

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 4 季度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 1 月 24 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2022年1月21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10月1日起至12月31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	33,414,413.04 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	<p>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 and 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。</p>
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	31,913,668.77 份	1,500,744.27 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10月1日-2021年12月31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	1,412,262.77	416,990.23
2. 本期利润	4,922,115.64	1,387,415.55
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1494	0.9395
4. 期末基金资产净值	79,247,527.08	25,626,034.31
5. 期末基金份额净值	2.4832	2.6782

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为2.6782美元，折合人民币份额净值17.0754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	6.27%	0.99%	-2.64%	1.22%	8.91%	-0.23%

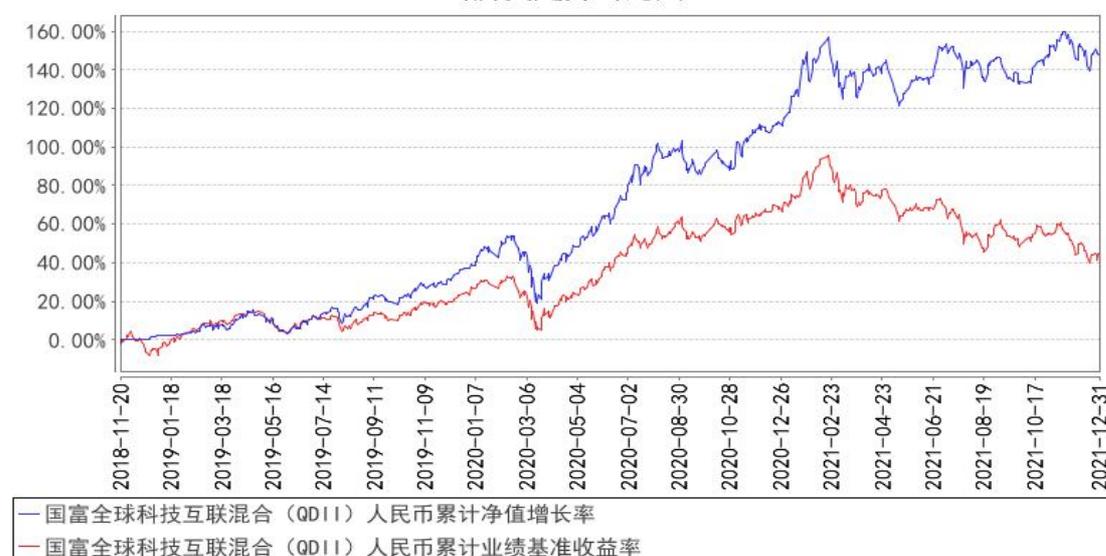
过去六个月	-1.12%	1.05%	-15.98%	1.27%	14.86%	-0.22%
过去一年	14.86%	1.23%	-15.40%	1.25%	30.26%	-0.02%
过去三年	143.21%	1.29%	52.39%	1.25%	90.82%	0.04%
自基金合同生效起至今	148.32%	1.27%	44.81%	1.25%	103.51%	0.02%

国富全球科技互联混合（QDII）美元现汇

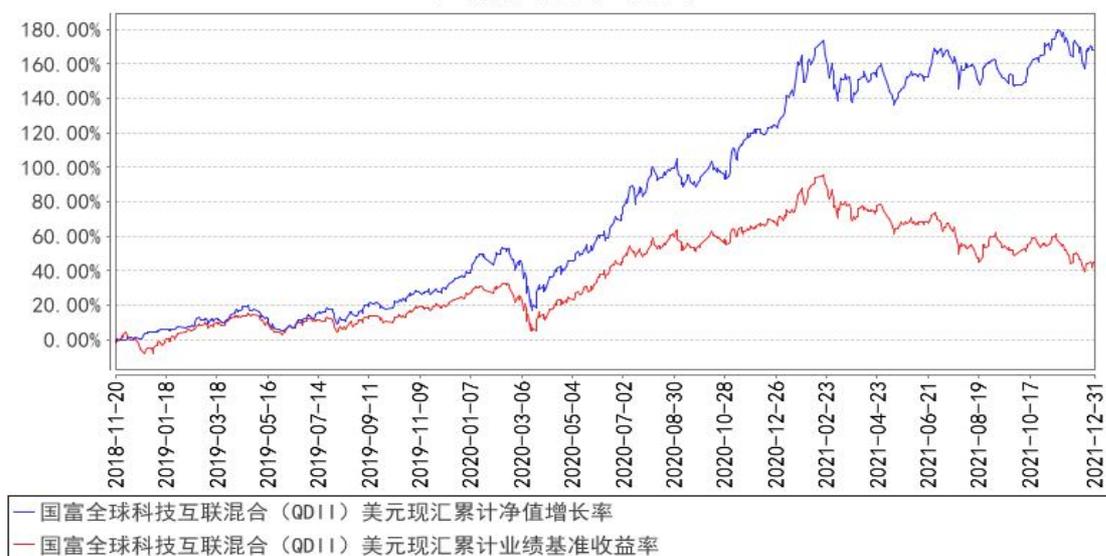
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.07%	0.99%	-2.64%	1.22%	10.71%	-0.23%
过去六个月	0.11%	1.04%	-15.98%	1.27%	16.09%	-0.23%
过去一年	17.18%	1.21%	-15.40%	1.25%	32.58%	-0.04%
过去三年	156.68%	1.28%	52.39%	1.25%	104.29%	0.03%
自基金合同生效起至今	167.82%	1.26%	44.81%	1.25%	123.01%	0.01%

### 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



国富全球科技互联混合（QDII）美元现汇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	-	14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	-	16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合规守信情况说明

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

海外市场十月之后随着时间的推移，大家对美联储QE缩减预期越来越充分，美股也表现相对积极。但在十一月的下旬，Omicron新病毒来袭，市场担心新病毒可能再一次推高通胀预期损害经济，因此对于QE退出节点是否合适存在担忧，并且开始在成长股的估值中重新评估升息与QE退出的影响，因此美股波动也比较大。纳斯达克在第四季度上涨8.3%，标普500在第四季度上涨10.7%，香港市场仍然疲软，恒生指数下跌4.8%，恒生科技指数下跌7.1%。

虽然近期美股市场下跌幅度较大，市场担心Omicron疫情延续和美联储政策意外“转鹰”。但我们更愿意理性地自下而上以基本面结合估值的方法去甄别个股机会。总体而言，对于未来美股市场，我们较为乐观：第一，即使Omicron来袭，这次全球的准备要远好于去年三月，因此再次引起较大幅度调整的可能性不大；第二，供应链问题从第二季度开始逐步解决、库存周期加速、劳动力市场复苏，通胀预期在明年下半年开始缓解，而美股主要的大科技公司盈利增长依然强劲；

第三，从估值角度来看，标普 500 未来十二月的本益比（NTM P/E）目前在 20X，虽然从过去 10 年历史维度来看高出一个标准差，相对并不“便宜”。但结合最近几年的市场流动性，我们判断 20X 的估值大概率仍然可以被市场接受。

在九月十月海外市场的一波比较大的涨幅中，我们没有去交易部分热门股，而是逐步卖出部分已达我们目标价的仓位，因此在十一月下半月的市场调整中，有效控制了回撤。整体上本基金的核心配置仓位保持稳定，我们仍然认为部分海外企业具备估值合理、未来发展和能见度相对较高、且适合长期持有的价值。对于港股，我们认为性价比已逐步凸显，对于一些前期跌幅较大的行业与股票，从短期估值修复角度和中长期公司能见度来看，目前的估值均相对较为合理。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金份额净值(人民币)为 2.4832 元，本报告期基金份额上涨 6.27%，业绩比较基准下跌 2.64%，跑赢业绩比较基准 8.91%；本基金份额净值(美元)为 2.6782 美元，本报告期基金份额上涨 8.07%，业绩比较基准下跌 2.64%，跑赢业绩比较基准 10.71%。人民币份额与美元份额的涨幅差异主要由于人民币兑换美元汇率在四季度上升较多导致。

#### 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	89,271,921.85	81.56
	其中：普通股	83,595,674.39	76.37
	优先股	-	-
	存托凭证	5,676,247.46	5.19
	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	18,818,791.29	17.19
8	其他资产	1,363,983.16	1.25
9	合计	109,454,696.30	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	68,047,380.67	64.89
中国香港	13,516,841.18	12.89
中国	7,707,700.00	7.35
合计	89,271,921.85	85.12

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	7,026,850.24	6.70
消费者非必需品	10,418,956.85	9.93
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	2,698,081.48	2.57

工业	3,047,162.49	2.91
信息技术	66,080,870.79	63.01
原材料	-	-
房地产	-	-
公共事业	-	-
合计	89,271,921.85	85.12

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	AMAZON	亚马逊	AMZN US	纳斯达克	美国	300	6,377,625.46	6.08
2	MICROSOFT	微软	MSFT US	纳斯达克	美国	2,700	5,789,543.64	5.52
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	台积电	TSM UN	纽约证券交易所	美国	7,400	5,676,247.46	5.41
4	XILINX	赛灵思	XLNX US	纳斯达克	美国	3,900	5,272,174.72	5.03
5	APPLE	苹果	AAPL US	纳斯达克	美国	4,300	4,868,172.11	4.64
6	LAM RESEARCH CORP	拉姆研究	LRCX US	纳斯达克	美国	1,000	4,585,084.66	4.37
7	Shennan Circuits Co., Ltd	深南电路	002916 SZ	深圳证券交易所	中国	35,000	4,263,700.00	4.07
8	ServiceNow	-	NOW US	纽约证券交易所	美国	900	3,724,677.56	3.55
9	Meta Platforms	脸书	FB US	纳斯达克	美国	1,700	3,645,593.38	3.48
10	Rambus	蓝博士半导体	RMBS US	纳斯达克	美国	18,900	3,541,516.45	3.38

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	13,738.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	30,078.61
4	应收利息	5,888.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,314,277.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,363,983.16

### 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	33,548,299.16	1,445,173.74
报告期期间基金总申购份额	5,432,235.71	265,836.70
减:报告期期间基金总赎回份额	7,066,866.10	210,266.17
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	31,913,668.77	1,500,744.27

## § 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。

## § 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](http://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](http://www.ftsfund.com) 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

2022年1月24日