富兰克林国海全球科技互联混合型证券投资基金（QDII）
2021年第3季度报告

2021年9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

报告送出日期：2021年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富全球科技互联混合（QDII）
基金主代码	006373
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 20 日
报告期末基金份额总额	34,993,472.90 份
投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下，力争总回报最大化，以谋求长期保值增值。
投资策略	在股票投资上，本基金主要投资于科技互联主题的公司，本基金所指的科技互联主题相关公司指主要收入或预期收入来源于科技互联主题及相关业务的公司，在个股选择上，主要包括股票初级筛选、公司深度基本面分析、投资价值评估、投资组合构建与管理和投资组合的调整和优化。在债券投资上，本基金根据基金资产投资运作的具体情况，通过债券投资以达到优化流动性管理的目的。本基金将投资于境内债券及与中国证监会签订了双边监管合作谅解备忘录的国家或地区信用等级为投资级以上的债券，其资产组合以安全性、流动性和收益性为配置原则。在金融衍生品投资上，基金管理人在确保与基金投资目标相一致的前提下，可本着谨慎和风险可控的原则，适度投资于经中国证监会允许的各类金融衍生产品，如期权、期货、权证、远期合约、掉期等。在外汇管理上，本基金将贯彻以实现外汇管理的套期保值、有效规避人民币汇率风险为主的外汇管理政策。
业绩比较基准	40%×MSCI 全球信息科技指数+40%×中证海外中国互联网指数+人民币活期存款利率（税后）×20%
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。
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	
下属分级基金的基金简称	国富全球科技互联混合（QDII）人民币	国富全球科技互联混合（QDII）美元现汇
下属分级基金的交易代码	006373	006374
报告期末下属分级基金的份额总额	33,548,299.16 份	1,445,173.74 份
境外资产托管人	英文名称：JP Morgan Chase Bank, National Association	
	中文名称：摩根大通银行	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）	
	国富全球科技互联混合（QDII）人民币	国富全球科技互联混合（QDII）美元现汇
1.本期已实现收益	247,864.52	83,441.93
2.本期利润	-5,718,041.69	-1,796,090.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1736	-1.2315
4.期末基金资产净值	78,392,930.31	23,225,973.63
5.期末基金份额净值	2.3367	2.4781

注：

1. 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。

2. 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. 国富全球科技互联混合（QDII）人民币份额以人民币计价并进行申购获得人民币份额；国富全球科技互联混合（QDII）美元份额以美元计价并进行申购获得美元份额。

4. 国富全球科技互联混合（QDII）美元份额的加权平均基金份额本期利润为每份美元份额对应的利润。

5. 国富全球科技互联混合（QDII）美元份额的期末基金份额净值单位为美元。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国富全球科技互联混合（QDII）人民币

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-6.96%	1.10%	-13.70%	1.32%	6.74%	-0.22%
过去六个月	-0.07%	1.05%	-13.36%	1.13%	13.29%	-0.08%

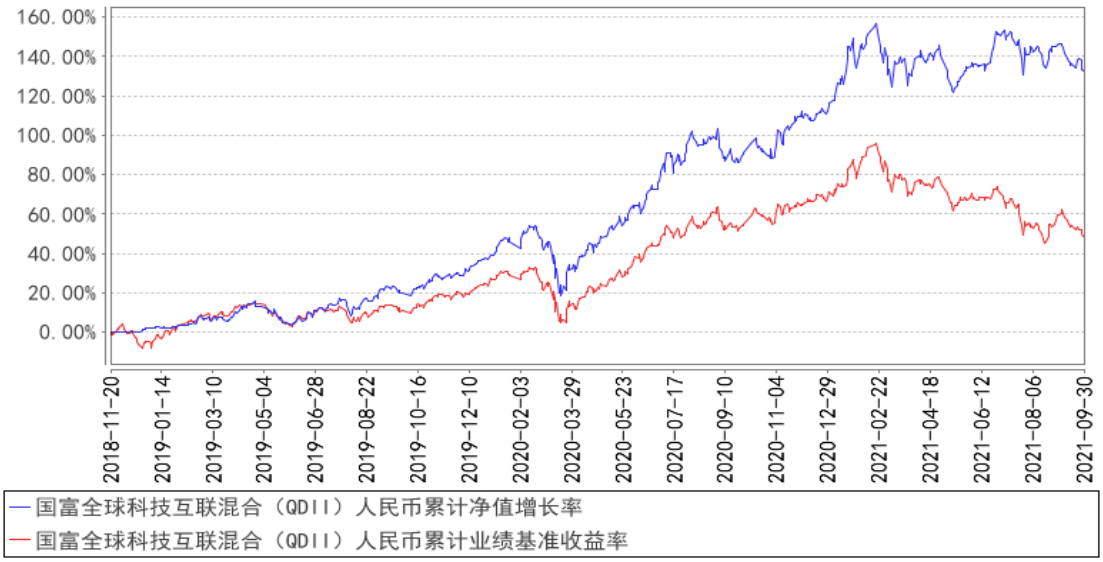
过去一年	22.23%	1.26%	-3.93%	1.21%	26.16%	0.05%
自基金合同生效起至今	133.67%	1.29%	48.74%	1.25%	84.93%	0.04%

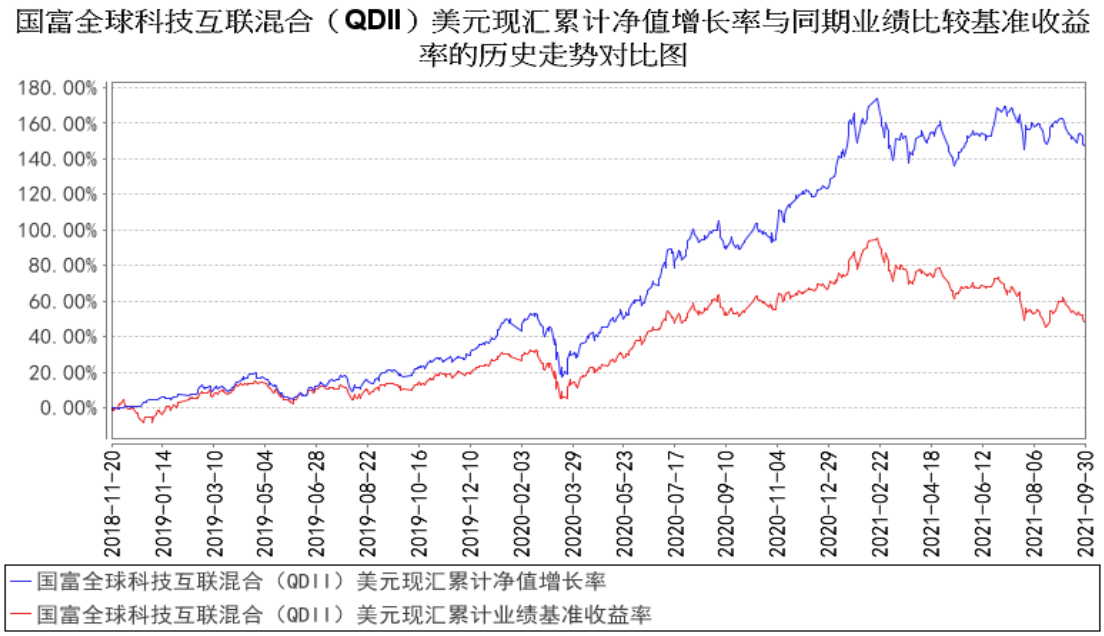
国富全球科技互联混合（QDII）美元现汇

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-7.37%	1.08%	-13.70%	1.32%	6.33%	-0.24%
过去六个月	1.09%	1.04%	-13.36%	1.13%	14.45%	-0.09%
过去一年	27.76%	1.25%	-3.93%	1.21%	31.69%	0.04%
自基金合同生效起至今	147.81%	1.28%	48.74%	1.25%	99.07%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

国富全球科技互联混合（QDII）人民币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





注：本基金的基金合同生效日为 2018 年 11 月 20 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
狄星华	国富全球科技互联混合(QDII)基金的基金经理兼高级研究员	2018 年 11 月 20 日	-	13 年	狄星华女士，CFA，上海大学世界经济学硕士。历任道琼斯咨询(上海)有限公司分析师，易唯思商务咨询有限公司高级分析师，国海富兰克林基金管理有限公司高级研究员。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富全球科技互联混合(QDII)基金的基金经理兼高级研究员。
徐成	公司 QDII 投资总监，国富亚洲机会股票(QDII)基金、国富大中华精选混合(QDII)基金、国富美元债定期债券(QDII)基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金、国富全球科技互联混合(QDII)基金及国富港股通远见价值混合基金的基金经理	2018 年 11 月 20 日	-	15 年	徐成先生，CFA，朴茨茅斯大学（英国）金融决策分析硕士。历任永丰金证券（亚洲）有限公司上海办事处研究员，新加坡东京海上国际资产管理有限公司上海办事处研究员、高级研究员、首席代表，国海富兰克林基金管理有限公司 QDII 投资副总监。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司 QDII 投资总监，国富亚洲机会股票(QDII)基金、国富大中华精选混合(QDII)基金、国富美元债定期债券(QDII)基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金、国富全球科技互联混合(QDII)基金及国富港股通远见价值混合基金的基金经理。

注：

1. 表中“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，其中，首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。

2. 表中“证券从业年限”的计算标准为该名员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《富兰克林国海全球科技互联混合型证券投资基金（QDII）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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配、信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》，严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度海外市场波动较大，市场的焦点开始从担忧Delta变种病毒影响经济重启，转移到经济重启带动上游原材料涨价，从而挤压企业的利润端上。另外，随着时间的推移，大家对美联储QE缩减预期越来越充分，但同时也担心缩减力度与节奏。分月看，美股7月与8月仍然表现出色，但9月经历了一次比较大的调整。我们主要关注的市场，纳斯达克在第三季度下跌0.4%，标普500在第三季度微涨0.2%，香港市场仍然疲软，恒生指数下跌14.8%，恒生科技指数下跌25.2%。

结合全球主要上市公司的第二季财报与第三季财务指引，我们观察结果是 80%以上的美股上

市公司第二季度业绩高于预期。利润端，虽然上游成本压力提升，但对净利润率扰动不大。因此我们仍然看好全球具备垄断力的大型科技股，我们认为无论是估值还是竞争力，这些公司的“性价比”依旧较高。虽然十年期美债利率上涨以及即将发生的 QE 缩减对这次高成长公司带来逆风，我们认为短期调整是为进一步成长蓄势。

从二季度开始，中概股以及香港的大型科网股因为市场变化出现连续下跌，我们认为在短期阵痛之后行业发展会更为健康，预计未来估值会逐渐走出底部。从八月开始，我们逐步在市场下跌过程中分批买入港股科技公司，虽然短期仍可能承受一定的市场波动，但长期来看，我们判断中国科技股公司还是会参与国际竞争，中国核心的科技公司在每一轮行业洗盘过程中，竞争力会更加坚实。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 9 月 30 日，本基金人民币份额净值为 2.3367 元，本报告期基金份额下跌 6.96%，业绩比较基准收益率下跌 13.70%，跑赢业绩比较基准 6.74%；基金美元份额净值为 2.4781 美元，本报告期基金份额下跌 7.37%，业绩比较基准收益率下跌 13.70%，跑赢业绩比较基准 6.33%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	79,818,077.86	77.12
	其中：普通股	74,796,679.08	72.26
	优先股	-	-
	存托凭证	5,021,398.78	4.85
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,822,794.32	14.32
8	其他资产	8,863,873.32	8.56
9	合计	103,504,745.50	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	48,232,730.48	47.46
中国香港	28,311,860.68	27.86
中国	3,273,486.70	3.22
合计	79,818,077.86	78.55

注：以上国家（地区）均按照股票及存托凭证上市交易地点进行统计。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
电信业务	5,910,611.97	5.82
消费者非必需品	16,399,353.29	16.14
消费者常用品	2,874,057.00	2.83
能源	-	-
金融	-	-

医疗保健	4,544,247.15	4.47
工业	1,818,703.27	1.79
信息技术	43,468,414.31	42.78
原材料	-	-
房地产	4,802,690.87	4.73
公共事业	-	-
合计	79,818,077.86	78.55

注：以上分类采用 GICS 行业分类标准。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量(股)	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	4,612,486.61	4.54
2	MICROSOFT	微软	MSFT US	纳斯达克	美国	2,400	4,388,073.52	4.32
3	AMAZON	亚马逊	AMZN US	纳斯达克	美国	200	4,260,959.68	4.19
4	SALESFORCE	塞尔福斯	CRM US	纽约证券交易所	美国	2,400	4,221,528.45	4.15
5	FACEBOOK	脸书	FB US	纳斯达克	美国	1,900	4,182,051.82	4.12

6	TAIWAN SEMICONDUCTOR	台积电	TSM UN	纽约证券交易所	美国	5,600	4,054,931.50	3.99
7	NVIDIA	英伟达	NVDA US	纳斯达克	美国	2,700	3,627,491.75	3.57
8	MEITUAN	美团	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	16,200	3,328,008.06	3.27
9	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 HK	香港联合交易所	中国香港	280,000	3,209,613.57	3.16
10	ADVANCED MICRO DEVICES	超威半导体	AMD US	纳斯达克	美国	4,600	3,069,799.24	3.02

注：上述表格“所属国家（地区）”均按照股票及存托凭证上市交易地点统计。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资

明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	221,028.44
2	应收证券清算款	8,176,418.11
3	应收股利	29,516.82
4	应收利息	4,636.97
5	应收申购款	432,272.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,863,873.32

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富全球科技互联混合（QDII）人民币	国富全球科技互联混合（QDII）美元现汇
报告期期初基金份额总额	31,825,351.45	1,448,237.99
报告期期间基金总申购份额	12,120,156.60	181,004.72
减:报告期期间基金总赎回份额	10,397,208.89	184,068.97
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	33,548,299.16	1,445,173.74

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本公司管理的该基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富兰克林国海全球科技互联混合型证券投资基金（QDII）设立的文件；

2、《富兰克林国海全球科技互联混合型证券投资基金（QDII）基金合同》；

3、《富兰克林国海全球科技互联混合型证券投资基金（QDII）招募说明书》；

4、《富兰克林国海全球科技互联混合型证券投资基金（QDII）托管协议》；

5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 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。

9.3 查阅方式

1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件。

2、登陆基金管理人网站 www.ftsfund.com 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日