

富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）
2022 年中期报告

2022 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46

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	46
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末上市基金前十名持有人	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.4 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情况	49
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
11.1 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）
基金简称	国富中证 100 指数增强（LOF）
场内简称	国富中证 100LOF
基金主代码	164508
交易代码	164508
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2015 年 3 月 26 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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,482,811.80 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 4 月 22 日

注：根据《富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金基金合同》和《关于富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金 5 年分级运作期届满与基金份额转换的公告》，本基金基金合同生效后 5 年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），本基金转型日为 2020 年 3 月 26 日，自 2020 年 3 月 27 日（基金转型后首个运作日）起基金名称变更为“富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金。通过量化风险管理方法，控制基金投资组合与标的指数构成的偏差，同时采取适当的增强策略，在严格控制跟踪误差风险的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期增值。在正常市场情况下，本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金基于被动复制的指数化投资方法，在严格控制跟踪误差风险的基础上，适度运用资产配置调整、行业配置调整、指数成份股权重优化等主动增强策略，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。在资产配置上，本基金采取指数增强策略。为控制基金的跟踪误差风险，本基金的资产配置将保持与业绩比较基准基本一致，只在股票、债券（主要是国债）、现金等各大类资产间进行小幅度的主动调整，追求适度超越业绩比较基准的收益目标。在股票投资上，为严格控制跟踪误差风险，本基金的股票投资以被动复制跟踪标的指数为主，辅以适度的增强策略。在债券投资上，本基金债券投资的主要目的是在保证基金资产流动性的前提下，提高基金资产的投资收益。

	本基金也可进行股指期货投资。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率*95%+银行同业存款利率*5%
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于较高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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	储丽莉	许俊
	联系电话	021-3855 5555	010-66596688
	电子邮箱	service@ftsfund.com	fcib@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555	95566
传真		021-6888 3050	010-66594942
注册地址		广西南宁市西乡塘区总部路 1 号中国-东盟科技企业孵化基地一期 A-13 栋三层 306 号房	北京市西城区复兴门内大街 1 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 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		吴显玲	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-800,646.79
本期利润	-2,082,518.20
加权平均基金份额本期利润	-0.0942
本期加权平均净值利润率	-7.69%
本期基金份额净值增长率	-7.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	8,996,130.89
期末可供分配基金份额利润	0.4001
期末基金资产净值	28,630,794.69
期末基金份额净值	1.273
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	23.00%

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一第 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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

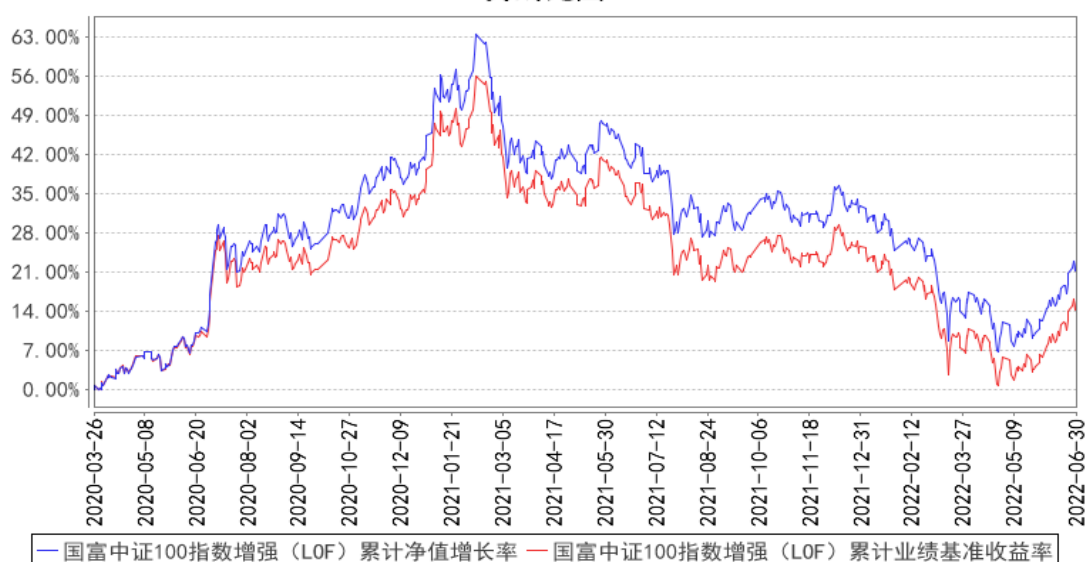
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.36%	1.05%	9.18%	1.04%	0.18%	0.01%
过去三个月	6.53%	1.30%	6.33%	1.32%	0.20%	-0.02%

过去六个月	-7.28%	1.36%	-7.62%	1.38%	0.34%	-0.02%
过去一年	-13.69%	1.21%	-14.55%	1.23%	0.86%	-0.02%
自基金合同生效起至今	23.00%	1.22%	15.92%	1.21%	7.08%	0.01%

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

国富中证100指数增强（LOF）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：本基金已在转换基准日 2020 年 3 月 26 日日终转换为上市开放式基金（LOF）。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 75 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 2022 年 6 月末，公司旗下合计管理 40 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		
张志强	公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、职工监事，国富沪深 300 指数增强基金及国富中证 100 指数增强（LOF）基金的基金经理	2015 年 3 月 26 日	-	19 年	张志强先生，CFA，纽约州立大学（布法罗）计算机科学硕士，中国科学技术大学数学专业硕士。历任美国 Enreach Technology Inc. 软件工程师，海通证券股份有限公司研究所高级研究员，友邦华泰基金管理有限公司高级数量分析师，国海富兰克林基金管理有限公司首席数量分析师、风险控制部总经理、业务发展部总经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、职工监事，国富沪深 300 指数增强基金及国富中证 100 指数增强（LOF）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《富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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

2022 年上半年，A 股市场大幅震荡。风格方面，年初至 4 月底是下跌阶段，大盘股下跌幅度相对较小；在其后的反弹阶段，中小成长风格涨幅领先。行业方面，煤炭行业逆势取得超 30% 收益，其它表现相对较好的行业有交通运输、建筑装饰、美容护理、有色金属、房地产、银行、白酒等，而电子、计算机、传媒、国防军工、证券、环保、机械设备等行业跌幅较大。上半年，中证 100 指数下跌了 8.07%。

报告期内，本基金在保持均衡的组合配置以控制主动投资风险的前提下，继续使用量化选股模型精选个股及构建投资组合，但上半年模型表现一般，表现与业绩比较基准持平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日, 本基金份额净值为 1.273 元。报告期内份额净值下跌 7.28%, 同期业绩比较基准下跌 7.62%, 跑赢业绩比较基准 0.34%, 期间基金年化跟踪误差为 1.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年, 受国内多地疫情爆发、俄乌冲突加剧等因素影响, 经济景气下行, 四月份 PMI 值 47.4, 创下了 2020 年 3 月以来的新低。3 月 29 日, 国务院常务会议指出, “统筹稳增长、调结构、推改革, 稳定经济的政策早出快出”。随着稳增长政策的落实和各地复工复产的推进, 五月份以来, 经济呈现复苏态势。流动性方面, 资金面总体宽松, 但 A 股市场受行情的影响, 经历了明显的资金流出流入。至半年度末, A 股出现资金持续流入、交易热度上升的局面。

展望下半年, 预计国内经济将延续目前的复苏态势, 像上半年那种对经济很悲观的担忧应该不会出现。但以美国为首的发达市场目前正处于加息周期, 给全球经济和金融市场带来较大的不确定性, 可能对国内经济和市场会有一些影响。流动性方面, 作为稳定经济的一个重要环节, 资金面预计将继续保持充裕, 但不会再出现过松的局面。A 股市场经过 5、6 两个月的快速反弹, 已基本扭转了前期的悲观情绪。预计未来一段时期, 市场将在成长性行业、消费复苏相关行业、稳增长受益板块中寻找确定性较高的上市公司。

投资策略方面, 下半年仍将保持均衡配置, 控制主动投资风险。同时, 力争通过选股和其它有效策略获取超额收益。

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投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况, 应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突, 一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末, 根据基金合同和相关法律法规的规定, 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

报告期内, 本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元, 根据《公开募集证券投资

基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。本报告期内本基金管理人积极开展持续营销，努力落实解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，如实描述违法违规或损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	2,308,910.46	2,158,155.72
结算备付金		10,359.67	7,146.59
存出保证金		1,897.00	532.22
交易性金融资产	6.4.7.2	26,620,294.79	27,582,401.49
其中：股票投资		26,620,294.79	27,582,401.49
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	33,349.07
应收股利		-	-
应收申购款		12,612.13	15,497.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	214.98
资产总计		28,954,074.05	29,797,298.01
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		-	-
应付赎回款		14,372.84	59,553.28
应付管理人报酬		18,970.38	21,524.47
应付托管费		3,347.69	3,798.44
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	286,588.45	249,115.80
负债合计		323,279.36	333,991.99
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	19,634,663.80	18,744,231.28
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	8,996,130.89	10,719,074.74
净资产合计		28,630,794.69	29,463,306.02
负债和净资产总计		28,954,074.05	29,797,298.01

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.273 元，基金份额总额 22,482,811.80 份。

6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,827,345.77	-264,449.70
1. 利息收入		4,415.36	5,239.92
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,415.36	5,230.90
债券利息收入		-	9.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-551,281.28	3,420,034.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-807,522.57	3,143,898.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	12,024.96	22,339.75
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	244,216.33	253,795.88
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-1,281,871.41	-3,700,844.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,391.56	11,120.78
减：二、营业总支出		255,172.43	408,951.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	114,356.12	157,626.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	20,180.52	27,816.39
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.17	120,635.79	223,509.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,082,518.20	-673,401.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,082,518.20	-673,401.25
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,082,518.20	-673,401.25

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	18,744,231.28	-	10,719,074.74	29,463,306.02
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	18,744,231.28	-	10,719,074.74	29,463,306.02
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	890,432.52	-	-1,722,943.85	-832,511.33
(一)、综合收益总额	-	-	-2,082,518.20	-2,082,518.20
(二)、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)	890,432.52	-	359,574.35	1,250,006.87
其中: 1. 基金申购款	2,025,046.29	-	820,517.65	2,845,563.94
2. 基金赎回款	-1,134,613.77	-	-460,943.30	-1,595,557.07
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	19,634,663.80	-	8,996,130.89	28,630,794.69
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	23,273,254.22	-	16,814,675.08	40,087,929.30
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	23,273,254.22	-	16,814,675.08	40,087,929.30
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-3,019,507.07	-	-2,866,495.54	-5,886,002.61
(一)、综合收益总额	-	-	-673,401.25	-673,401.25
(二)、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)	-3,019,507.07	-	-2,193,094.29	-5,212,601.36

其中：1. 基金申购款	4,228,590.49	-	3,227,991.06	7,456,581.55
2. 基金赎回款	-7,248,097.56	-	-5,421,085.35	-12,669,182.91
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	20,253,747.15	-	13,948,179.54	34,201,926.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

徐荔蓉

于意

肖燕

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金(以下简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]第 426 号《关于核准富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金募集的批复》核准,由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 675,295,672.74 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 231 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 3 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 675,455,568.42 份基金份额,其中认购资金利息折合 159,895.68 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金基金合同》和《富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金的基金份额包括确认为富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金之基础份额(以下简称“国富中证 100 份额”),富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“国富中证 100A 份额”)及富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金之积极收益类份额(以

下简称“国富中证 100B 份额”)。其中, 国富中证 100A 份额、国富中证 100B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。本基金净资产优先确保国富中证 100A 份额的本金及国富中证 100A 份额累计约定日应得收益, 即国富中证 100A 份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额; 本基金在优先确保国富中证 100A 份额的本金及累计约定日应得收益后的剩余净资产计为国富中证 100B 份额的净资产, 即国富中证 100B 份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额。基金发售结束后, 场外认购的全部份额将确认为国富中证 100 份额; 场内认购的全部份额将按 1:1 的比例确认为国富中证 100A 份额与国富中证 100B 份额。本基金基金合同生效后, 国富中证 100 份额与国富中证 100A 份额、国富中证 100B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换, 包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。基金份额的分拆, 指基金份额持有人将其持有的国富中证 100 份额按照 2 份场内国富中证 100 份额对应 1 份国富中证 100A 份额与 1 份国富中证 100B 份额的比例进行转换的行为; 基金份额的合并, 指基金份额持有人将其持有的国富中证 100A 份额与国富中证 100B 份额按照国富中证 100A 份额与 1 份国富中证 100B 份额对应 2 份场内国富中证 100 份额的比例进行转换的行为。

合同生效后, 国富中证 100 份额可办理场外与场内申购和赎回, 但不上市交易; 国富中证 100A 份额、国富中证 100B 份额只上市交易, 不可单独申购和赎回。本基金的分级运作期为五年(含五年), 分级运作期满后, 满足基金合同约定的存续条件, 本基金无需召开基金份额持有人大会, 国富中证 100A 份额和国富中证 100B 份额以各自的份额净值为基础, 按照国富中证 100 份额的份额净值自动转换为上市开放式基金(LOF), 基金名称为“富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)”。本基金转为上市开放式基金(LOF)后, 投资者可通过场内、场外进行基金份额的申购、赎回。

本基金在存续期内的每个会计年度(基金合同生效日所在会计年度除外)第一个工作日对登记在册的国富中证 100 份额、国富中证 100A 份额进行基金的定期份额折算。国富中证 100A 份额和国富中证 100B 份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算, 对国富中证 100A 份额的应得收益进行定期份额折算, 每 2 份国富中证 100 份额将按 1 份国富中证 100A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后, 国富中证 100A 份额和国富中证 100B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于国富中证 100A 份额的约定年化应得收益, 即国富中证 100A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额净值超过 1.000 元的部分, 将折算为场内国富中证 100 份额分配给国富中证 100A 份额持有人。当国富中证 100 份额的基金份额净值达到 2.000 元或国富中证 100B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元时, 本基金即可确定折算基准日, 进行不定期份额折算。在折算基准日, 本基金将对登记在册的国富中证 100 份额、国富中证 100A 份额和国富

中证 100 B 份额分别进行折算。份额折算后本基金将确保国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额的比例为 1:1；份额折算后国富中证 100 份额的基金份额净值、国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额的参考净值均调整为 1.000 元。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]第 122 号文审核同意,投资者场内认购的全部国富中证 100 份额按 1:1 比例自动分拆成的国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额于 2015 年 4 月 10 日在深圳证券交易所上市。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金作为指数型基金,采用被动复制策略,跟踪标的指数市场表现,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如果法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产净值的比例为 90%-95%,其中投资于股票资产的比例不低于基金资产净值的 90%,投资于中证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产净值的 80%;债券、现金以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-10%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金投资组合的业绩比较基准为中证 100 指数收益率 $\times$ 95%+银行同业存款利率 $\times$ 5%。

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 2022 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》、《富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产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估计与最近一期年度报告相一致，所采用的会计政策发生变更。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

1. 新金融工具准则 (2022 年 1 月 1 日起适用的新金融工具准则)

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具 (主要为股票投资) 按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表

中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

2. 原金融工具准则 (截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则, 但选择不重述比较信息。因此, 比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

1. 新金融工具准则 (2022 年 1 月 1 日起适用的新金融工具准则)

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债, 相关交易费用计入当期损益; 对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息, 确认为应计利息, 包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债, 相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

2. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

1. 新金融工具准则(2022 年 1 月 1 日起适用的新金融工具准则)

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

2. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下

由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 2,158,155.72 元、7,146.59 元、532.22 元、214.98 元、33,349.07 元和 15,497.94 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 2,158,367.20 元、7,149.79 元、532.52 元、0.00 元、33,349.07 元和 15,497.94 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 27,582,401.49 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 27,582,401.49 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 59,553.28 元、21,524.47 元、3,798.44 元、8,905.96 元和 150,209.84 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 59,553.28 元、21,524.47 元、3,798.44 元、8,905.96 元和 150,209.84 元。

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额(若有)均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日, 本基金根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示, 无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》, 本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露, 这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品

管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	2,308,910.46
等于: 本金	2,308,727.35
加: 应计利息	183.11
减: 坏账准备	-
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,308,910.46

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	25,594,730.22	-	26,620,294.79	1,025,564.57
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	25,594,730.22	-	26,620,294.79	1,025,564.57

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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	46.79
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	16,705.87
其中：交易所市场	16,705.87
银行间市场	-
应付利息	-
审计费用	19,835.79
指数使用费	250,000.00

合计	286,588.45
----	------------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,463,165.80	18,744,231.28
本期申购	2,318,813.23	2,025,046.29
本期赎回（以“-”号填列）	-1,299,167.23	-1,134,613.77
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	22,482,811.80	19,634,663.80

注：2022 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 3,290,270.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 19,192,541.80 份。

6.4.7.8 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
本期期初	15,684,798.55	-4,965,723.81	10,719,074.74
本期利润	-800,646.79	-1,281,871.41	-2,082,518.20
本期基金份额交易产生的变动数	749,935.13	-390,360.78	359,574.35
其中：基金申购款	1,691,707.33	-871,189.68	820,517.65
基金赎回款	-941,772.20	480,828.90	-460,943.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,634,086.89	-6,637,956.00	8,996,130.89

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入		4,278.96
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		118.39
其他		18.01
合计		4,415.36

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-807,522.57
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-807,522.57

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	13,712,159.07
减：卖出股票成本总额	14,477,106.22
减：交易费用	42,575.42
买卖股票差价收入	-807,522.57

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	16.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	12,007.98
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	12,024.96

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	41,025.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	29,000.00
减：应计利息总额	16.98
减：交易费用	0.04
买卖债券差价收入	12,007.98

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	244,216.33
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	244,216.33

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,281,871.41
股票投资	-1,281,871.41
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,281,871.41

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,391.56
合计	1,391.56

注：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。

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	-
证券出借违约金	-

银行费用	800.00
指数使用费	100,000.00
合计	120,635.79

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.16% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000.00 元。

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
国海证券	3,784,557.00	13.30	-	-

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	114,356.12	157,626.05
其中：支付销售机构的客户维护费	35,761.24	48,817.33

注：支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.85% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.85% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	20,180.52	27,816.39

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期内未开展转融通业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

- 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。
- 本报告期和上年度可比期间(2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日)基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

- 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。
- 本报告期末和上年度末(2021 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。

6.4.10.6 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	2,308,910.46	4,278.96	3,011,035.07	5,056.71

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 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(2022 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未开展转融通业务。

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

本基金是股票指数增强型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于较高风险收益特征的证券投资基金。本基金投资范围限于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、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他证券品种，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金采用指数增强投资策略。通过量化风险管理方法，控制基金投资组合与标的指数构成的偏差，同时结合主动投资方法，在严格控制跟踪偏离风险的

基础上，力争获得超越业绩比较基准标的投资收益，追求基金资产的长期增值。

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及绩效评估。

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，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。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，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，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 2022 年 6 月 30 日本基金无固定收益品种投资（2021 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 2022 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(净资产)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公司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 2022 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 2022 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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	2,308,910.46	-	-	-	2,308,910.46
结算备付金	10,359.67	-	-	-	10,359.67
存出保证金	1,897.00	-	-	-	1,897.00
交易性金融资产	-	-	-	26,620,294.79	26,620,294.79
应收申购款	-	-	-	12,612.13	12,612.13
资产总计	2,321,167.13	-	-	26,632,906.92	28,954,074.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,372.84	14,372.84
应付管理人报酬	-	-	-	18,970.38	18,970.38
应付托管费	-	-	-	3,347.69	3,347.69
其他负债	-	-	-	286,588.45	286,588.45
负债总计	-	-	-	323,279.36	323,279.36
利率敏感度缺口	2,321,167.13	-	-	26,309,627.56	28,630,794.69
上年度末 2021 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	2,158,155.72	-	-	-	2,158,155.72
结算备付金	7,146.59	-	-	-	7,146.59

存出保证金	532.22	-	-	-	532.22
交易性金融资产	-	-	-	27,582,401.49	27,582,401.49
应收证券清算款	-	-	-	33,349.07	33,349.07
应收利息	-	-	-	214.98	214.98
应收申购款	-	-	-	15,497.94	15,497.94
资产总计	2,165,834.53	-	-	27,631,463.48	29,797,298.01
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	59,553.28	59,553.28
应付管理人报酬	-	-	-	21,524.47	21,524.47
应付托管费	-	-	-	3,798.44	3,798.44
应付交易费用	-	-	-	8,905.96	8,905.96
其他负债	-	-	-	240,209.84	240,209.84
负债总计	-	-	-	333,991.99	333,991.99
利率敏感度缺口	2,165,834.53	-	-	27,297,471.49	29,463,306.02

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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有固定收益品种投资 (2021 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2021 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计 (轧差计算) 占基金资产净值的比例为 90%-95%，其中投资于股票资产 (含存

托凭证)的比例不低于基金资产净值的 90%，投资于中证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产净值的 80%；债券、现金以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-10%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金 (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。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，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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	26,620,294.79	92.98	27,582,401.49	93.62
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	26,620,294.79	92.98	27,582,401.49	93.62

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		
	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 (2022 年 6 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 141	增加约 149
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 141	减少约 149

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	26,620,294.79	27,582,401.49
第二层次	—	—
第三层次	—	—
合计	26,620,294.79	27,582,401.49

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	26,620,294.79	91.94
	其中：股票	26,620,294.79	91.94
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	2,319,270.13	8.01
8	其他各项资产	14,509.13	0.05
9	合计	28,954,074.05	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	322,776.80	1.13
B	采矿业	1,005,359.00	3.51
C	制造业	16,815,127.05	58.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	827,079.00	2.89
E	建筑业	227,908.80	0.80
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	602,462.00	2.10
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,147,892.00	4.01
J	金融业	3,204,671.40	11.19
K	房地产业	679,488.98	2.37
L	租赁和商务服务业	605,224.84	2.11
M	科学研究和技术服务业	458,803.88	1.60
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	256,218.71	0.89
R	文化、体育和娱乐业	53,376.00	0.19

S	综合	-	-
	合计	26,206,388.46	91.53

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	204,353.00	0.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	209,553.33	0.73
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	413,906.33	1.45

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未通过港股通交易机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	1,277	2,611,465.00	9.12
2	300750	宁德时代	3,000	1,602,000.00	5.60
3	600036	招商银行	27,100	1,143,620.00	3.99
4	601318	中国平安	23,700	1,106,553.00	3.86
5	601012	隆基绿能	12,460	830,209.80	2.90
6	002594	比亚迪	2,000	666,980.00	2.33
7	000333	美的集团	10,700	646,173.00	2.26
8	300059	东方财富	23,156	588,162.40	2.05
9	600900	长江电力	24,900	575,688.00	2.01
10	601888	中国中免	2,000	465,860.00	1.63

11	603259	药明康德	4,412	458,803.88	1.60
12	002415	海康威视	10,325	373,765.00	1.31
13	601398	工商银行	76,800	366,336.00	1.28
14	002475	立讯精密	10,819	365,574.01	1.28
15	600276	恒瑞医药	9,184	340,634.56	1.19
16	600309	万华化学	3,400	329,766.00	1.15
17	000651	格力电器	9,700	327,084.00	1.14
18	000725	京东方 A	82,200	323,868.00	1.13
19	002714	牧原股份	5,840	322,776.80	1.13
20	600438	通威股份	5,300	317,258.00	1.11
21	300760	迈瑞医疗	1,000	313,200.00	1.09
22	000002	万科 A	15,200	311,600.00	1.09
23	601899	紫金矿业	31,600	294,828.00	1.03
24	002129	TCL 中环	5,000	294,450.00	1.03
25	000792	盐湖股份	9,500	284,620.00	0.99
26	002812	恩捷股份	1,100	275,495.00	0.96
27	600048	保利发展	15,763	275,221.98	0.96
28	603799	华友钴业	2,810	268,692.20	0.94
29	002460	赣锋锂业	1,800	267,660.00	0.93
30	300015	爱尔眼科	5,723	256,218.71	0.89
31	300124	汇川技术	3,800	250,306.00	0.87
32	600031	三一重工	13,000	247,780.00	0.87
33	601088	中国神华	7,200	239,760.00	0.84
34	300014	亿纬锂能	2,400	234,000.00	0.82
35	601668	中国建筑	42,840	227,908.80	0.80
36	600089	特变电工	8,300	227,337.00	0.79
37	002271	东方雨虹	4,400	226,468.00	0.79
38	002352	顺丰控股	4,000	223,240.00	0.78
39	600941	中国移动	3,600	217,800.00	0.76
40	600436	片仔癀	600	214,038.00	0.75
41	603986	兆易创新	1,500	213,315.00	0.75
42	600690	海尔智家	7,688	211,112.48	0.74
43	300274	阳光电源	2,100	206,325.00	0.72
44	601816	京沪高铁	40,100	201,302.00	0.70
45	603501	韦尔股份	1,100	190,333.00	0.66
46	600406	国电南瑞	7,032	189,864.00	0.66
47	688981	中芯国际	4,200	189,714.00	0.66
48	002709	天赐材料	3,000	186,180.00	0.65
49	601225	陕西煤业	8,500	180,030.00	0.63
50	601919	中远海控	12,800	177,920.00	0.62
51	300122	智飞生物	1,600	177,616.00	0.62
52	002241	歌尔股份	5,200	174,720.00	0.61

53	600585	海螺水泥	4,900	172,872.00	0.60
54	002049	紫光国微	900	170,748.00	0.60
55	300142	沃森生物	3,500	169,365.00	0.59
56	002230	科大讯飞	4,100	169,002.00	0.59
57	600111	北方稀土	4,800	168,768.00	0.59
58	002371	北方华创	600	166,272.00	0.58
59	000661	长春高新	700	163,394.00	0.57
60	000063	中兴通讯	6,200	158,286.00	0.55
61	300450	先导智能	2,400	151,632.00	0.53
62	000338	潍柴动力	11,900	148,393.00	0.52
63	000100	TCL 科技	30,700	147,053.00	0.51
64	601985	中国核电	20,600	141,316.00	0.49
65	002027	分众传媒	20,708	139,364.84	0.49
66	600893	航发动力	2,900	131,979.00	0.46
67	600050	中国联通	38,000	131,480.00	0.46
68	601766	中国中车	24,880	129,376.00	0.45
69	600745	闻泰科技	1,400	119,154.00	0.42
70	600010	包钢股份	49,900	117,265.00	0.41
71	002410	广联达	2,100	114,324.00	0.40
72	600570	恒生电子	2,600	113,204.00	0.40
73	600905	三峡能源	17,500	110,075.00	0.38
74	600019	宝钢股份	17,700	106,554.00	0.37
75	600028	中国石化	25,200	102,816.00	0.36
76	601857	中国石油	18,700	99,110.00	0.35
77	600426	华鲁恒升	3,300	96,360.00	0.34
78	001979	招商蛇口	6,900	92,667.00	0.32
79	600176	中国巨石	5,300	92,273.00	0.32
80	600346	恒力石化	4,100	91,184.00	0.32
81	002493	荣盛石化	5,900	90,801.00	0.32
82	603993	洛阳钼业	15,500	88,815.00	0.31
83	300782	卓胜微	640	86,400.00	0.30
84	002648	卫星化学	3,200	82,720.00	0.29
85	601600	中国铝业	17,200	81,700.00	0.29
86	002080	中材科技	2,700	74,250.00	0.26
87	600989	宝丰能源	4,800	70,320.00	0.25
88	600588	用友网络	3,200	69,472.00	0.24
89	600219	南山铝业	18,200	67,158.00	0.23
90	000301	东方盛虹	3,900	65,949.00	0.23
91	002601	龙佰集团	3,100	62,155.00	0.22
92	002555	三七互娱	2,900	61,567.00	0.22
93	000938	紫光股份	3,100	60,140.00	0.21
94	603260	合盛硅业	500	58,980.00	0.21

95	300413	芒果超媒	1,600	53,376.00	0.19
96	300628	亿联网络	700	53,305.00	0.19
97	002602	世纪华通	9,800	47,236.00	0.16
98	000708	中信特钢	2,200	44,330.00	0.15
99	601728	中国电信	9,100	33,943.00	0.12
100	002064	华峰化学	3,300	27,852.00	0.10

7.3.2 期末积极投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600809	山西汾酒	460	149,408.00	0.52
2	601658	邮储银行	14,200	76,538.00	0.27
3	600030	中信证券	3,040	65,846.40	0.23
4	601166	兴业银行	3,100	61,690.00	0.22
5	002304	洋河股份	300	54,945.00	0.19
6	002142	宁波银行	153	5,478.93	0.02

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	300750	宁德时代	568,876.00	1.93
2	300760	迈瑞医疗	439,727.00	1.49
3	601012	隆基绿能	407,357.00	1.38
4	600941	中国移动	383,578.00	1.30
5	601318	中国平安	332,387.00	1.13
6	600036	招商银行	308,376.00	1.05
7	000792	盐湖股份	299,405.00	1.02
8	600309	万华化学	236,834.00	0.80
9	002460	赣锋锂业	228,209.00	0.77
10	603799	华友钴业	223,625.00	0.76
11	002129	TCL 中环	222,849.00	0.76
12	300014	亿纬锂能	216,191.00	0.73
13	601166	兴业银行	210,195.00	0.71
14	600089	特变电工	206,572.00	0.70
15	603986	兆易创新	205,349.00	0.70
16	002271	东方雨虹	202,532.00	0.69
17	002241	歌尔股份	201,757.00	0.68
18	002415	海康威视	194,088.00	0.66
19	002142	宁波银行	192,800.00	0.65
20	603259	药明康德	189,132.00	0.64

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	000858	五粮液	879,101.43	2.98
2	601166	兴业银行	823,773.00	2.80
3	002142	宁波银行	597,961.00	2.03
4	600887	伊利股份	484,035.72	1.64
5	600030	中信证券	391,698.00	1.33
6	000001	平安银行	383,809.80	1.30
7	000568	泸州老窖	366,546.00	1.24
8	601658	邮储银行	357,182.00	1.21
9	300059	东方财富	349,080.00	1.18
10	601328	交通银行	342,783.00	1.16
11	600809	山西汾酒	324,062.00	1.10
12	600837	海通证券	306,634.48	1.04
13	603288	海天味业	301,592.50	1.02
14	601318	中国平安	289,940.00	0.98
15	601688	华泰证券	263,932.00	0.90
16	600036	招商银行	262,639.00	0.89
17	601818	光大银行	228,840.00	0.78
18	601601	中国太保	226,101.00	0.77
19	601288	农业银行	215,544.00	0.73
20	600104	上汽集团	191,115.02	0.65

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	14,796,870.93
卖出股票收入（成交）总额	13,712,159.07

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 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 投资组合报告附注

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

7.11.2 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。

7.11.3 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	1,897.00
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	12,612.13
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	14,509.13

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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 (%)
2,142	10,496.18	372,998.19	1.66	22,109,813.61	98.34

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	梁志云	713,200.00	21.68
2	肖华	262,711.00	7.98
3	邓义勇	170,000.00	5.17
4	程爱荣	163,491.00	4.97
5	中国石油天然气集团公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	154,012.00	4.68
6	中国大地财产保险股份有限公司	144,294.00	4.39
7	郭丑云	128,000.00	3.89
8	王丽辉	112,444.00	3.42
9	洪耀林	109,991.00	3.34
10	解俊荣	101,268.00	3.08

注：持有人为场内持有人。

8.3 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	1,304.21	0.005801

8.4 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

基金转型后首个运作日（2020 年 3 月 27 日）基金份额总额	78,056,830.69
本报告期期初基金份额总额	21,463,165.80
本报告期基金总申购份额	2,318,813.23
减：本报告期基金总赎回份额	1,299,167.23
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	22,482,811.80

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

1、经国海富兰克林基金管理有限公司第六届董事会第十三次会议审议通过，自 2022 年 3 月 1 日起，季勇先生担任公司副总经理。相关公告已于 2022 年 3 月 3 日在《上海证券报》和公司网站披露。

2、经国海富兰克林基金管理有限公司第六届董事会第二十一次会议审议通过，自 2022 年 6 月 1 日起，徐荔蓉先生不再担任公司副总经理，聘任徐荔蓉先生担任公司总经理。相关公告已于 2022 年 6 月 3 日在《证券时报》和公司网站披露。

(二) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

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 (%)	
光大证券	2	15,118,073.13	53.13	14,079.45	53.13	-
华创证券	1	4,384,150.00	15.41	4,082.97	15.41	-
国海证券	2	3,784,557.00	13.30	3,524.67	13.30	-
银河证券	1	2,155,088.00	7.57	2,007.14	7.57	-
瑞银证券	1	1,543,751.54	5.42	1,437.66	5.42	-
东方证券	2	1,470,837.20	5.17	1,369.76	5.17	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	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 (%)

光大证券	41,025.00	100.00	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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	关于增加上海利得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	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-1-4
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	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-1-24
3	富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-1-24
4	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加平安证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-1-26

5	国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-3-3
6	关于增加申万宏源西部证券有限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、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-3-14
7	国海富兰克林基金管理有限公司关于北京分公司办公地址变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-3-24
8	国海富兰克林基金管理有限公司 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-3-31
9	富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2021 年年度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-3-31
10	国海富兰克林基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-4-6
11	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	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-4-22
12	富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-4-22
13	国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-6-3
14	国海富兰克林基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-6-20
15	富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (2022 年 1 号)	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-6-30

§ 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

基金资产可投资于科创板股票和北京证券交易所股票，会面临科创板和北京证券交易所机制下因投资标的、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、中小企业经营风险、投资集中风险、系统性风险、政策风险等。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、北京证券交易所股票或选择不将基金资产投资于科创板股票、北京证券交易所股票，基金资产并非必然投资于科创板股票、北京证券交易所股票。

§ 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中证 100 指数增强型分级证券投资基金设立的文件（于 2020 年 3 月 26 日自动转换为上市开放式基金 (LOF)，基金名称变更为“富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)”）；
- 2、《富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

国海富兰克林基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日