK | 民生银行 | 74,089,445.01  | 3.70           |
| 6  | 00941 HK | 中国移动 | 71,575,192.46  | 3.57           |
| 7  | 600059   | 古越龙山 | 62,776,299.94  | 3.13           |
| 8  | 03690 HK | 美团-W | 58,084,061.62  | 2.90           |

|    |          |         |               |      |
|----|----------|---------|---------------|------|
| 9  | 06862 HK | 海底捞     | 56,986,029.72 | 2.84 |
| 10 | 002304   | 洋河股份    | 52,030,512.00 | 2.60 |
| 11 | 601966   | 玲珑轮胎    | 50,886,156.85 | 2.54 |
| 12 | 02400 HK | 心动公司    | 50,865,721.59 | 2.54 |
| 13 | 00700 HK | 腾讯控股    | 50,847,622.05 | 2.54 |
| 14 | 002001   | 新和成     | 47,036,419.08 | 2.35 |
| 15 | 06185 HK | 康希诺生物-B | 45,365,502.36 | 2.26 |
| 16 | 03323 HK | 中国建材    | 44,023,882.32 | 2.20 |
| 17 | 688018   | 乐鑫科技    | 42,828,338.46 | 2.14 |
| 18 | 600438   | 通威股份    | 42,269,420.20 | 2.11 |
| 19 | 00388 HK | 香港交易所   | 42,012,721.58 | 2.10 |
| 20 | 600660   | 福耀玻璃    | 41,986,916.74 | 2.10 |
| 21 | 601601   | 中国太保    | 41,315,052.68 | 2.06 |

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  | 000651   | 格力电器    | 167,560,834.38 | 8.36           |
| 2  | 002304   | 洋河股份    | 99,361,928.02  | 4.96           |
| 3  | 002044   | 美年健康    | 90,086,306.96  | 4.50           |
| 4  | 00939 HK | 建设银行    | 77,375,639.95  | 3.86           |
| 5  | 601318   | 中国平安    | 75,454,094.20  | 3.77           |
| 6  | 603833   | 欧派家居    | 70,091,741.58  | 3.50           |
| 7  | 06969 HK | 思摩尔国际   | 56,117,719.41  | 2.80           |
| 8  | 02382 HK | 舜宇光学科技  | 53,440,529.37  | 2.67           |
| 9  | 601966   | 玲珑轮胎    | 52,275,403.36  | 2.61           |
| 10 | 00853 HK | 微创医疗    | 51,284,248.05  | 2.56           |
| 11 | 00883 HK | 中国海洋石油  | 45,873,716.28  | 2.29           |
| 12 | 06185 HK | 康希诺生物-B | 45,824,630.42  | 2.29           |
| 13 | 002001   | 新和成     | 45,478,513.40  | 2.27           |
| 14 | 601166   | 兴业银行    | 44,521,951.81  | 2.22           |
| 15 | 01398 HK | 工商银行    | 44,404,972.29  | 2.22           |
| 16 | 01765 HK | 希望教育    | 43,457,219.23  | 2.17           |
| 17 | 000932   | 华菱钢铁    | 43,192,637.80  | 2.16           |
| 18 | 00762 HK | 中国联通    | 40,272,405.94  | 2.01           |

|    |          |      |               |      |
|----|----------|------|---------------|------|
| 19 | 600196   | 复星医药 | 37,929,550.00 | 1.89 |
| 20 | 06049 HK | 保利物业 | 32,031,476.09 | 1.60 |

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 | 1,957,797,114.59 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,459,888,095.90 |

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      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 160,140,000.00 | 5.37         |
|    | 其中：政策性金融债 | 160,140,000.00 | 5.37         |
| 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） | 1,105,253.40   | 0.04         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 161,245,253.40 | 5.41         |

### 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  | 200309 | 20 进出 09 | 1,000,000 | 100,040,000.00 | 3.36         |
| 2  | 200216 | 20 国开 16 | 300,000   | 30,051,000.00  | 1.01         |
| 3  | 210201 | 21 国开 01 | 200,000   | 20,012,000.00  | 0.67         |
| 4  | 190202 | 19 国开 02 | 100,000   | 10,037,000.00  | 0.34         |
| 5  | 113044 | 大秦转债     | 10,740    | 1,105,253.40   | 0.04         |

### 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：

中国邮政储蓄银行股份有限公司湖北省分行于 2021 年 2 月 25 日受到湖北证监局采取责令改正措施的决定，主要违规行为如下：客户现场开户时未进行录音录像、部分宣传推介材料风险提示不到位、部分基金销售人员在取得资格前开展基金销售活动、代理网点员工预测基金的证券投资业绩、基金销售业务负责人无基金从业资格；鉴于上述违规事实及情节，根据《证券期货投资者适当性管理办法》第三十七条、《证券投资基金销售管理办法》第八十七条、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（证监会令第 175 号）第五十三条的规定，湖北证监局决定对邮储银行湖北省分行采取责令限期改正的行政监管措施。邮储银行湖北分行应在本监管措施下发之日

起 60 日内完成整改，并向湖北证监局报送书面整改报告。

本基金对邮储银行投资决策说明：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邮储银行长期发展，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   | 640,713.28    |
| 2  | 应收证券清算款 | 41,429,528.95 |
| 3  | 应收股利    | 13,830,205.41 |
| 4  | 应收利息    | 3,361,715.14  |
| 5  | 应收申购款   | 1,717,238.21  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 60,979,400.99 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 113044 | 大秦转债 | 1,105,253.40 | 0.04         |

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值   | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明   |
|----|--------|------|---------------|--------------|------------|
| 1  | 000338 | 潍柴动力 | 61,280,494.75 | 2.06         | 非公开发行的股份锁定 |



## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 61,654       | 30,168.29     | 668,821,850.49 | 35.96%     | 1,191,173,723.79 | 64.04%     |

### 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<br>持有本基金 | 734,751.52 | 0.039503% |

### 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<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0                  |
| 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（2020年2月13日）基金份额总额 | 3,914,634,665.57 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 1,383,428,845.52 |
| 本报告期基金总申购份额               | 1,139,663,880.12 |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 663,097,151.36   |
| 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               | 1,859,995,574.28 |

## § 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

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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 |    |
| 东方证券  | 1      | 1,519,997,265.78 | 46.13%       | 1,176,473.92 | 46.83%     | -  |
| 浙商证券  | 1      | 892,984,405.04   | 27.10%       | 664,894.44   | 26.46%     | -  |
| 华创证券  | 1      | 425,514,187.02   | 12.92%       | 319,723.42   | 12.73%     | -  |
| 长江证券  | 1      | 231,739,455.43   | 7.03%        | 174,577.61   | 6.95%      | -  |
| 太平洋证券 | 1      | 209,901,719.39   | 6.37%        | 165,077.20   | 6.57%      | -  |

|      |   |               |       |           |       |   |
|------|---|---------------|-------|-----------|-------|---|
| 国海证券 | 2 | 14,582,943.70 | 0.44% | 11,666.35 | 0.46% | - |
| 东北证券 | 1 | -             | -     | -         | -     | - |

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 债券交易          |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|-------|---------------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|       | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 浙商证券  | 60,278,812.17 | 48.84%       | -      | -              | -    | -            |
| 华创证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长江证券  | 20,379,901.48 | 16.51%       | -      | -              | -    | -            |
| 太平洋证券 | 42,765,641.22 | 34.65%       | -      | -              | -    | -            |
| 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  | 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1月21日 |
| 2  | 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 |
| 3  | 富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金（QDII）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 |
| 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  | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加海通证券股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2021年3月4日  |
| 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 | 富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金 (QDII) 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 | 富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金 (QDII) 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 4 月 30 日 |
| 15 | 关于增加北京度小满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 17 日 |
| 16 | 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 |
| 17 | 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 |

|    |   |                |                 |
|----|---|----------------|-----------------|
| 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 | 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 |
| 20 | 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 |
| 21 | 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 5 月 29 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 | 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 |
| 24 | 富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金（QDII）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 影响投资者决策的其他重要信息

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

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海基本面优选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海基本面优选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