

富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国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

§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	6
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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
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	11
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
§5 托管人报告	14
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真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
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
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 本报告期投资基金情况.....	46
7.13 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 本报告持有的基金发生的重大影响事件.....	53
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	53
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53

10.9 其他重大事件	56
§11 备查文件目录	58
11.1 备查文件目录	58
11.2 存放地点	58
11.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）
基金简称	国富平衡养老三年混合（FOF）
基金主代码	008625
交易代码	008625
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 3 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	52,257,894.80 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用目标风险策略投资，在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理、基金优选，期望实现与其承担的风险相对应的长期稳健回报，追求基金长期稳健增值。
投资策略	本基金为一只平衡型的目标风险策略基金，通过均衡配置于权益类和固定收益类资产来获取养老资金的长期稳健增值。在资产配置上，本基金为目标风险策略基金，根据基金合同约定的权益类、非权益类资产的目标配置比重进行资产配置。同时基金经理将结合资本市场实际发展情况，在基金合同约定的范围内对各大类资产配置比例进行动态调整。在基金投资上，采用定量和定性相结合的方法对基金数据进行分析，构建备选基金池。根据资产配置方案、投资策略，通过量化测算确立基金配置比例，构建基金投资组合。 在股票投资上，本基金对股票的投资，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的策略，对上市公司的行业发展趋势、成长性与投资价值进行权衡，根据实体经济运行、产业发展趋势、上下游行业运行态势等观察并选取景气度上行行业，并通过对上市公司基本面的深入研究筛选价格处于合理水平的股票进行投资。 在债券投资上，本基金通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究，结合新券发行情况，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略，把握债券市场投资机会，以获取稳健的投资收益。本基金也可进行资产支持证券投资。

业绩比较基准	中证 800 指数收益率*40%+中债国债总指数收益率（全价）*60%
风险收益特征	本基金为基金中基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中风险收益特征的证券投资基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国海富兰克林基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	许俊
	联系电话	021-3855 5555	010-66594319
	电子邮箱	service@ftsfund.com	fcid@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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国海富兰克林基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海 国金中心二期 9 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,834,347.34
本期利润	1,749,984.10
加权平均基金份额本期利润	0.0338
本期加权平均净值利润率	2.94%
本期基金份额净值增长率	3.00%
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	6,280,485.21
期末可供分配基金份额利润	0.1202
期末基金资产净值	61,063,931.07
期末基金份额净值	1.1685
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	16.85%

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

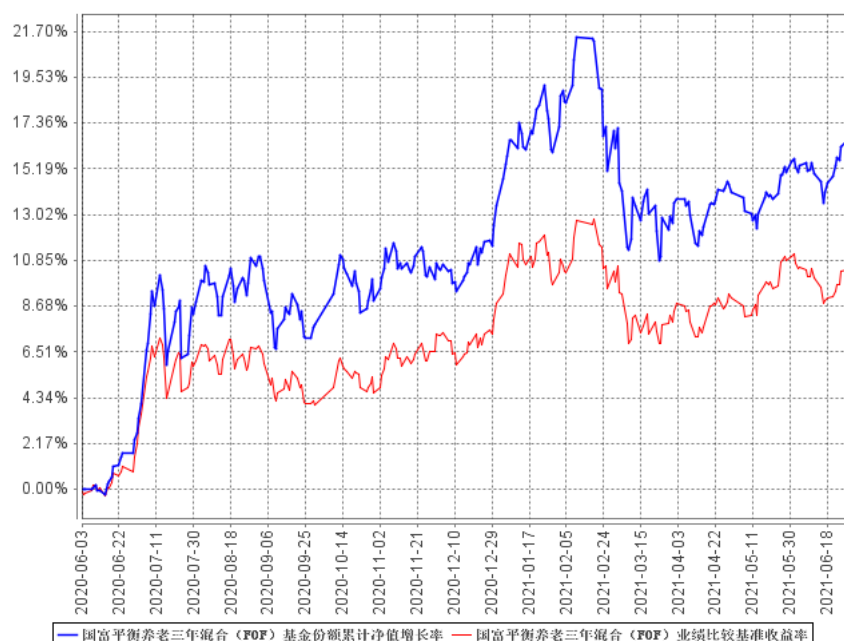
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.17%	0.38%	-0.73%	0.32%	1.90%	0.06%
过去三个月	3.76%	0.41%	2.14%	0.36%	1.62%	0.05%
过去六个月	3.00%	0.71%	1.29%	0.49%	1.71%	0.22%

过去一年	14.17%	0.71%	8.58%	0.51%	5.59%	0.20%
自基金合同生效起至今	16.85%	0.69%	10.24%	0.49%	6.61%	0.20%

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

国富平衡养老三年混合（FOF）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 6 月 3 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要求。

§ 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		
WU XIAN (吴弦)	国富平衡养老三年混合(FOF)基金的基金经理	2020 年 6 月 3 日	-	11 年	WU XIAN (吴弦), CFA, 悉尼大学金融学专业商学硕士。历任美国道富银行研究员, 康特金融投资顾问, 北京巨龙九鼎投资管理有限公司投资经理, 中国人寿养老保险股份有限公司高级主管, 国海富兰克林基金管理有限公司 FOF 投资经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富平衡养老三年混合(FOF)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遵规守信情况的说明

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《富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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

上半年，权益市场呈现大幅波动态势。沪深 300 上涨 2.16%，创业板指上涨 19.88%，恒生指数上涨 6.19%，恒生科技下跌 1.69%。A 股市场呈现了非常分化的行情，成长股的行情大幅跑赢了价值股，相应的成长风格的基金也表现不俗。港股在年初表现一波之后，就陷入了弱势，尤其是恒生科技指数更以下跌收场，相应的，港股主题基金的业绩也呈现了前高后低的态势。债券方面，中债综合全价指数上涨 0.67%，整体看债券型基金实现了正收益。

本基金在年初时，持有港股基金较多，因而在年前净值增长较快，但在股市回调时，受到了一定影响，在 4、5 月份的反弹行情中，表现相对较弱。对此，在进行了策略的进一步研究后，我们对港股基金进行了减仓，做了组合的结构调整。我们认为，投资是一个不断验证、不断反思、不断提高的过程。很难有人保持永远的正确，也很难有某种量化模型能持续表现优秀。本基金的投资，以主观的思维结合量化的分析模式进行，也会持续地进行修正。

在股市大幅波动，行情极度分化的背景下，基金的业绩也呈现较大分化。大众投资者在做基金投资时，可能也会遇到更多难度，心理上可能会遭受更多考验，这时候 FOF 基金的优势会进一步显现。在管理 FOF 基金时，我们会根据行情变化，做相应的资产配置和策略调整，调整基金组合，以期能为投资者带来稳健成长的收益。

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 1.1685 元，本报告期份额净值上涨 3.00%，同期业绩比较基准上涨 1.29%，本基金跑赢业绩比较基准 1.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，主要关注几点：中国经济增速会否超预期下行、海外经济的复苏情况、新冠疫情的控制情况、美国货币流动性收紧的预期变化、国内外通胀情况等等。现阶段看，预计市场可能会呈现震荡态势，存在结构性的机会。债市相对中性，重点关注以票息收入为主的基金。

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

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（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合规守信、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，未发现本基金管理人存在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的真实、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：富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	2,349,571.25	1,151,952.85
结算备付金		164,065.41	110,199.78
存出保证金		5,862.59	9,430.83
交易性金融资产	6.4.7.2	56,821,772.30	55,958,090.12
其中：股票投资		664,679.00	879,580.00
基金投资		52,905,603.30	51,977,838.12
债券投资		3,251,490.00	3,100,672.00
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		1,776,400.14	819,107.93
应收利息	6.4.7.5	57,401.50	63,529.23
应收股利		1.78	1,699.41
应收申购款		589.53	7,908.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	1.20
资产总计		61,175,664.50	58,121,919.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	91,013.08
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		27,586.92	24,117.16
应付托管费		6,261.04	6,074.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	13,418.70	32,491.11
应交税费		-	1.28

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	64,466.77	120,000.00
负债合计		111,733.43	273,697.16
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	52,257,894.80	50,989,697.00
未分配利润	6.4.7.10	8,806,036.27	6,858,525.52
所有者权益合计		61,063,931.07	57,848,222.52
负债和所有者权益总计		61,175,664.50	58,121,919.68

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1685 元，基金份额总额 52,257,894.80 份。

6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 3 日(基 金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		2,315,602.35	1,239,991.94
1.利息收入		72,220.94	15,099.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,154.36	2,786.04
债券利息收入		64,938.01	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,128.57	12,313.51
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,327,741.04	128,431.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-205.50	-45,271.12
基金投资收益	6.4.7.13	2,245,331.17	155,494.60
债券投资收益	6.4.7.14	13,868.70	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	68,746.67	18,208.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-84,363.24	1,096,460.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3.61	-
减：二、费用		565,618.25	77,811.32

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	151,529.40	20,195.81
2. 托管费	6.4.10.2.2	37,586.34	4,833.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	304,489.42	35,265.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,163.24	411.31
7. 其他费用	6.4.7.20	69,849.85	17,105.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,749,984.10	1,162,180.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,749,984.10	1,162,180.62

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	50,989,697.00	6,858,525.52	57,848,222.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,749,984.10	1,749,984.10
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）	1,268,197.80	197,526.65	1,465,724.45
其中：1.基金申购款	1,268,197.80	197,526.65	1,465,724.45
2.基金赎回款	-	-	-
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）	52,257,894.80	8,806,036.27	61,063,931.07

项目	上年度可比期间 2020 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 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)	49,331,457.03	-	49,331,457.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,162,180.62	1,162,180.62
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)	166,160.89	1,275.71	167,436.60
其中：1.基金申购款	166,160.89	1,275.71	167,436.60
2.基金赎回款	-	-	-
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)	49,497,617.92	1,163,456.33	50,661,074.25

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：

<u>林勇</u>	<u>于意</u>	<u>肖燕</u>
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

富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)(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[2019]2537号《关于准予富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)注册的批复》注册,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《富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)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 49,319,750.52 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(2020)第 0405 号验资报告予以验证。经向中国

证监会备案，《富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》于 2020 年 6 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 49,331,457.03 份基金份额，其中认购资金利息折合 11,706.51 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。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,001,800.18 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

本基金每份基金份额的最短持有期限为自基金合同生效日或基金份额申购确认日起至基金合同生效日或基金份额申购确认日的三年对日的前一日的期间。在最短持有期限内，基金份额不能赎回；本基金每份基金份额在其最短持有期限到期后的下一个工作日(含)起，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、资产支持证券、证券投资基金(包括 ETF、QDII 基金、香港互认基金及其他经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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：投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额的资产比例不低于基金资产的 80%；权益类资产投资比例中枢为 50%，股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资合计占基金资产的比例为 40%-55%；股票、股票型基金、混合型基金和商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)等品种的投资比例合计不得超过基金资产的 60%；投资商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)的比例不得超过基金资产的 10%，本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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：中证 800 指数收益率 X40%+中债国债总指数收益率(全价)X60%。

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》、《富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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

本基金本报告期间的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 日止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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

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。

(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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	2,349,571.25
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	2,349,571.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		701,470.58	664,679.00	-36,791.58
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	3,291,632.98	3,251,490.00	-40,142.98
	银行间市场	—	—	—
	合计	3,291,632.98	3,251,490.00	-40,142.98
资产支持证券		—	—	—
基金		50,415,763.32	52,905,603.30	2,489,839.98
其他		—	—	—
合计		54,408,866.88	56,821,772.30	2,412,905.42

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	144.28
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	66.42
应收债券利息	57,188.46
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	2.34
合计	57,401.50

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	13,418.70
银行间市场应付交易费用	-
合计	13,418.70

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
合计	64,466.77

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	50,989,697.00	50,989,697.00
本期申购	1,268,197.80	1,268,197.80
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	52,257,894.80	52,257,894.80

注：根据《富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》、《富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》及《富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）开放申购、赎回和定期定额投资业务公告》的相关规定，本基金的所有基金份额于本报告期内尚未满三年持有期，不可办理赎回业务。

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	4,300,244.60	2,558,280.92	6,858,525.52
本期利润	1,834,347.34	-84,363.24	1,749,984.10
本期基金份额交易产生的变动数	145,893.27	51,633.38	197,526.65
其中：基金申购款	145,893.27	51,633.38	197,526.65
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	6,280,485.21	2,525,551.06	8,806,036.27

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,957.81
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	1,141.37
其他	55.18
合计	5,154.36

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,852,550.00
减：卖出股票成本总额	12,852,755.50
买卖股票差价收入	-205.50

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	152,678,604.04
减：卖出/赎回基金成本总额	150,433,272.87
基金投资收益	2,245,331.17

注：2021 年基金投资收益项金额已抵扣应缴纳增值税额 18,026.51 元，因表格情况未能列示。

6.4.7.14 债券投资收益**6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	13,868.70
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	13,868.70

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,787,644.21
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,704,140.43
减：应收利息总额	69,635.08
买卖债券差价收入	13,868.70

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,440.20
基金投资产生的股利收益	55,306.47
合计	68,746.67

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-84,363.24
——股票投资	-74,542.50
——债券投资	-44,777.44

——资产支持证券投资	-
——基金投资	34,956.70
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-84,363.24

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
其他收入-销售服务费返还	3.61
合计	3.61

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	37,028.75
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	267,460.67
其中：申购费	30,172.54
赎回费	156,892.96
交易费	6,627.82
转换费	73,767.35
合计	304,489.42

6.4.7.19.1 持有基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期费用
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	16,195.61
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	264,549.10
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	54,180.89

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
银行汇划费用	3,083.08
律师费	2,300.00
合计	69,849.85

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、基金销售机构、基金注册登记机构

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年6月3日(基金合同生效日)至2020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	-	-	12,357,322.47	83.78%

6.4.10.1.2 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年6月3日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例	成交金额	占当期基金 成交总额的比例
国海证券	-	-	63,865,216.78	85.08%

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
-------	----------------------------

	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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年6月3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	11,508.44	83.78%	11,508.44	83.78%

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020年6月3日(基金合同生效日)至 2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	151,529.40	20,195.81
其中：支付销售机构的客户维护费	109,771.16	14,165.84

注：

1. 本基金投资于基金管理人管理的其他基金部分不收取管理费。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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的 0.60% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$
2. 本基金本报告期因投资于基金管理人管理的其他基金而已在管理费计算基数中扣除部分对应的管理费金额为 26,017.86 元。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年6月3日(基金合同生效日) 至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	37,586.34	4,833.96

注：

1. 本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的 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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额 × 0.15% / 当年天数。

2. 本基金本报告期因投资于基金托管人所托管的其他基金而已在托管费计算基数中扣除部分对应的托管费金额为 6,800.36 元。

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**

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 3 日(基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2020 年 6 月 3 日）持有的基金份额	-	10,001,800.18
报告期初持有的基金份额	10,001,800.18	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,800.18	10,001,800.18
报告期末持有的基金份额	19.14%	20.21%

占基金总份额比例		
----------	--	--

注：

1. 本基金基金合同生效日为 2020 年 6 月 3 日。
2. 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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

1. 本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
2. 本报告期末和上年度末（2020 年 12 月 31 日）除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 6 月 3 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
中国银行	2,349,571.25	3,957.81	5,760,065.74	2,786.04

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。

6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

6.4.10.6.1 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司所管理的公开募集证券投资基金合计 5,805,919.76 元，占本基金资产净值的比例为 9.51%。

6.4.10.6.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期费用 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 3 日(基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	19,786.19	1,356.96

当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	3.61	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	63,411.62	4,510.76
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	11,026.08	773.11
当期交易基金产生的转换费（元）	11,298.91	-

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金（ETF 除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为 0，当期交易基金产生的赎回费或转换费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费或转换费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

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

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

本基金为基金中基金，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基金投资、股票投资和债券投资等。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，在场外申赎基

金份额均通过该基金的基金管理人的直销柜台办理，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的固定收益品种（2020 年 12 月 31 日：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 0.47%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金（ETF 联接基金除外）不超过被投资基金净

资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额）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（不含本基金所投资的基金份额）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，其余亦可在基金销售机构申购、赎回，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。在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的 10%；本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,349,571.25	-	-	-	2,349,571.25
结算备付金	164,065.41	-	-	-	164,065.41
存出保证金	5,862.59	-	-	-	5,862.59
交易性金融资产	3,251,490.00	-	-	53,570,282.30	56,821,772.30
应收证券清算款	-	-	-	1,776,400.14	1,776,400.14
应收利息	-	-	-	57,401.50	57,401.50
应收股利	-	-	-	1.78	1.78
应收申购款	-	-	-	589.53	589.53
资产总计	5,770,989.25	-	-	55,404,675.25	61,175,664.50
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	27,586.92	27,586.92
应付托管费	-	-	-	6,261.04	6,261.04
应付交易费用	-	-	-	13,418.70	13,418.70
其他负债	-	-	-	64,466.77	64,466.77
负债总计	-	-	-	111,733.43	111,733.43
利率敏感度缺口	5,770,989.25	-	-	55,292,941.82	61,063,931.07
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,151,952.85	-	-	-	1,151,952.85
结算备付金	110,199.78	-	-	-	110,199.78
存出保证金	9,430.83	-	-	-	9,430.83

交易性金融资产	2,829,717.00	123,880.00	147,075.00	52,857,418.12	55,958,090.12
应收证券清算款	-	-	-	819,107.93	819,107.93
应收利息	-	-	-	63,529.23	63,529.23
应收股利	-	-	-	1,699.41	1,699.41
应收申购款	-	-	-	7,908.33	7,908.33
其他资产	-	-	-	1.20	1.20
资产总计	4,101,300.46	123,880.00	147,075.00	53,749,664.22	58,121,919.68
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	91,013.08	91,013.08
应付管理人报酬	-	-	-	24,117.16	24,117.16
应付托管费	-	-	-	6,074.53	6,074.53
应付交易费用	-	-	-	32,491.11	32,491.11
应交税费	-	-	-	1.28	1.28
其他负债	-	-	-	120,000.00	120,000.00
负债总计	-	-	-	273,697.16	273,697.16
利率敏感度缺口	4,101,300.46	123,880.00	147,075.00	53,475,967.06	57,848,222.52

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 5.32%（2020 年 12 月 31 日：5.36%），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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票或债券，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。本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额的资产比例不低于基金资产的 80%；权益类资产投资比例中枢为 50%，股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资合计占基金资产的比例为 40%-55%；股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的投资比例合计不得超过基金资产的 60%；投资商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）的比例不得超过基金资产的 10%。本基金应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	664,679.00	1.09	879,580.00	1.52
交易性金融资产—基金投资	52,905,603.30	86.64	51,977,838.12	89.85
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	53,570,282.30	87.73	52,857,418.12	91.37

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 397	增加约 373
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 397	减少约 373

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 53,570,282.30 元，属于第二层次的余额为 3,251,490.00 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 53,128,373.12 元，第二层次 2,829,717.00 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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金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	664,679.00	1.09
	其中：股票	664,679.00	1.09
2	基金投资	52,905,603.30	86.48
3	固定收益投资	3,251,490.00	5.32
	其中：债券	3,251,490.00	5.32
	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	2,513,636.66	4.11
8	其他各项资产	1,840,255.54	3.01
9	合计	61,175,664.50	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	14,009.00	0.02
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	650,670.00	1.07
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	664,679.00	1.09

7.2.2 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

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	002142	宁波银行	7,000	272,790.00	0.45
2	000001	平安银行	10,000	226,200.00	0.37
3	601838	成都银行	12,000	151,680.00	0.25
4	002179	中航光电	100	7,902.00	0.01
5	000733	振华科技	100	6,107.00	0.01

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	000733	振华科技	2,191,600.00	3.79
2	002142	宁波银行	1,120,810.00	1.94
3	601838	成都银行	1,065,515.00	1.84
4	601166	兴业银行	979,293.00	1.69
5	000001	平安银行	954,807.00	1.65
6	600926	杭州银行	878,984.00	1.52
7	601601	中国太保	639,299.00	1.11
8	002352	顺丰控股	485,861.00	0.84
9	603678	火炬电子	468,626.00	0.81
10	002179	中航光电	420,825.00	0.73

11	600031	三一重工	412,396.00	0.71
12	601318	中国平安	373,541.00	0.65
13	000338	潍柴动力	364,838.00	0.63
14	600066	宇通客车	298,565.00	0.52
15	002389	航天彩虹	281,955.00	0.49
16	601066	中信建投	196,132.00	0.34
17	002601	龙佰集团	169,378.00	0.29
18	000063	中兴通讯	131,103.00	0.23
19	601899	紫金矿业	130,755.00	0.23
20	603267	鸿远电子	125,474.00	0.22

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	000733	振华科技	2,434,482.00	4.21
2	601166	兴业银行	978,430.00	1.69
3	601838	成都银行	917,522.00	1.59
4	600926	杭州银行	868,588.00	1.50
5	000001	平安银行	842,515.00	1.46
6	002142	宁波银行	834,418.00	1.44
7	601601	中国太保	579,748.00	1.00
8	002352	顺丰控股	481,856.00	0.83
9	603678	火炬电子	471,184.00	0.81
10	000338	潍柴动力	466,327.00	0.81
11	002179	中航光电	416,653.00	0.72
12	600031	三一重工	396,677.00	0.69
13	600066	宇通客车	381,939.00	0.66
14	601318	中国平安	367,177.00	0.63
15	002389	航天彩虹	284,108.00	0.49
16	002601	龙佰集团	239,508.00	0.41
17	601066	中信建投	189,110.00	0.33
18	000063	中兴通讯	137,300.00	0.24
19	002064	华峰化学	124,372.00	0.21
20	603267	鸿远电子	122,322.00	0.21

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	12,712,397.00
卖出股票收入（成交）总额	12,852,550.00

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	3,251,490.00	5.32
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	3,251,490.00	5.32

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	010107	21 国债(7)	32,450	3,251,490.00	5.32

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

根据基金合同，本基金不投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	003859	招商招旭纯债A	契约型开放式	3,700,870.97	4,484,715.44	7.34	否
2	217022	招商产业债券	契约型开放式	2,444,411.26	3,845,058.91	6.30	否
3	000286	银华信用季季红债券A	契约型开放式	3,022,966.50	3,186,206.69	5.22	否
4	233005	大摩强收益债券	契约型开放式	1,523,094.07	2,319,215.34	3.80	否
5	008383	招商安心收益债券A	契约型开放式	1,342,384.51	2,248,225.58	3.68	否
6	000934	国富大中华精选混合(QDII)	契约型开放式	689,022.79	2,020,903.84	3.31	是
7	008106	博时富瑞纯债债券C	契约型开放式	1,896,095.75	2,010,430.32	3.29	否
8	450009	国富中小盘股票	契约型开放式	686,400.20	1,939,080.57	3.18	是

9	519771	交银优择回报灵活配置混合C	契约型开放式	1,397,629.02	1,932,920.93	3.17	否
10	511880	银华交易型货币	契约型开放式	19,100.00	1,932,786.30	3.17	否
11	006594	博道中证500增强C	契约型开放式	900,000.00	1,847,070.00	3.02	否
12	007089	国投瑞银中证500指数量化增强C	契约型开放式	825,000.00	1,816,072.50	2.97	否
13	001054	工银新金融股票	契约型开放式	536,187.25	1,738,855.25	2.85	否
14	011437	中泰开阳价值优选混合C	契约型开放式	777,458.46	1,690,116.95	2.77	否
15	519702	交银趋势混合	契约型开放式	495,314.78	1,682,584.31	2.76	否
16	519133	海富通改革驱动混合	契约型开放式	462,344.75	1,271,910.41	2.08	否
17	002804	华泰柏瑞量化对冲	契约型开放式	1,000,000.00	1,227,900.00	2.01	否
18	161039	富国中证1000指数增强(LOF)	契约型开放式	624,452.00	1,212,123.78	1.99	否
19	513030	华安德国30(DAX)ETF	契约型开放式	974,000.00	1,207,760.00	1.98	否
20	001410	信达澳银新能源产业股票	契约型开放式	256,155.77	1,151,932.50	1.89	否
21	011565	富国周期优势混合C	契约型开放式	359,176.19	1,108,812.82	1.82	否
22	005760	富国周期优势混合	契约型开放式	309,870.47	958,088.51	1.57	否
23	006039	国富估值优势混合	契约型开放式	334,786.89	928,631.88	1.52	是
24	010687	工银文体产业股票C	契约型开放式	203,215.00	761,040.18	1.25	否

25	501054	东方红睿泽三年定开混合A	契约型开放式	461,816.00	731,978.36	1.20	否
26	002340	富国价值优势混合	契约型开放式	174,000.75	693,044.99	1.13	否
27	001975	景顺长城环保优势股票	契约型开放式	179,832.38	685,161.37	1.12	否
28	001217	易方达新收益混合C	契约型开放式	149,170.36	655,156.22	1.07	否
29	004263	华安沪港深机会	契约型开放式	250,000.00	651,750.00	1.07	否
30	519002	华安安信消费混合	契约型开放式	154,936.45	632,605.53	1.04	否
31	512800	华宝中证银行ETF	契约型开放式	499,300.00	614,139.00	1.01	否
32	512660	国泰中证军工ETF	契约型开放式	528,300.00	608,601.60	1.00	否
33	003972	国富美元债定期债券（QDII）	契约型开放式	569,071.67	607,654.73	1.00	是
34	010685	工银前沿医疗股票C	契约型开放式	120,000.00	603,720.00	0.99	否
35	011566	富国美丽中国混合C	契约型开放式	137,130.80	411,666.66	0.67	否
36	006257	信达澳银先进智造股票型	契约型开放式	120,932.85	334,125.37	0.55	否
37	450011	国富研究精选混合	契约型开放式	87,818.70	309,648.74	0.51	是
38	005613	上投摩根富时REITs人民币	契约型开放式	250,000.00	309,025.00	0.51	否
39	519736	交银新成长混合	契约型开放式	66,500.00	305,767.00	0.50	否
40	002593	富国美丽中国混合A	契约型开放式	68,507.88	206,003.20	0.34	否

41	010024	广发沪港深新起点股票C	契约型开放式	10,000.00	21,600.00	0.04	否
42	000891	博时现金宝货币B	契约型开放式	892.52	892.52	0.00	否
43	518880	华安黄金易(ETF)	契约型开放式	100.00	358.40	0.00	否
44	513500	博时标普500ETF	契约型开放式	100.00	261.60	0.00	否

注：鉴于部分基金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”。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	5,862.59
2	应收证券清算款	1,776,400.14
3	应收股利	1.78
4	应收利息	57,401.50
5	应收申购款	589.53
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,840,255.54

7.13.4 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。

7.13.5 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。

§ 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
1,002	52,153.59	10,001,800.18	19.14%	42,256,094.62	80.86%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,397.86	0.008416%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,800.18	19.14	10,001,800.18	19.14	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	99.51	0.00	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,001,899.69	19.14	10,001,800.18	19.14	自合同生效之日起不少于3年

注：鉴于基金管理人高级管理人员持有份额占基金总份额的比例过于微小，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”。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2020 年 6 月 3 日 ）基金份额总额	49,331,457.03
本报告期期初基金份额总额	50,989,697.00
本报告期基金总申购份额	1,268,197.80
减：本报告期基金总赎回份额	—
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	52,257,894.80

§ 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

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

报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 本报告持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 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为普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

10.7 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
国海证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	2,755,437.00	10.78%	2,566.16	11.72%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

海通证券	2	636,882.00	2.49%	593.14	2.71%	-
银河证券	1	578,243.00	2.26%	538.57	2.46%	-
申万宏源	2	1,113,046.00	4.35%	1,036.50	4.73%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	2,363,513.00	9.25%	2,201.13	10.05%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	5,316,029.00	20.79%	4,950.76	22.61%	-
瑞银证券	1	146,321.00	0.57%	136.26	0.62%	-
光大证券	2	364,284.00	1.42%	339.24	1.55%	-
长江证券	2	2,725,144.00	10.66%	2,537.88	11.59%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	9,566,048.00	37.42%	6,995.84	31.95%	-

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，本基金新增国盛证券深圳交易单元 1 个。

10.8.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国海证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
中信证 券	-	-	-	-	-	-	22,732,011.35	13.43%
中金公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	22,600.00	0.48%	2,200,000.00	45.83%	-	-	6,179,914.65	3.65%
申万宏 源	-	-	-	-	-	-	5,465,591.52	3.23%
中银国 际	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	98,088.43	2.09%	2,100,000.00	43.75%	-	-	41,879,529.96	24.75%
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	4,319,798.21	91.93%	-	-	-	-	60,371,385.08	35.68%
瑞银证 券	38,650.60	0.82%	500,000.00	10.42%	-	-	5,785,652.11	3.42%
光大证 券	102,169.66	2.17%	-	-	-	-	533,757.30	0.32%

长江证 券	117,684.44	2.50%	-	-	-	-	4,115,942.41	2.43%
民生证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-	22,140,792.10	13.09%

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 1 月 22 日
2	富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 1 月 22 日
3	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加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

4	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并实施申购和定期定额投资费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 3 月 9 日
5	国海富兰克林基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金法律文件的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 3 月 30 日
6	富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 3 月 30 日
7	富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)托管协议	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 3 月 30 日
8	富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)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 3 月 30 日
9	富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 3 月 30 日
10	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
11	富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF) 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
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	富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF) 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	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
15	富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)更新招募说明书(2021 年 2 号)	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)设立的文件；

2、《富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》；

3、《富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)招募说明书》；

4、《富兰克林国海平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)托管协议》；

5、中国证监会要求的其他文件。

11.2 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。

11.3 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 8 月 31 日