

富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金
2021 年年度报告

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：中国农业银行

送出日期：2022 年 3 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。本年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 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。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23

§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	57
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	57
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	58
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	67
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	77
8.7 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.....	77
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	78
8.9 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.....	78
8.10 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.....	78
8.11 投资组合报告附注.....	78
§9 基金份额持有人信息	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	79
9.3 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情况.....	79
§10 开放式基金份额变动	80
§11 重大事件揭示	81
11.1 基金份额持有人大会决议.....	81
11.2 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.....	81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	81
11.4 基金投资策略的改变.....	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	81
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	82
11.8 其他重大事件.....	89
§12 影响投资者决策的其他重要信息	93
12.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	93
§13 备查文件目录	94
13.1 备查文件目录.....	94
13.2 存放地点.....	94
13.3 查阅方式.....	94

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金
基金简称	国富大中华精选混合(QDII)
基金主代码	000934
交易代码	000934
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2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	中国农业银行
报告期末基金份额总额	1,407,868,893.97份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极进行资产配置和组合管理，投资于大中华地区证券市场 and 海外证券市场发行的大中华企业，以力争获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将根据宏观大势进行资产配置调整，通过对全球宏观经济状况、区域经济发展情况、证券市场走势、政策法规影响、市场情绪等综合分析，调整基金在股票、债券等资产类别上的投资比例，以降低投资风险，提高收益；在区域配置上，本基金主要投资于大中华地区，通过对国家或区域的经济发展趋势、财政政策、货币政策、就业状况及市场估值水平变化等方面进行深入研究和比较分析的基础上，确定投资区域的权重；在股票投资上，本基金将采用“自下而上”的选股策略，通过对企业基本面的分析和研究，挖掘基本面良好、具有较强竞争力和持续成长能力的上市公司作为投资方向；在债券投资上，本基金采取久期调整、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，构建债券组合。 本基金也可进行新股申购及金融衍生品的投资。
业绩比较基准	MSCI 金龙净总收益指数 (MSCI Golden Dragon Net Total Return Index) X 60% + 同期人民币一年期定期存款利率（税后）X 40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中风险收益特征的证券投资基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国海富兰克林基金管理有限公司	中国农业银行
信息披露 负责人	姓名	储丽莉	秦一楠
	联系电话	021-3855 5555	010-66060069

	电子邮箱	service@ftsfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555	95599
传真		021-6888 3050	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		吴显玲	谷澍

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Bank of New York Mellon
	中文	-	纽约梅隆银行股份有限公司
注册地址		-	240 Greenwich St, New York, New York 10286 USA
办公地址		-	240 Greenwich St, New York, New York 10286 USA
邮政编码		-	10286

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	-25,476,862.84	330,885,127.27	76,632,334.77
本期利润	-308,173,776.63	451,813,957.21	126,240,691.29
加权平均基金份额本期利润	-0.2348	1.0367	0.4521
本期加权平均净值利润率	-8.59%	50.00%	33.26%
本期基金份额净值增长率	-2.07%	63.18%	37.48%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	1,334,724,739.59	625,141,424.70	55,344,687.50
期末可供分配基金份额利润	0.9480	0.9205	0.1554
期末基金资产净值	3,532,170,546.80	1,739,710,196.45	559,190,825.95
期末基金份额净值	2.509	2.562	1.570
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	150.90%	156.20%	57.00%

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—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。

5. 上述“期末基金份额净值”为人民币份额的基金份额净值，报告期末美元份额的基金份额

净值为 0.3935 美元。

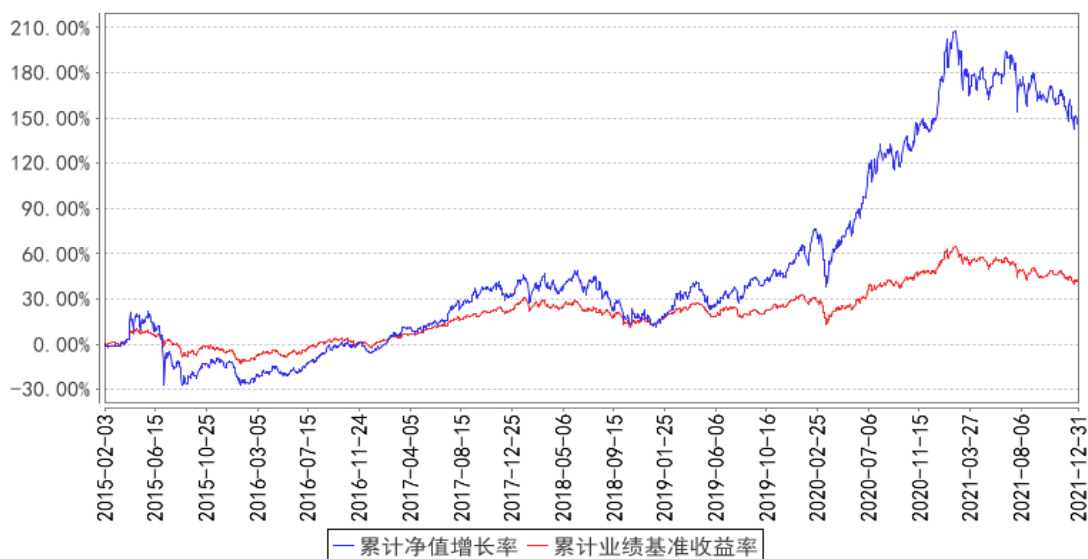
3.2 基金净值表现

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

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
过去三个月	-5.68%	1.13%	-1.09%	0.53%	-4.59%	0.60%
过去六个月	-14.46%	1.39%	-8.89%	0.70%	-5.57%	0.69%
过去一年	-2.07%	1.43%	-5.01%	0.72%	2.94%	0.71%
过去三年	119.70%	1.42%	25.65%	0.72%	94.05%	0.70%
过去五年	162.45%	1.33%	43.99%	0.67%	118.46%	0.66%
自基金合同生效起至今	150.90%	1.52%	43.07%	0.67%	107.83%	0.85%

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

国富大中华精选混合(QDII) 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

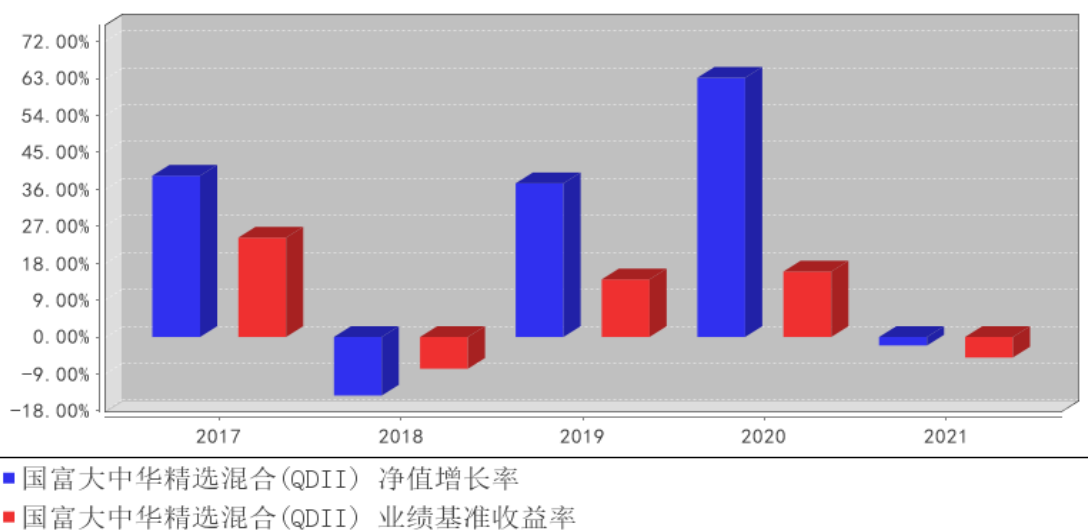


注：

1. 本基金的基金合同生效日为 2015 年 2 月 3 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。
2. 以上收益率折算为人民币计算。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国富大中华精选混合(QDII) 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	年度利润分配合 计	备注
2021	-	-	-	-	
2020	-	-	-	-	
2019	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

§ 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 年末，公司旗下合计管理 38 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		
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	2015 年 12 月 24 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。

	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 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《富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司建立了《公平交易管理制度》，确保公司旗下投资组合能够得到公平对待，避免各种投资组合之间的利益输送行为。我们主要从如下几个方面对公平交易进行控制：

1. 在研究信息共享方面，投资研究等部门通过定期的例会沟通机制，就相关议题进行讨论；公司建立了统一的研究平台，研究报告信息通过研究平台进行发布。
2. 建立投资对象备选库，股票及债券的入库需要由研究报告支持作为依据，并经过相关领导审批；建立研究报告的定期更新机制。
3. 在投资决策方面，公司在各类资产管理业务之间建立防火墙，确保业务隔离及人员隔离，同时各投资组合经理投资决策保持独立。
4. 公司对所有投资组合的交易指令实行集中交易，公司在交易系统中设置公平交易功能，按照时间优先、价格优先的原则执行各账户所有指令；公司建立和完善了对债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易分配制度，以确保相关投资组合能够得到公平对待。

5. 公司建立了《同日反向交易管理办法》，通过事前审批来对反向交易进行事前控制。公司每季度对不同时间窗下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。

6. 公司定期对公平交易执行情况进行监察稽核，并在监察稽核定期报告中做专项说明。公司也会在各投资组合的定期报告中，披露公平交易制度执行情况及异常交易行为专项说明。

4.3.2 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。

报告期末，公司共管理了三十八只公募基金及七只专户产品。统计所有投资组合分投资类别（股票、债券）过去连续 4 个季度内在不同时间窗口（T=1、T=3 和 T=5）存在同向交易价差的样本，并对差价率均值、交易价格占优比率、t 值、贡献率等指标进行分析，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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司按照《异常交易监控与报告制度》，系统划分了异常交易的类型、异常交易的界定标准、异常交易的识别程序，制订了异常交易的监控办法，并规范了异常交易的分析、报告制度。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，公司不同投资组合之间未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，经公司检查和分析未发现异常情况。

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

以大盘指数看，2021 年的海外市场相对比较健康。美股三大股指都实现了双位数的增长。但以过程来看，美股去年一整年都比较跌宕起伏，而且标志性的事件比较多。例如：一月份的散户与机构博弈，散户逼空华尔街对冲基金；三月份上演了某知名对冲基金因为高杠杆运作和集中持仓，然后股价下跌导致头寸爆仓，触发中概股第一轮暴跌；另外，通胀预期以及美债收益率升高又屡次打击成长股，使得我们比较熟悉的一些科技龙头成长股在某几个单月经历一次比较大的调整。积极的方面有：流动性充裕，参与者众多，热点层出不穷等。 港股市场方面，去年伊始，在“港股便宜”的普遍认知下，境外热钱以及南下资金大量涌入港股市场，很多受追捧的热门板块，估值过热，我们看到从二月底开始，港股以科技与医药为首的热门板块开始显著回调，随后教育、互联网，房地产等板块也先后调整，导致全年港股在低迷中找底。我们关注的主要市场，美国纳斯达克综合指数全年上涨 21.39%；标普 500 全年上涨 26.89%；港股恒生指数全年下跌 14.08%，恒生科技指数全年下跌 32.70%。

我们对海外市场始终保持一颗敬畏心，每一只持仓基本上都是自下而上的选择，每一个个股都需要有一个良好的能见度以及合理的估值水平。我们并没有刻意去选择国别和市场，比如港股不景气就一股脑跑去美股，而美股要加息又把持仓挪移回来。我们认为，长期看，股价的驱动还是在于企业的竞争力与未来的增长确定性，简而言之，好公司是可以穿越牛熊的。同时，我们认为每一轮市场波动都赋予我们好机会：以合理价格买到优质资产。从去年整年来看，年初，我们把持仓逐渐从疫情受益股转入到主营业务来自于线下的科技股，比如汽车电子，模拟类半导体等。年中，我们在组合中降低了恒生大型科技股的权重，布局了一些具备爆发式增长潜力的中小型科技公司。第四季度后，我们在 Omicron 第一波袭来后做了减仓动作，但在月中美联储宣布加息点阵图后，没有进一步降仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金人民币份额净值为 2.509 元，本报告期基金份额下跌 2.07%，业绩比较基准收益率下跌 5.01%，跑赢业绩比较基准 2.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期看海外美股市场，我们认为在没有更多消息使得货币政策变得更清晰前，市场可能进入一个“无所适从期”，缺乏明显趋势，可能在大幅波动中盘整修复，蓄势待发。一月中开始，美股市场已经进入为期一个月左右的业绩期，大型科技股公司也会逐渐给出 2022 年的大致指引，这也将成为主导市场走势的主要因素。看估值的话，标普 500 未来十二月的本益比（NTM P/E）目前在 20X 不到，从过去 10 年历史维度看是高于一个标准差的，不算便宜。但结合最近几年的市场流动性，我们认为 20X 这个估值还是可以接受的，不便宜但绝对不算贵的离谱。

但从长期维度看，无论联储如何调整它的货币政策，政府推出何种税收和刺激法案，有一点是确定且不可逆的：科技在持续改造我们的世界，创新在每个领域发生。科技进步和经济发展是单行道。同时人口、GDP 的增长和货币供应量增长也是确定向上，基于此，我们对未来的投资仍然充满信心。

当然，市场波动明显加大之际，我们更加强调“安全边际”，我们会谨慎检视每一个个股的持仓，包括行业，公司短期业绩，公司中期能见度，以及公司的估值，我们认为我们的组合并未出现明显的高估个股，组合的整体估值与分散性保持良好，因此我们比较有信心去对抗市场的波动与短期的回撤。我们的选择可能与热门行业，热门股票大相径庭，因为我们还是希望从成长性，确定性的角度在全球范围内寻找更多 alpha 机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，严格开展对基金相关法律文件和对外宣传资料的合规审核，积极加强对各部门、各主要运作环节的风险监控，并通过定期稽核和专项稽核，及时发现需要完善的业务环节，并落实措施。报告期内，本基金管理人特别关注基金投资研究交易、市场销售以及运营的合法合规和风险控制，对保护投资者利益涉及的各项业务环节以及信息技术安全开展了专项自查和采取控制措施。同时，本基金管理人开展多层次的员工合规教育和日常提示等措施，强化员工风控意识，努力营造合规经营文化。此外，本基金管理人依照规定，及时向董事会报送监察稽核报告。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将继续深入分析和识别市场变化和潜在风险，积极采取措施，加强事前、事中和事后的内部控制，提高监察稽核工作的科学性和有效性。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国海富兰克林基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，国海富兰克林基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国海富兰克林基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 23106 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金(以下简称“国富大中华混合基金(QDII)”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了国富大中华混合基金(QDII)2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国富大中华混合基金(QDII),并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>国富大中华混合基金(QDII)的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估国富大中华混合基金(QDII)的持续经营能力,披露与持续经营相关的事</p>

	<p>项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算国富大中华混合基金(QDII)、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国富大中华混合基金(QDII)的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对国富大中华混合基金(QDII)持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国富大中华混合基金(QDII)不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞 张晓阳
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	261,627,917.59	151,473,676.32
结算备付金		788,806.53	486,777.29
存出保证金		221,307.45	184,269.70
交易性金融资产	7.4.7.2	3,297,945,999.92	1,516,269,380.55
其中：股票投资		3,159,338,875.32	1,516,158,733.95
基金投资		-	-
债券投资		138,607,124.60	110,646.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		339,128.51	69,335,931.43
应收利息	7.4.7.5	3,161,538.00	9,035.37
应收股利		1,045,092.00	508,616.14
应收申购款		-	38,037,929.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	3,569,417.01	107,000,182.50
资产总计		3,568,699,207.01	1,883,305,798.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,569,823.87	6,497,071.82
应付赎回款		21,929,640.30	27,177,154.88
应付管理人报酬		4,440,857.21	1,945,619.78
应付托管费		799,354.30	350,211.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,902,971.23	362,109.83
应交税费		2.12	0.34
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	3,886,011.18	107,263,434.14
负债合计		36,528,660.21	143,595,602.35
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,407,868,893.97	679,101,600.97
未分配利润	7.4.7.10	2,124,301,652.83	1,060,608,595.48
所有者权益合计		3,532,170,546.80	1,739,710,196.45
负债和所有者权益总计		3,568,699,207.01	1,883,305,798.80

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,407,868,893.97 份，其中国富大中华精选混合基金人民币份额 1,334,545,015.75 份，份额净值人民币 2.509 元；国富大中华精选混合基金美元份额为 73,323,878.22 份，份额净值美元 0.3935 元。

7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		-201,716,905.04	489,157,076.08
1. 利息收入		5,920,017.62	287,307.30
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,129,500.80	281,323.69
债券利息收入		3,365,459.38	5,983.61
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		425,057.44	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		68,845,007.00	370,408,032.28
其中：股票投资收益	7.4.7.12	29,629,292.45	356,027,730.14
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-588,901.62	384,796.65
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	39,804,616.17	13,995,505.49
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-282,696,913.79	120,928,829.94

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		19,665.20	-5,190,319.11
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	6,195,318.93	2,723,225.67
减：二、费用		106,456,871.59	37,343,118.87
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	53,833,752.58	13,384,548.76
2. 托管费	7.4.10.2.2	9,690,075.47	2,409,218.72
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	42,465,504.21	21,202,193.21
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.27	0.44
7. 其他费用	7.4.7.20	467,539.06	347,157.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-308,173,776.63	451,813,957.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-308,173,776.63	451,813,957.21

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	679,101,600.97	1,060,608,595.48	1,739,710,196.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-308,173,776.63	-308,173,776.63
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）	728,767,293.00	1,371,866,833.98	2,100,634,126.98
其中：1. 基金申购款	1,622,195,712.07	2,939,699,236.32	4,561,894,948.39
2. 基金赎回款	-893,428,419.07	-1,567,832,402.34	-2,461,260,821.41

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,407,868,893.97	2,124,301,652.83	3,532,170,546.80
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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）	356,114,069.22	203,076,756.73	559,190,825.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	451,813,957.21	451,813,957.21
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）	322,987,531.75	405,717,881.54	728,705,413.29
其中：1. 基金申购款	624,895,141.73	726,577,047.05	1,351,472,188.78
2. 基金赎回款	-301,907,609.98	-320,859,165.51	-622,766,775.49
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）	679,101,600.97	1,060,608,595.48	1,739,710,196.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金(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”)证监许可字[2014]第 1236 号《关于准予富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金注册的批复》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《富兰克林国海大中华精选混合型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 330,173,165.87 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 110 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 330,232,755.09 份,其中认购资金利息折合 59,589.22 份基金份额,划入基金份额持有人账户。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司,境外托管人为纽约梅隆银行股份有限公司。

根据《国海富兰克林基金管理有限公司关于富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金增设美元份额相关事项的公告》,自 2019 年 4 月 15 日起,本基金进行份额分类,原有基金份额归为人民币份额,同时增设美元份额。根据《富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金根据申购、赎回所使用货币的不同,将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额类别,称为人民币份额;以美元计价并进行申购、赎回的份额类别,称为美元份额。本基金对人民币份额和美元份额分别设置代码,人民币份额和美元份额合并投资运作,共同承担投资换汇产生的费用。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为:银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(含交易型开放式指数基金 ETF);与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品;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的相关

要求)。本基金主要投资于大中华地区证券市场和在其他证券市场发行的“大中华企业”股票、存托凭证、债券和衍生品等。“大中华地区证券市场”为中国证监会允许投资的香港、台湾和中国内地证券市场等。“大中华企业”是指满足以下三个条件之一的上市公司：1) 上市公司注册在大中华地区(中国内地、香港、台湾、澳门)；2) 上市公司中至少百分之五十之营业额、盈利、资产、或制造活动来自大中华地区；3) 控股公司，其子公司的注册办公室在大中华地区，且主要业务活动亦在大中华地区。本基金的投资组合比例为：股票等权益类资产投资比例为基金资产的 40%-95%，债券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具投资比例为基金资产的 5%-60%，其中，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的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于大中华地区证券市场和在其他证券市场发行的“大中华企业”的资产不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：MSCI 金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)X60%+同期人民币一年期定期存款利率(税后)X40%。

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 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 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》、《富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金基金合同》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相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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(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、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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或资产支持证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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下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扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额

持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定境内市场以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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14号—收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》及其他相关境内外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) 对基金从境内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。

目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 对基金在境内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。对基金在境内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。对基金在境内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。

目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 基金在境内卖出股票按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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	261,627,917.59	151,473,676.32
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计	261,627,917.59	151,473,676.32

注：于 2021 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 163,248,031.07 元，美元活期存款 6,296,599.81 元(折合人民币 40,145,231.41 元)，新台币活期存款 252,742,623.00 元(折合人民币 58,234,655.11 元)。注：于 2020 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 36,104,559.21 元，美元活期存款 17,623,440.99 元(折合人民币 114,991,190.12 元)，新台币活期存款 1,627,283.00 元(折合人民币 377,926.99 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,279,184,966.63	3,159,338,875.32	-119,846,091.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	138,681,433.90	138,607,124.60
	银行间市场	-	-
	合计	138,681,433.90	138,607,124.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,417,866,400.53	3,297,945,999.92	-119,920,400.61
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,353,405,867.37	1,516,158,733.95	162,752,866.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	87,000.00	110,646.60
	银行间市场	-	-
	合计	87,000.00	110,646.60

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,353,492,867.37	1,516,269,380.55	162,776,513.18

注：于 2021 年 12 月 31 日股票投资包含了存托凭证(2020 年 12 月 31 日：同)。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	41,523.14	8,398.30
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	2,662.80	241.01
应收债券利息	3,115,120.76	11.25
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	775.87	293.62
其他	1,455.43	91.19
合计	3,161,538.00	9,035.37

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
其他应收款	3,569,417.01	107,000,182.50
待摊费用	-	-
合计	3,569,417.01	107,000,182.50

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,902,971.23	362,109.83
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	1,902,971.23	362,109.83
----	--------------	------------

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	71,010.18	39,678.74
审计费用	120,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
债券账户维护费	4,500.00	4,500.00
应付未起息外汇交易	3,570,501.00	107,009,255.40
合计	3,886,011.18	107,263,434.14

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	679,101,600.97	679,101,600.97
本期申购	1,622,195,712.07	1,622,195,712.07
本期赎回（以“-”号填列）	-893,428,419.07	-893,428,419.07
本期末	1,407,868,893.97	1,407,868,893.97

7.4.7.10 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	625,141,424.70	435,467,170.78	1,060,608,595.48
本期利润	-25,476,862.84	-282,696,913.79	-308,173,776.63
本期基金份额交易产生的变动数	735,060,177.73	636,806,656.25	1,371,866,833.98
其中：基金申购款	1,614,858,203.52	1,324,841,032.80	2,939,699,236.32
基金赎回款	-879,798,025.79	-688,034,376.55	-1,567,832,402.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,334,724,739.59	789,576,913.24	2,124,301,652.83

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	1,634,934.67	267,656.99
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	440,904.95	9,154.04
其他	53,661.18	4,512.66
合计	2,129,500.80	281,323.69

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	11,288,591,619.26	5,087,859,494.54
减：卖出股票成本总额	11,258,962,326.81	4,731,831,764.40
买卖股票差价收入	29,629,292.45	356,027,730.14

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	-588,901.62	384,796.65
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	-588,901.62	384,796.65

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	156,051,149.20	7,050,411.70
减：卖出债券（债转股及	152,259,717.70	6,531,598.50

债券到期兑付)成本总额		
减: 应收利息总额	4,380,333.12	134,016.55
买卖债券差价收入	-588,901.62	384,796.65

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	39,804,616.17	13,995,505.49
合计	39,804,616.17	13,995,505.49

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-282,696,913.79	120,928,829.94
股票投资	-282,598,957.89	120,905,763.04
债券投资	-97,955.90	23,066.90
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	-	-
合计	-282,696,913.79	120,928,829.94

注: 本基金本年度股票投资公允价值变动收益包含存托凭证公允价值变动收益(2020年度: 同)。

7.4.7.17 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	6,195,076.56	2,723,225.67
其他收入	242.37	-
合计	6,195,318.93	2,723,225.67

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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	42,465,504.21	21,202,193.21
银行间市场交易费用	-	-
合计	42,465,504.21	21,202,193.21

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	120,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
银行汇划费用	34,418.16	32,429.35
台湾税务顾问费-USD	-	21,714.21
律师费	2,300.00	2,500.00
账户维护费	18,000.00	19,500.00
其他费用	172,820.90	61,014.18
合计	467,539.06	347,157.74

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
纽约梅隆银行股份有限公司 (The Bank of New York Mellon Corporation)	基金境外资产托管人
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
邓普顿国际股份有限公司 (Templeton International, Inc.)	基金管理人的股东
国海富兰克林资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	151,505,663.49	0.62	-	-

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31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	121,204.50	0.57	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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 (%)
-	-	-	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	53,833,752.58	13,384,548.76
其中：支付销售机构的客户维护费	18,125,835.01	2,761,759.55

注：支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	9,690,075.47	2,409,218.72

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.27% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.27\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

基金合同生效日（2015 年 2 月 3 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	5,811,313.44	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,811,313.44	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.41%	-

注：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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
纽约梅隆银行股份有限公司	97,064,130.31	11,543.16	109,967,066.27	18,138.53
中国农业银行	164,563,787.28	1,623,391.51	41,506,610.05	249,518.46

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国农业银行和境外资产托管人纽约梅隆银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688779	长远锂科	2021 年 08 月 03 日	2022 年 02 月 11 日	新股锁定	5.65	22.86	43,086	243,435.90	984,945.96	-
688176	亚虹医药	2021 年 12 月 29 日	2022 年 01 月 07 日	新股未上市	22.98	22.98	37,990	873,010.20	873,010.20	-
688707	振华新材	2021 年 09 月 06 日	2022 年 03 月 14 日	新股锁定	11.75	47.16	8,130	95,527.50	383,410.80	-
688167	炬光科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 06 月 24 日	新股锁定	78.69	176.67	2,014	158,481.66	355,813.38	-
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 01 月 06 日	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688733	壹石通	2021 年 08 月 10 日	2022 年 02 月 17 日	新股锁定	15.49	75.36	3,409	52,805.41	256,902.24	-
301155	海力风电	2021 年 11 月 17 日	2022 年 05 月 24 日	新股锁定	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-
301177	迪阿股份	2021 年 12 月 08 日	2022 年 06 月 15 日	新股锁定	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 11 日	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-

301050	雷电微力	2021年08月17日	2022年02月24日	新股锁定	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301035	润丰股份	2021年07月21日	2022年01月28日	新股锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301039	中集车辆	2021年07月01日	2022年01月10日	新股锁定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301058	中粮工科	2021年09月01日	2022年03月09日	新股锁定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年06月22日	新股锁定	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年06月28日	新股锁定	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年06月28日	新股锁定	86.06	94.5	253	21,773.18	23,908.50	-
301069	凯盛新材	2021年09月16日	2022年03月28日	新股锁定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年06月20日	新股锁定	79.6	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
300994	久祺股份	2021年08月02日	2022年02月14日	新股锁定	11.9	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年06月17日	新股锁定	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-

301060	兰卫医学	2021年09月06日	2022年03月14日	新股锁定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301101	明月镜片	2021年12月09日	2022年06月16日	新股锁定	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年06月24日	新股锁定	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年06月06日	新股锁定	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301179	泽宇智能	2021年12月01日	2022年06月08日	新股锁定	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301046	能辉科技	2021年08月10日	2022年02月17日	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年06月07日	新股锁定	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2022年01月05日	新股锁定	8.86	23.8	555	4,917.30	13,209.00	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年06月07日	新股锁定	29.28	32	402	11,770.56	12,864.00	-
301020	密封科技	2021年06月28日	2022年01月06日	新股锁定	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301026	浩通科技	2021年07月08日	2022年01月17日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-

301021	英诺激光	2021年06月28日	2022年01月06日	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301048	金鹰重工	2021年08月11日	2022年02月28日	新股锁定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301028	东亚机械	2021年07月12日	2022年01月20日	新股锁定	5.31	13.5	733	3,892.23	9,895.50	-
300774	倍杰特	2021年07月26日	2022年02月16日	新股锁定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301078	孩子王	2021年09月30日	2022年04月14日	新股锁定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年06月23日	新股锁定	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301062	上海艾录	2021年09月07日	2022年03月14日	新股锁定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301052	果麦文化	2021年08月23日	2022年02月28日	新股锁定	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301025	读客文化	2021年07月06日	2022年01月24日	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301066	万事利	2021年09月13日	2022年03月22日	新股锁定	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
300814	中富电路	2021年08月04日	2022年02月14日	新股锁定	8.4	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-

301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年05月26日	新股锁定	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年06月02日	新股锁定	21.76	29.2	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021年07月15日	2022年01月24日	新股锁定	6.1	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年04月20日	新股锁定	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301033	迈普医学	2021年07月15日	2022年01月26日	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021年08月17日	2022年02月24日	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021年07月15日	2022年01月24日	新股锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021年08月27日	2022年03月07日	新股锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021年07月21日	2022年02月16日	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021年08月02日	2022年02月11日	新股锁定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021年09月22日	2022年03月29日	新股锁定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-

301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年04月21日	新股锁定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
300854	中兰环保	2021年09月08日	2022年03月16日	新股锁定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021年09月09日	2022年03月24日	新股锁定	17.4	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年01月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021年07月22日	2022年02月07日	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021年09月03日	2022年03月14日	新股锁定	8.09	19.3	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021年07月08日	2022年01月19日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021年07月21日	2022年02月07日	新股锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021年09月22日	2022年03月30日	新股锁定	12.24	32	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021年08月25日	2022年03月01日	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆新材	2021年08月31日	2022年03月09日	新股锁定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-

301068	大地海洋	2021 年 09 月 16 日	2022 年 03 月 28 日	新股锁定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 04 月 19 日	新股锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021 年 12 月 29 日	2022 年 01 月 14 日	新债未上市	100.00	100.00	29,570	2,957,000.00	2,957,000.00	-

注：

1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中风险收益特征的证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金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，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。

7.4.13.2 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农业银行和境外托管人纽约梅隆银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境内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，在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

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 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 0.08%(2020 年 12 月 31 日：0.01%)。

7.4.13.3 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 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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 7.4.12。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 2021 年 12 月 31 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 2021 年 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、债券投资和应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	261,627,917.59	-	-	-	261,627,917.59
结算备付金	788,806.53	-	-	-	788,806.53
存出保证金	221,307.45	-	-	-	221,307.45
交易性金融资产	135,650,124.60	-	2,957,000.00	3,159,338,875.32	3,297,945,999.92
应收利息	-	-	-	3,161,538.00	3,161,538.00
应收股利	-	-	-	1,045,092.00	1,045,092.00
应收证券清算款	-	-	-	339,128.51	339,128.51
其他资产	-	-	-	3,569,417.01	3,569,417.01
资产总计	398,288,156.17	-	2,957,000.00	3,167,454,050.84	3,568,699,207.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,929,640.30	21,929,640.30
应付管理人报酬	-	-	-	4,440,857.21	4,440,857.21
应付托管费	-	-	-	799,354.30	799,354.30
应付证券清算款	-	-	-	3,569,823.87	3,569,823.87
应付交易费用	-	-	-	1,902,971.23	1,902,971.23
应交税费	-	-	-	2.12	2.12
其他负债	-	-	-	3,886,011.18	3,886,011.18
负债总计	-	-	-	36,528,660.21	36,528,660.21
利率敏感度缺口	398,288,156.17	-	2,957,000.00	3,130,925,390.63	3,532,170,546.80
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	151,095,749.33	-	-	377,926.99	151,473,676.32
结算备付金	486,777.29	-	-	-	486,777.29
存出保证金	184,269.70	-	-	-	184,269.70
交易性金融资产	-	-	110,646.60	1,516,158,733.95	1,516,269,380.55
应收利息	-	-	-	9,035.37	9,035.37
应收股利	-	-	-	508,616.14	508,616.14
应收申购款	694.05	-	-	38,037,235.45	38,037,929.50
应收证券清算款	-	-	-	69,335,931.43	69,335,931.43
其他资产	-	-	-	107,000,182.50	107,000,182.50
资产总计	151,767,490.37	-	110,646.60	1,731,427,661.83	1,883,305,798.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	27,177,154.88	27,177,154.88
应付管理人报酬	-	-	-	1,945,619.78	1,945,619.78

应付托管费	-	-	-	350,211.56	350,211.56
应付证券清算款	-	-	-	6,497,071.82	6,497,071.82
应付交易费用	-	-	-	362,109.83	362,109.83
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	107,263,434.14	107,263,434.14
负债总计	-	-	-	143,595,602.35	143,595,602.35
利率敏感度缺口	151,767,490.37	-	110,646.60	1,587,832,059.48	1,739,710,196.45

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 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 3.92% (2020 年 12 月 31 日：0.01%)，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)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	40,145,23 1.41	-	58,234,655.11	98,379,886.52
交易性金融资 产	441,180,3 51.89	2,293,198,638. 25	92,704,268.39	2,827,083,258.53
应收股利	-	1,045,092.00	-	1,045,092.00
应收利息	5.36	-	-	5.36
其它资产	-	3,569,417.01	-	3,569,417.01

资产合计	481,325,588.66	2,297,813,147.26	150,938,923.50	2,930,077,659.42
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	3,569,417.01	-	3,569,417.01
应付赎回款	721,774.19	-	-	721,774.19
其他负债	3,572,940.94	-0.02	-	3,572,940.92
负债合计	4,294,715.13	3,569,416.99	-	7,864,132.12
资产负债表外汇风险敞口净额	477,030,873.53	2,294,243,730.27	150,938,923.50	2,922,213,527.30
	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
项目	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	114,991,190.12	-	377,926.99	115,369,117.11
交易性金融资产	196,522,055.03	1,050,675,782.81	74,400,535.15	1,321,598,372.99
应收股利	119,219.58	389,396.56	-	508,616.14
应收利息	9.20	-	-	9.20
应收证券清算款	-	66,943,970.26	-	66,943,970.26
应收申购款	1,562,070.00	-	-	1,562,070.00
其他资产	86,966,168.86	20,034,013.64	-	107,000,182.50

资产合计	400,160,712.79	1,138,043,163.27	74,778,462.14	1,612,982,338.20
以外币计价的负债				
应付证券清算款	6,497,071.82	-	-	6,497,071.82
应付赎回款	3,693,261.48	-	-	3,693,261.48
其他负债	20,040,034.08	86,977,983.87	-	107,018,017.95
负债合计	30,230,367.38	86,977,983.87	-	117,208,351.25
资产负债表外汇风险敞口净额	369,930,345.41	1,051,065,179.40	74,778,462.14	1,495,773,986.95

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	增加约 14,606	增加约 7,479
	所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 14,606	减少约 7,479

7.4.13.4.3 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。本基金股票等权益类资产投资比例为基金资产的 40%-95%，债券、货币市场工具、现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具投资比例为 5%-60%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	3,159,338,875.32	89.44	1,516,158,733.95	87.15
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,159,338,875.32	89.44	1,516,158,733.95	87.15

7.4.13.4.3.2 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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月	

			31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	增加约 30,105	增加约 15,135
	业绩比较基准下降 5%	减少约 30,105	减少约 15,135

7.4.14 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 12 月 31 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 3,155,219,147.09 元，属于第二层次的余额为 139,860,364.15 元，属于第三层次的余额为 2,866,488.68 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次 1,501,327,470.55 元，第二层次 14,941,910.00 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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具 2,866,488.68 元(2020 年 12 月 31 日：无)。于 2021 年度，本基金购买第三层次金融工具 1,054,639.13 元(2020 年度：无)，计入当期损益的利得或损失(公允价值变动损益等项目)的金额为 1,811,849.55 元(2020

年度：无)，2021 年 12 月 31 日仍持有的第三层次金融工具计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动金额（公允价值变动损益）为 1,811,849.55 元（2020 年度：无）。

于 2021 年 12 月 31 日，上述第三层次金融工具均为股票投资，公允价值为 2,866,488.68 元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 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) 根据财政部发布的《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》和《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”）相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项

§ 8 投资组合报告

8.1 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	3,159,338,875.32	88.53
	其中：普通股	2,982,200,315.69	83.57
	存托凭证	177,138,559.63	4.96
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	138,607,124.60	3.88
	其中：债券	138,607,124.60	3.88
	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	262,416,724.12	7.35
8	其他各项资产	8,336,482.97	0.23
9	合计	3,568,699,207.01	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	2,293,198,638.25	64.92
美国	441,180,351.89	12.49
中国	332,255,616.79	9.41
中国台湾	63,970,130.08	1.81
新加坡	28,734,138.31	0.81
合计	3,159,338,875.32	89.44

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。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
电信业务	-	-

消费者非必需品	779,699,255.86	22.07
消费者常用品	54,949,093.19	1.56
能源	-	-
金融	218,776,280.18	6.19
医疗保健	257,734,229.57	7.30
工业	240,950,130.09	6.82
信息技术	787,040,356.60	22.28
原材料	101,410,262.30	2.87
房地产	394,378,002.03	11.17
公共事业	324,401,265.50	9.18
合计	3,159,338,875.32	89.44

注：以上分类采用 GICS 行业分类标准。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

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	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	353,400	131,987,718.91	3.74
2	China Resources Power Holdings Co. Ltd.	华润电力	836 H K	香港联合交易所	中国香港	6,000,000	128,036,160.00	3.62
3	China Datang Corporation Renewable Power Co., Limited	大唐新能源	1798 HK	香港联合交易所	中国香港	41,861,500	122,871,205.02	3.48
4	Man Wah Holdings Limited	敏华控股	1999 HK	香港联合交易所	中国香港	11,598,000	114,548,899.58	3.24
5	I-Mab	天境生物	IMAB US	纳斯达克	美国	357,964	108,156,826.23	3.06
6	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	金蝶国际	268 H K	香港联合交易所	中国香港	5,230,000	102,625,152.00	2.91
7	China Resources Land L	华润置	1109	香港联	中国香	3,800	101,905	2.

	imited	地	HK	合交易 所	港	,000	,664.00	89
8	Kingsoft Corporation Limited	金山软件	3888 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	3,366 ,000	94,257, 424.80	2. 67
9	Byd Company Limited	比亚迪 股份	1211 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	422,0 00	91,984, 251.52	2. 60
10	Longfor Group Holdings Limited	龙湖集 团	960 H K	香港联 合交易 所	中国香 港	2,779 ,500	83,401, 454.64	2. 36
11	Country Garden Services Holdings Company Limited	碧桂园 服务	6098 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	2,100 ,000	80,182, 032.00	2. 27
12	Meituan	美团	3690 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	430,0 00	79,243, 427.20	2. 24
13	China Longyuan Power Group Corporation Limited	龙源电 力	916 H K	香港联 合交易 所	中国香 港	4,939 ,000	73,493, 900.48	2. 08
14	Jinkosolar Holding Co., Ltd.	晶科能 源	JKS U S	纽约证 券交易 所	美国	239,7 00	70,238, 613.13	1. 99
15	Fuyao Glass Industry Group Co.,Ltd.	福耀玻 璃	3606 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	1,971 ,600	64,962, 800.45	1. 84
16	Wiwynn Corporation	纬颖	6669 TT	台湾证 券交易 所	中国台 湾	249,0 00	63,970, 130.08	1. 81
17	Jd.Com, Inc.	京东	JD UW	纳斯达 克	美国	141,4 00	63,169, 785.28	1. 79
18	Akeso, Inc.	康方生 物	9926 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	2,122 ,000	58,988, 204.80	1. 67
19	Samsonite International S.A.	新秀丽	1910 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	4,395 ,300	56,922, 580.92	1. 61
20	Greentown Service Group Co. Ltd.	绿城服 务	2869 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	9,638 ,000	56,736, 207.36	1. 61
21	Li Auto Inc.	理想汽 车	2015 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	562,1 00	56,389, 602.19	1. 60
22	Sunny Optical Technolog	舜宇光	2382	香港联	中国香	279,2	56,292,	1.

2	y (Group) Company Limited	学科技	HK	合交易 所	港	00	348.67	59
2	Xpeng Inc.	小鹏汽车	9868 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	368,0 00	56,053, 347.84	1. 59
2	Zhejiang Nuhu Company Ltd.	新和成	002001	深圳证 券交易 所	中国	1,728 ,089	53,778, 129.68	1. 52
2	Rambus Inc	蓝博士 半导体	RMBS US	纳斯达 克	美国	280,0 00	52,466, 910.44	1. 49
2	Aia Group Limited	友邦保 险	1299 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	800,0 00	51,410, 688.00	1. 46
2	Sailun Group Co.,Ltd.	赛轮轮 胎	601058	上海证 券交易 所	中国	3,332 ,519	49,287, 956.01	1. 40
2	Postal Savings Bank Of China Co.,Ltd.	邮储银 行	1658 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	11,00 0,000	49,194, 992.00	1. 39
2	Cowell E Holdings Inc.	高伟电 子	1415 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	4,547 ,000	48,849, 621.41	1. 38
3	China Overseas Land & Investment Ltd.	中国海 外发展	688 H K	香港联 合交易 所	中国香 港	3,070 ,000	46,335, 190.72	1. 31
3	Hangzhou Robam Appliance Co.,Ltd.	老板电 器	002508	深圳证 券交易 所	中国	1,200 ,000	43,224, 000.00	1. 22
3	Weichai Power Co.,Ltd.	潍柴动 力	000338	深圳证 券交易 所	中国	2,410 ,580	43,125, 276.20	1. 22
3	Beijing New Building Materials Public Limited Company	北新建 材	000786	深圳证 券交易 所	中国	1,200 ,000	42,996, 000.00	1. 22
3	Boc Aviation Limited	中银航 空租赁	2588 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	920,0 00	42,950, 163.20	1. 22
3	Lumentum Holdings Inc.	LUMENT UM	LITE US	纳斯达 克	美国	63,00 0	42,484, 540.71	1. 20
3	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co.,Ltd.	东方雨 虹	002271	深圳证 券交易 所	中国	799,9 75	42,142, 683.00	1. 19
3	Zhou Hei Ya International	周黑鸭	1458	香港联	中国香	8,688	41,769,	1.

7	nal Holdings Company Limited		HK	合交易所	港	,500	859.49	18
38	Bank Of Ningbo Co.,Ltd	宁波银行	002142	深圳证券交易所	中国	1,000,094	38,283,598.32	1.08
39	Hainan Meilan International Airport Company Limited	美兰空港	357 HK	香港联合交易所	中国香港	1,875,000	36,868,650.00	1.04
40	Nvidia Corp	英伟达	NVDA US	纳斯达克	美国	17,500	32,815,249.72	0.93
41	Xiaomi Corporation	小米集团	1810 HK	香港联合交易所	中国香港	2,120,000	32,759,596.80	0.93
42	Li Ning Co. Ltd.	李宁	2331 HK	香港联合交易所	中国香港	458,000	31,960,229.28	0.90
43	Gf Securities Co.,Ltd.	广发证券	1776 HK	香港联合交易所	中国香港	2,500,000	30,373,840.00	0.86
44	Morimatsu International Holdings Company Limited	森松国际	2155 HK	香港联合交易所	中国香港	4,123,000	30,170,134.96	0.85
45	Remegen Co., Ltd.	荣昌生物	9995 HK	香港联合交易所	中国香港	465,500	29,648,179.12	0.84
46	Orient Securities Company Limited	东方证券	3958 HK	香港联合交易所	中国香港	5,433,600	29,587,125.66	0.84
47	Kuaishou Technology	快手	1024 HK	香港联合交易所	中国香港	500,000	29,454,040.00	0.83
48	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	扬子江船业	YZJSGD SP	新加坡证券交易所	新加坡	4,534,400	28,734,138.31	0.81
49	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX US	纳斯达克	美国	20,800	28,118,265.16	0.80
50	Sinotruk (Hong Kong) Limited	中国重汽	3808 HK	香港联合交易所	中国香港	2,708,500	26,573,635.20	0.75
51	Minth Group Limited	敏实集团	425 HK	香港联合交易所	中国香港	922,000	25,893,964.32	0.73
52	Cifi Ever Sunshine Services Group Limited	旭辉永升服务	1995 HK	香港联合交易所	中国香港	2,614,000	25,817,453.31	0.73

				所				
53	Huazhu Group Limited	华住	HTHT US	纳斯达克	美国	100,000	23,806,863.80	0.67
54	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行	3968 HK	香港联合交易所	中国香港	402,500	19,926,036.20	0.56
55	Pinduoduo Inc.	拼多多	PDD US	纳斯达克	美国	53,600	19,923,297.42	0.56
56	Metallurgical Corporation Of China Ltd.	中国中冶	1618 HK	香港联合交易所	中国香港	10,000,000	16,270,240.00	0.46
57	Zhuzhou Crrc Times Electric Co. Ltd.	时代电气	3898 HK	香港联合交易所	中国香港	413,900	15,278,969.50	0.43
58	Jiangsu Yangnong Chemical Co.,Ltd.	扬农化工	600486	上海证券交易所	中国	113,429	14,881,884.80	0.42
59	Cofco Joycome Foods Limited	中粮家佳康	1610 HK	香港联合交易所	中国香港	5,412,000	13,141,808.06	0.37
60	Innovent Biologics, Inc.	信达生物	1801 HK	香港联合交易所	中国香港	152,000	5,996,278.40	0.17
61	Fosun Tourism Group	复星旅游文化	1992 HK	香港联合交易所	中国香港	243,400	2,085,560.24	0.06
62	Hunan Changyuan Lico Co.,Ltd.	长远锂科	688779	上海证券交易所	中国	43,086	984,945.96	0.03
63	Jiangsu Yahong Meditech Co., Ltd	亚虹医药	688176	上海证券交易所	中国	37,990	873,010.20	0.02
64	Guizhou Zhenhua E-Chem Inc.	振华新材	688707	上海证券交易所	中国	8,130	383,410.80	0.01
65	Focuslight Technologies Inc.	炬光科技	688167	上海证券交易所	中国	2,014	355,813.38	0.01
66	C*Core Technology Co., Ltd	国芯科技	688262	上海证券交易所	中国	7,129	299,275.42	0.01
67	Anhui Estone Materials Technology Co., Ltd	壹石通	688733	上海证券交易所	中国	3,409	256,902.24	0.01

68	Hangzhou Bio-Sincerity Pharma-Tech Co., Ltd	百诚医药	301096	深圳证券交易所	中国	2,714	231,152.38	0.01
69	Jiangsu Zeyu Intelligent Electric Power Co.,Ltd.	泽宇智能	301179	深圳证券交易所	中国	2,941	161,592.01	0.00
70	Jiangsu Haili Wind Power Equipment Technology Co., Ltd.	海力风电	301155	深圳证券交易所	中国	1,054	101,974.50	0.00
71	Dr Corporation Limited	迪阿股份	301177	深圳证券交易所	中国	792	91,935.36	0.00
72	Fujian Tendering Co., Ltd.	招标股份	301136	深圳证券交易所	中国	7,172	75,449.44	0.00
73	Chengdu Rml Technology Co., Ltd.	雷电微力	301050	深圳证券交易所	中国	233	54,694.42	0.00
74	Shandong Weifang Rainbow Chemical Co., Ltd	润丰股份	301035	深圳证券交易所	中国	644	36,244.32	0.00
75	Inner Mongolia Xinhua Distribution Group Co.,Ltd.	内蒙新华	603230	上海证券交易所	中国	1,141	29,517.67	0.00
76	Cimc Vehicles (Group) Co., Ltd.	中集车辆	301039	深圳证券交易所	中国	2,064	25,820.64	0.00
77	San Yang Ma (Chongqing) Logistics Co.,Ltd.	三羊马	001317	深圳证券交易所	中国	300	25,722.00	0.00
78	Cofco Engineering & Technology Co., Ltd.	中粮工科	301058	深圳证券交易所	中国	1,386	25,280.64	0.00
79	Wuhan Kotei Informatics Co.,Ltd.	光庭信息	301221	深圳证券交易所	中国	280	24,841.60	0.00
80	Shenzhen Aoni Electronic Co., Ltd	奥尼电子	301189	深圳证券交易所	中国	435	24,629.70	0.00
81	Shanghai Universal Biotech Co.,Ltd	优宁维	301166	深圳证券交易所	中国	253	23,908.50	0.00
82	Shandong Kaisheng New Materials Co.,Ltd.	凯盛新材	301069	深圳证券交易所	中国	539	23,829.19	0.00

				所				
83	Joy Kie Corporation Limited.	久祺股份	300994	深圳证券交易所	中国	420	19,089.00	0.00
84	Yingkou Fengguang Advanced Material Co.,Ltd.	风光股份	301100	深圳证券交易所	中国	599	18,652.86	0.00
85	Shanghai Labway Clinical Laboratory Co.,Ltd.	兰卫医学	301060	深圳证券交易所	中国	587	18,161.78	0.00
86	Mingyue Optical Lens Co.,Ltd.	明月镜片	301101	深圳证券交易所	中国	371	16,086.56	0.00
87	Jiujiang Shanshui Technology Co., Ltd	善水科技	301190	深圳证券交易所	中国	575	15,789.50	0.00
88	Tongling Jieya Biologic Technology Co.,Ltd.	洁雅股份	301108	深圳证券交易所	中国	280	15,038.80	0.00
89	Shanghai Nenghui Technology Co.,Ltd.	能辉科技	301046	深圳证券交易所	中国	290	14,207.10	0.00
90	Guangdong Lifestrong Pharmacy Co., Ltd.	粤万年青	301111	深圳证券交易所	中国	379	13,901.72	0.00
91	Shu Yu Civilian Pharmacy Corp.,Ltd.	漱玉平民	301017	深圳证券交易所	中国	555	13,209.00	0.00
92	Mh Robot & Automation Co., Ltd.	迈赫股份	301199	深圳证券交易所	中国	402	12,864.00	0.00
93	Yantai Ishikawa Sealing Technology Co.,Ltd.	密封科技	301020	深圳证券交易所	中国	421	12,815.24	0.00
94	Hootech Inc.	浩通科技	301026	深圳证券交易所	中国	203	12,734.19	0.00
95	Inno Laser Technology Co., Ltd.	英诺激光	301021	深圳证券交易所	中国	290	12,014.70	0.00
96	Gemac Engineering Machinery Co., Ltd.	金鹰重工	301048	深圳证券交易所	中国	843	10,925.28	0.00
9	Xiamen East Asia Machi	东亚机	301028	深圳证	中国	733	9,895.5	0.

7	nery Industrial Co., Ltd.	械		券交易所			0	00
98	Bgt Group Co., Ltd.	倍杰特	300774	深圳证券交易所	中国	444	9,359.52	0.00
99	Kidswant Children Products Co.,Ltd.	孩子王	301078	深圳证券交易所	中国	756	9,177.84	0.00
100	Henan Carve Electronics Technology Co., Ltd	凯旺科技	301182	深圳证券交易所	中国	294	8,990.52	0.00
1001	Shanghai Ailu Package Co.,Ltd.	上海艾录	301062	深圳证券交易所	中国	523	8,896.23	0.00
1002	Guomai Culture&Media Co., Ltd.	果麦文化	301052	深圳证券交易所	中国	252	8,477.28	0.00
1003	Dook Media Group Limited	读客文化	301025	深圳证券交易所	中国	403	8,414.64	0.00
1004	Hangzhou Wensli Silk Culture Co.,Ltd	万事利	301066	深圳证券交易所	中国	344	7,856.96	0.00
1005	Shenzhen Jove Enterprise Limited	中富电路	300814	深圳证券交易所	中国	328	7,832.64	0.00
1006	Guangzhou Jinzhong Auto Parts Manufacturing Co., Ltd.	金钟股份	301133	深圳证券交易所	中国	286	7,707.70	0.00
1007	Ningbo Joy Intelligent Logistics Technology Co.,Ltd.	喜悦智行	301198	深圳证券交易所	中国	262	7,650.40	0.00
1008	Suzhou Shijing Environmental Technology Co., Ltd	仕净科技	301030	深圳证券交易所	中国	242	7,627.84	0.00
1009	Yanpai Filtration Technology Co.,Ltd.	严牌股份	301081	深圳证券交易所	中国	403	7,028.32	0.00
1010	Medprin Regenerative Medical Technologies Co., Ltd.	迈普医学	301033	深圳证券交易所	中国	108	6,476.76	0.00
1011	Anhui Chaoyue Environmental Protection Technology Co.,Ltd.	超越科技	301049	深圳证券交易所	中国	196	6,452.32	0.00

1 1 2	Zhejiang Xinchai Co.,Ltd	新柴股份	301032	深圳证 券交易 所	中国	513	6,417.6 3	0. 00
1 1 3	Sicher Elevator Co., Ltd.	森赫股份	301056	深圳证 券交易 所	中国	572	6,343.4 8	0. 00
1 1 4	Sunlour Pigment Co.,Ltd	双乐股份	301036	深圳证 券交易 所	中国	205	6,135.6 5	0. 00
1 1 5	Shenzhen King Brother Electronics Technology Co.,Ltd.	金百泽	301041	深圳证 券交易 所	中国	215	6,065.1 5	0. 00
1 1 6	Zhongjie (Jiangsu) Technology Co.,Ltd.	中捷精工	301072	深圳证 券交易 所	中国	181	6,047.2 1	0. 00
1 1 7	Bisen Smart Access Co.,Ltd.	百胜智能	301083	深圳证 券交易 所	中国	416	5,911.3 6	0. 00
1 1 8	Gad Environmental Technology Co., Ltd.	中兰环保	300854	深圳证 券交易 所	中国	203	5,539.8 7	0. 00
1 1 9	Zhangjiagang Haiguo New Energy Equipment Manufacturing Co., Ltd.	海锅股份	301063	深圳证 券交易 所	中国	153	5,524.8 3	0. 00
1 2 0	Jiangsu Times Textile Technology Co.,Ltd	泰慕士	001234	深圳证 券交易 所	中国	333	5,504.4 9	0. 00
1 2 1	Shenzhen Water Planning & Design Institute Co., Ltd.	深水规院	301038	深圳证 券交易 所	中国	266	5,381.1 8	0. 00
1 2 2	Jinsanjiang (Zhaoqing) Silicon Material Company Limited	金三江	301059	深圳证 券交易 所	中国	259	4,998.7 0	0. 00
1 2 3	Hualan Group Co., Ltd.	华蓝集团	301027	深圳证 券交易 所	中国	286	4,761.9 0	0. 00
1 2 4	Huitong Construction Group Co.,Ltd.	汇通集团	603176	上海证 券交易 所	中国	1,924	4,713.8 0	0. 00
1 2 5	Shanghai Baolijia Chemical Co., Ltd.	保立佳	301037	深圳证 券交易 所	中国	193	4,682.1 8	0. 00
1 2 6	Zhejiang Ssaw Boutique Hotels Co.,Ltd	君亭酒店	301073	深圳证 券交易 所	中国	144	4,608.0 0	0. 00

6				所				
1 2 7	Yoantion Industrial Inc ,Ltd.	远信工 业	301053	深圳证 券交易 所	中国	155	4,460.9 0	0. 00
1 2 8	Zhejiang Huilong New M aterials Co.,Ltd.	汇隆新 材	301057	深圳证 券交易 所	中国	218	4,146.3 6	0. 00
1 2 9	Hangzhou Dadi Haiyang Environmental Protecti on Co., Ltd.	大地海 洋	301068	深圳证 券交易 所	中国	144	4,086.7 2	0. 00
1 3 0	Shaoyang Victor Hydraul ics Co.,Ltd.	邵阳液 压	301079	深圳证 券交易 所	中国	140	3,474.8 0	0. 00

注:

1. 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。
2. 鉴于部分股票占基金资产净值的比例过于微小，四舍五入后无法通过小数点后两位数据加以列示，故标注为“0.00”。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	700 HK	710,131,576.68	40.82
2	Meituan	3690 HK	520,078,803.79	29.89
3	China Resources Land Limited	1109 HK	301,094,165.54	17.31
4	Jd.Com, Inc.	JD UW	256,981,909.17	14.77
5	Jinkosolar Holding Co., Ltd.	JKS US	248,900,588.58	14.31
6	Bilibili Inc.	BILI US	242,496,649.41	13.94
7	Xinte Energy Co., Ltd.	1799 HK	223,330,773.09	12.84
8	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	160,885,672.38	9.25
8	Alibaba Group Holding Limited	BABA US	60,289,106.76	3.47
9	Kingsoft Corporation Limited	3888 HK	218,771,324.71	12.58
10	Fuyao Glass Industry Group	3606 HK	217,458,851.92	12.50

	oup Co.,Ltd.			
11	China Datang Corporation Renewable Power Co., Limited	1798 HK	199,932,617.30	11.49
12	Sunny Optical Technology (Group) Company Limite d	2382 HK	196,416,362.36	11.29
13	I-Mab	IMAB US	182,429,066.99	10.49
14	Futu Holdings Ltd	FUTU US	177,043,346.90	10.18
15	Kingdee International So ftware Group Co. Ltd.	268 HK	176,697,039.50	10.16
16	Byd Company Limited	1211 HK	171,302,479.01	9.85
17	Longfor Group Holdings Limited	960 HK	170,281,988.87	9.79
18	Man Wah Holdings Limite d	1999 HK	169,245,194.04	9.73
19	Weichai Power Co.,Ltd.	000338	121,789,172.70	7.00
19	Weichai Power Co.,Ltd.	2338 HK	45,183,077.89	2.60
20	China Merchants Bank Co , Ltd.	3968 HK	165,492,059.27	9.51
21	New Oriental Education & Technology Group In c.	9901 HK	91,034,352.88	5.23
21	New Oriental Education & Technology Group In c.	EDU US	74,281,710.54	4.27
22	China Resources Power H oldings Co. Ltd.	836 HK	154,655,028.55	8.89
23	Kingsoft Cloud Holdings Ltd	KC US	148,411,251.39	8.53
24	Nvidia Corp	NVDA US	143,375,793.20	8.24
25	Postal Savings Bank Of China Co.,Ltd.	1658 HK	143,357,656.17	8.24
26	Weimob Inc.	2013 HK	133,093,696.12	7.65
27	Samsonite International S.A.	1910 HK	127,540,818.19	7.33
28	Daqo New Energy Corp.	DQ US	127,099,154.87	7.31
29	Bank Of Ningbo Co.,Ltd	002142	123,218,563.70	7.08
30	Country Garden Services Holdings Company Lim ited	6098 HK	119,872,358.44	6.89
31	Akeso, Inc.	9926 HK	116,880,316.72	6.72
32	Jiangxi Copper Company	358 HK	116,348,386.31	6.69

	Limited			
33	Cnooc Limited	883 HK	106,370,801.16	6.11
34	Rambus Inc	RMBS US	105,510,245.76	6.06
35	Remegen Co., Ltd.	9995 HK	102,444,911.07	5.89
36	China Overseas Land & Investment Ltd.	688 HK	102,274,428.15	5.88
37	China Longyuan Power Group Corporation Limited	916 HK	102,169,250.09	5.87
38	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	99,678,305.34	5.73
39	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	99,156,064.95	5.70
40	Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited	1458 HK	98,618,995.55	5.67
41	Hong Kong Exchanges And Clearing Ltd.	388 HK	97,505,482.12	5.60
42	Hua Hong Semiconductor Limited	1347 HK	93,205,450.46	5.36
43	Asml Holding Nv	ASML US	92,995,660.21	5.35
44	Xinyi Glass Holdings Limited	868 HK	92,917,996.91	5.34
45	Js Global Lifestyle Company Limited	1691 HK	91,897,101.13	5.28
46	Xilinx Inc	XLNX US	90,946,773.19	5.23
47	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	TSM UN	88,340,109.31	5.08
48	Carnival Corp	CCL US	86,102,637.48	4.95
49	Aia Group Limited	1299 HK	85,682,394.51	4.93
50	China Glass Holdings Limited	3300 HK	83,850,537.75	4.82
51	Greentown Service Group Co. Ltd.	2869 HK	81,390,929.42	4.68
52	Zhongsheng Group Holdings Ltd	881 HK	80,919,164.41	4.65
53	Baidu, Inc.	9888 HK	40,815,872.91	2.35
53	Baidu, Inc.	BIDU UW	40,022,879.96	2.30
54	China Unicom (Hong Kong) Ltd.	762 HK	79,992,754.82	4.60
55	Li Auto Inc.	2015 HK	58,882,825.74	3.38
55	Li Auto Inc.	LI US	20,357,595.47	1.17
56	Cifi Ever Sunshine Services Group Limited	1995 HK	78,729,894.62	4.53

57	Micron Technology Inc	MU US	76,156,538.47	4.38
58	Ferroglobe Plc	GSM US	70,323,740.77	4.04
59	Apple Inc	AAPL US	67,714,648.64	3.89
60	China Education Group Holdings Limited	839 HK	67,668,634.49	3.89
61	Aluminum Corporation Of China Limited	2600 HK	67,336,128.52	3.87
62	Riyue Heavy Industry Co.,Ltd	603218	66,422,765.00	3.82
63	Zai Lab Limited	ZLAB US	64,701,058.96	3.72
64	Innovent Biologics, Inc.	1801 HK	64,600,433.41	3.71
65	Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Limited	6989 HK	63,527,332.70	3.65
66	Shandong Linglong Tyre Co.,Ltd.	601966	63,293,468.93	3.64
67	Cansino Biologics Inc.	6185 HK	61,358,441.33	3.53
68	S-Enjoy Service Group Co., Limited	1755 HK	61,314,676.93	3.52
69	Ballard Power Systems Inc.	BLDP US	61,273,331.70	3.52
70	China Bluechemical Ltd.	3983 HK	60,694,767.88	3.49
71	Kintor Pharmaceutical Limited	9939 HK	60,021,299.58	3.45
72	Camel Group Co.,Ltd.	601311	59,991,346.30	3.45
73	Shandong Sun Paper Co., Ltd.	002078	59,990,822.09	3.45
74	Tencent Music Entertainment Group	TME US	59,682,969.92	3.43
75	Xpeng Inc.	9868 HK	58,907,471.07	3.39
76	L.K. Technology Holdings Limited	558 HK	58,712,841.21	3.37
77	Wiwynn Corporation	6669 TT	58,514,136.53	3.36
78	Btg Hotels (Group) Co., Ltd.	600258	58,234,194.44	3.35
79	Zhihu Inc.	ZH US	57,681,834.54	3.32
80	Vipshop Holdings Ltd	VIPS US	56,653,398.58	3.26
81	China National Building Material Company Limited	3323 HK	55,943,583.74	3.22
82	Morimatsu International Holdings Company Limit	2155 HK	54,734,227.82	3.15

	ed			
83	China Vanke Co.,Ltd.	2202 HK	54,362,460.42	3.12
84	Boc Aviation Limited	2588 HK	54,019,465.15	3.11
85	China Oilfield Services Limited	2883 HK	53,979,438.13	3.10
86	Shanghai Junshi Biosciences Co.,Ltd.	1877 HK	52,772,103.63	3.03
87	Zhejiang Nhu Company Ltd.	002001	52,134,796.35	3.00
88	Dongyue Group Limited	189 HK	52,062,679.13	2.99
89	Industrial Bank Co.,Ltd.	601166	51,660,162.48	2.97
90	Lam Research Corp	LRCX US	51,590,759.21	2.97
91	Huaxin Cement Co.,Ltd.	600801	50,253,857.29	2.89
92	Bosideng International Holdings Ltd.	3998 HK	49,996,301.37	2.87
93	Xiaomi Corporation	1810 HK	49,727,516.69	2.86
94	Sands China Ltd.	1928 HK	49,703,916.13	2.86
95	Hainan Meilan International Airport Company Limited	357 HK	49,238,584.00	2.83
96	Sungrow Power Supply Co., Ltd.	300274	49,049,936.88	2.82
97	China Jushi Co.,Ltd	600176	48,470,206.60	2.79
98	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	2318 HK	48,116,310.68	2.77
99	Sailun Group Co.,Ltd.	601058	48,111,425.33	2.77
100	Gf Securities Co.,Ltd.	1776 HK	47,897,573.11	2.75
101	Hunan Valin Steel Co., Ltd.	000932	47,865,164.30	2.75
102	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	44,087,098.46	2.53
103	Hangzhou Robam Appliances Co.,Ltd.	002508	43,660,603.00	2.51
104	Marvell Technology, Inc.	MRVL US	43,045,766.64	2.47
105	China Southern Airlines Company Limited	1055 HK	42,715,451.84	2.46
106	Q Technology (Group) Company Limited	1478 HK	41,922,922.29	2.41
107	Kwg Group Holdings Limited	1813 HK	41,774,931.99	2.40
108	Genius Electronic Optica	3406 TT	41,628,503.37	2.39

	l Co.,Ltd			
109	Kuaishou Technology	1024 HK	41,313,708.21	2.37
110	Novatek Microelectronics Corp.	3034 TT	40,634,937.21	2.34
111	Intel Corp	INTC US	39,749,557.12	2.28
112	Shandong Hualu-Hengsheng Chemical Co.,Ltd	600426	38,692,539.40	2.22
113	Guangzhou Kdt Machinery Co.,Ltd.	002833	38,376,509.90	2.21
114	Sunac China Holdings Limited	1918 HK	38,036,531.41	2.19
115	Koolearn Technology Holding Limited	1797 HK	37,895,993.81	2.18
116	Semiconductor Manufacturing International Corporation	981 HK	37,616,070.20	2.16
117	Ping An Bank Co., Ltd.	000001	36,937,811.50	2.12
118	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co.,Ltd.	002271	36,895,944.50	2.12
119	Hope Education Group Co.,Ltd.	1765 HK	36,764,829.21	2.11
120	Cowell E Holdings Inc.	1415 HK	36,610,670.17	2.10
121	Beijing New Building Materials Public Limited Company	000786	36,315,252.35	2.09
122	Satellite Chemical Co., Ltd.	002648	36,067,616.17	2.07
123	Analog Devices Inc	ADI US	36,001,991.00	2.07
124	Lb Group Co., Ltd.	002601	35,991,996.00	2.07
125	Orient Securities Company Limited	3958 HK	35,329,275.31	2.03
126	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	YZJSGD SP	35,264,873.18	2.03
127	Lumentum Holdings Inc.	LITE US	34,937,945.04	2.01

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	700 HK	582,988,578.19	33.51
2	Meituan	3690 HK	392,043,960.68	22.54

3	Bilibili Inc.	BILI US	275,950,590.61	15.86
4	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	174,360,876.98	10.02
4	Alibaba Group Holding Limited	BABA US	55,266,566.10	3.18
5	Jd.Com, Inc.	JD UW	202,738,698.09	11.65
5	Jd.Com, Inc.	9618 HK	21,513,470.81	1.24
6	China Datang Corporation Renewable Power Co., Limited	1798 HK	217,892,739.66	12.52
7	Fuyao Glass Industry Group Co.,Ltd.	3606 HK	203,223,241.25	11.68
8	Xinte Energy Co., Ltd.	1799 HK	191,928,296.43	11.03
9	Jinkosolar Holding Co., Ltd.	JKS US	186,930,990.24	10.74
10	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	185,452,588.77	10.66
11	China Resources Land Limited	1109 HK	170,801,268.15	9.82
12	Futu Holdings Ltd	FUTU US	162,111,079.79	9.32
13	Morimatsu International Holdings Company Limited	2155 HK	157,032,223.94	9.03
14	Nvidia Corp	NVDA US	152,636,776.15	8.77
15	New Oriental Education & Technology Group Inc.	EDU US	91,146,660.25	5.24
15	New Oriental Education & Technology Group Inc.	9901 HK	54,474,243.14	3.13
16	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	142,099,332.41	8.17
17	BYD Company Limited	1211 HK	137,288,784.46	7.89
18	Weichai Power Co.,Ltd.	000338	77,255,065.59	4.44
18	Weichai Power Co.,Ltd.	2338 HK	53,427,005.01	3.07
19	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	129,324,273.26	7.43
20	Daqo New Energy Corp.	DQ US	128,066,330.39	7.36
21	Satellite Chemical Co., Ltd.	002648	126,890,113.41	7.29
22	Kingsoft Cloud Holdings Ltd	KC US	126,455,652.21	7.27

23	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	TSM UN	123,627,370.36	7.11
24	Postal Savings Bank of China Co.,Ltd.	1658 HK	123,616,151.96	7.11
25	Kingsoft Corporation Limited	3888 HK	121,946,007.45	7.01
26	Weimob Inc.	2013 HK	116,298,065.45	6.68
27	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	114,403,104.41	6.58
28	XinYi Glass Holdings Limited	868 HK	113,675,340.61	6.53
29	Sungrow Power Supply Co., Ltd.	300274	109,498,678.00	6.29
30	I-Mab	IMAB US	107,548,772.19	6.18
31	Zhongsheng Group Holdings Ltd	881 HK	101,685,983.22	5.84
32	CNOOC Limited	883 HK	99,913,675.30	5.74
33	China Longyuan Power Group Corporation Limited	916 HK	98,154,573.95	5.64
34	Jiangxi Copper Company Limited	358 HK	95,142,463.15	5.47
35	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	95,105,462.10	5.47
36	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	268 HK	92,991,737.01	5.35
37	Bank Of Ningbo Co.,Ltd	002142	90,971,770.86	5.23
38	Asml Holding Nv	ASML US	89,190,580.86	5.13
39	Micron Technology Inc	MU US	88,773,562.21	5.10
40	China Oilfield Services Limited	2883 HK	85,869,122.96	4.94
41	Carnival Corp	CCL US	84,888,014.63	4.88
42	Hua Hong Semiconductor Limited	1347 HK	81,729,931.46	4.70
43	Aluminum Corporation of China Limited	2600 HK	80,088,294.07	4.60
44	China Glass Holdings Limited	3300 HK	76,717,944.59	4.41
45	Longfor Group Holdings Limited	960 HK	76,460,267.47	4.40
46	Remegen Co., Ltd.	9995 HK	74,526,959.51	4.28
47	Apple Inc	AAPL US	72,330,100.16	4.16
48	Js Global Lifestyle Company Limited	1691 HK	71,314,260.94	4.10

49	China Unicom (Hong Kong) Ltd.	762 HK	71,284,170.76	4.10
50	Riyue Heavy Industry Co ,Ltd	603218	70,487,479.31	4.05
51	Baidu, Inc.	BIDU UW	35,777,360.39	2.06
51	Baidu, Inc.	9888 HK	34,232,992.95	1.97
52	Samsonite International S.A.	1910 HK	69,343,762.97	3.99
53	Dongyue Group Limited	189 HK	67,384,186.20	3.87
54	Xilinx Inc	XLNX US	66,829,885.56	3.84
55	Shandong Linglong Tyre Co.,Ltd.	601966	66,350,978.61	3.81
56	CIFI Ever Sunshine Serv ices Group Limited	1995 HK	64,854,546.94	3.73
57	China Vanke Co.,Ltd.	2202 HK	64,624,573.14	3.71
58	Camel Group Co.,Ltd.	601311	63,986,957.33	3.68
59	China Jushi Co.,Ltd	600176	63,449,371.37	3.65
60	Zai Lab Limited	ZLAB US	63,158,955.63	3.63
61	Cansino Biologics Inc.	6185 HK	62,404,070.62	3.59
62	Hunan Valin Steel Co., Ltd.	000932	62,140,368.85	3.57
63	S-Enjoy Service Group C o., Limited	1755 HK	61,041,335.83	3.51
64	China Taiping Insurance Holdings Company Lim ited	966 HK	60,859,438.36	3.50
65	Rambus Inc	RMBS US	57,840,987.87	3.32
66	Lam Research Corp	LRCX US	56,926,234.35	3.27
67	Tencent Music Entertainm ent Group	TME US	56,238,230.60	3.23
68	Kintor Pharmaceutical Li mited	9939 HK	56,183,227.29	3.23
69	China BlueChemical Ltd.	3983 HK	55,496,623.22	3.19
70	Zhihu Inc.	ZH US	54,305,852.62	3.12
71	China Education Group H oldings Limited	839 HK	52,960,292.64	3.04
72	China Overseas Land & Investment Ltd.	688 HK	52,540,666.93	3.02
73	Country Garden Services Holdings Company Lim ited	6098 HK	52,457,019.44	3.02
74	China Resources Power H oldings Co. Ltd.	836 HK	51,714,250.08	2.97

75	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	51,329,049.75	2.95
76	Shanghai Junshi Biosciences Co.,Ltd.	1877 HK	51,278,189.70	2.95
77	Zijin Mining Group Company Limited	2899 HK	48,638,960.73	2.80
78	Marvell Technology, Inc.	MRVL US	48,475,392.96	2.79
79	Akeso, Inc.	9926 HK	48,283,014.87	2.78
80	Bosideng International Holdings Ltd.	3998 HK	47,911,092.59	2.75
81	China National Building Material Company Limited	3323 HK	47,737,253.24	2.74
82	Shandong Sun Paper Co., Ltd.	002078	47,584,259.29	2.74
83	Ballard Power Systems Inc.	BLDP US	47,572,137.18	2.73
84	Ferroglobe Plc	GSM US	47,163,616.01	2.71
85	Fosun Tourism Group	1992 HK	46,732,773.60	2.69
86	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	46,593,768.95	2.68
87	Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited	1458 HK	44,690,593.96	2.57
88	Xinyi Solar Holdings Limited	968 HK	44,327,409.76	2.55
89	Intel Corp	INTC US	44,172,434.07	2.54
90	L.K. Technology Holdings Limited	558 HK	43,548,777.58	2.50
91	Huaxin Cement Co.,Ltd.	600801	43,441,573.00	2.50
92	Ganfeng Lithium Co., Ltd.	1772 HK	42,931,905.33	2.47
93	Vipshop Holdings Ltd	VIPS US	42,846,655.04	2.46
94	China Southern Airlines Company Limited	1055 HK	41,111,026.67	2.36
95	Guangzhou Kdt Machinery Co.,Ltd.	002833	41,075,460.95	2.36
96	Q Technology (Group) Company Limited	1478 HK	40,900,438.38	2.35
97	Industrial Bank Co.,Ltd.	601166	40,658,558.00	2.34
98	KWG Group Holdings Limited	1813 HK	40,578,045.58	2.33

99	BeiGene, Ltd.	6160 HK	37,629,715.52	2.16
99	BeiGene, Ltd.	688235	2,796,169.68	0.16
100	BTG Hotels (Group) Co., Ltd.	600258	40,270,586.78	2.31
101	Innovent Biologics, Inc.	1801 HK	40,270,451.60	2.31
102	Haitian International Ho ldings Limited	1882 HK	40,258,635.78	2.31
103	Genius Electronic Optica l Co.,Ltd	3406 TT	38,790,041.74	2.23
104	Novatek Microelectronics Corp.	3034 TT	38,744,493.49	2.23
105	Sunac China Holdings Li mited	1918 HK	38,607,164.08	2.22
106	Xiaomi Corporation	1810 HK	38,103,495.72	2.19
107	Luk Fook Holdings (International) Ltd.	590 HK	36,109,802.04	2.08
108	Excellence Commercial Pr operty & Facilities Managemen t Group Limited	6989 HK	35,477,526.00	2.04

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	13,182,898,843.38
卖出收入（成交）总额	11,288,591,619.26

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
AAA	2,957,000.00	0.08
未评级	135,650,124.60	3.84

注：上述债券投资组合主要适用标准普尔、穆迪、惠誉等国际权威机构评级。

8.7 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产 净值比例（%）
1	019649	21 国债 01	1,356,230	135,650,124.60	3.84
2	113052	兴业转债	29,570	2,957,000.00	0.08

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	221,307.45
2	应收证券清算款	339,128.51
3	应收股利	1,045,092.00
4	应收利息	3,161,538.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	3,569,417.01
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,336,482.97

8.11.4 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。

8.11.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
231,362	6,085.13	497,210,179.04	35.32	910,658,714.93	64.68

9.2 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	163,698.96	0.011627

9.3 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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 2 月 3 日）基金份额总额	330,232,755.09
本报告期期初基金份额总额	679,101,600.97
本报告期基金总申购份额	1,622,195,712.07
减：本报告期基金总赎回份额	893,428,419.07
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	1,407,868,893.97

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

经国海富兰克林基金管理有限公司第六届董事会第十六次会议审议通过，自 2021 年 12 月 3 日起，林勇先生不再担任公司总经理，自林勇先生离任总经理之日起到新任总经理到任前，根据董事会决议以及公司章程、相关法律法规的有关规定，副总经理徐荔蓉先生代为履行总经理职务。相关公告已于 2021 年 12 月 4 日在《证券日报》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

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人应支付给会计师事务所的审计费用是人民币 120,000.00 元，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。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
Credit Suisse(Hong kong) Limited	2	768,515,841.16	3.15%	773,425.93	3.62%	-
Normura International Plc	2	970,632,075.15	3.98%	811,557.51	3.80%	-
Goldman Sachs(Asia) LLC	2	761,775,446.13	3.13%	631,551.70	2.95%	-
Daiw Capital Markets Hongkong Limited	2	1,447,732,177.27	5.94%	996,832.51	4.66%	-
Haitong International Securities Company Limited	2	739,653,298.60	3.04%	1,009,050.41	4.72%	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	2	1,336,113,427.26	5.48%	1,336,113.43	6.25%	-
Jefferies Hongkong Limited	1	1,963,415,504.25	8.06%	1,426,562.62	6.67%	-
CLSA Limited	1	488,597,317.08	2.01%	737,986.58	3.45%	-
China everbrilght securities(HK) securities	1	218,526,397.02	0.90%	356,391.13	1.67%	-
China Renaissance Securities(HK)	1	314,382,910.03	1.29%	307,559.38	1.44%	-
Masterlink Securities	1	9,100,177.77	0.04%	18,200.36	0.09%	-
Macquarie Capital Asia L	1	2,578,171,48	10.58%	1,681,465.1	7.86%	-

imited		3.42		2		
Yuanta Securities CO., LTD.	1	315,055,124.08	1.29%	315,055.33	1.47%	-
Sanford C. Bernstein (HK) Limited	1	1,290,590,751.43	5.30%	1,297,750.28	6.07%	-
JP Morgan Securities PLC	1	391,172,696.77	1.61%	586,759.04	2.74%	-
BOCI Securities Limited	1	490,346,035.85	2.01%	588,415.25	2.75%	-
Cathay Securities (HK) Limited	2	38,744,493.49	0.16%	42,618.87	0.20%	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	2	5,243,049.59	0.02%	52,430.49	0.25%	-
Bank of America Merrill Lynch	2	-	-	-	-	-
Southwest Securities International Limited	1	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International plc	2	-	-	-	-	-
BARCLAYS Capital	1	-	-	-	-	-
Core Pacific-Yamaichi International (H.K.) Ltd.	1	-	-	-	-	-
CMB International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
CCb International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
KGI Securities Co. Ltd	1	-	-	-	-	-
DAEWOO SECURITIES CO. LT	1	-	-	-	-	-

D						
DAISHIN SECURITIES-KOREA	1	-	-	-	-	-
BNP Paribas	1	-	-	-	-	-
Zhongtai International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Bank of China (HK)	1	-	-	-	-	-
BOC International	1	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	1	-	-	-	-	-
JPMorgan Chase & Co.	1	-	-	-	-	-
China Securities International	1	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	1	-	-	-	-	-
BOCOM International Holdings Company Limited	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	577,144,433.23	2.37%	473,773.23	2.22%	-
北京高华	1	142,950,866.48	0.59%	133,133.58	0.62%	-
东兴证券	1	247,327,109.56	1.02%	230,336.29	1.08%	-
方正证券	1	470,156,066.97	1.93%	437,856.00	2.05%	-
国信证券	1	866,898,476.25	3.56%	693,518.91	3.24%	-
海通证券	1	15,877,132.29	0.07%	14,785.55	0.07%	-
华安证券	1	37,084,774.8	0.15%	34,536.95	0.16%	-

		8				
华泰证券	2	799,468,640.48	3.28%	648,584.18	3.03%	-
申万宏源	1	500,870,100.20	2.06%	400,696.07	1.87%	-
西藏东财证券	2	128,562,581.39	0.53%	94,018.31	0.44%	-
兴业证券	1	1,015,663,688.30	4.17%	861,808.17	4.03%	-
中金公司	2	2,896,499,588.50	11.89%	2,333,452.71	10.91%	-
中泰证券	2	356,736,614.23	1.46%	267,494.80	1.25%	-
中信证券	2	1,497,185,840.38	6.15%	1,249,199.93	5.84%	-
国海证券	2	151,505,663.49	0.62%	121,204.50	0.57%	-
中信建投	1	3,092,541.47	0.01%	2,878.88	0.01%	-
天风证券	1	243,083,640.46	1.00%	189,140.53	0.88%	-
东北证券	1	207,828,768.31	0.85%	170,840.41	0.80%	-
国盛证券	1	76,164,061.55	0.31%	55,696.38	0.26%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-

西南证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	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。

11.7.2 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		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
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Normura International Plc	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia) LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Daiw Capital Markets Hongkong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Jefferies Hongkong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China everbright securities (HK) secu	-	-	-	-	-	-	-	-

rities								
China Renaissance Securities (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-
Masterlink Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Macquarie Capital Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Yuanta Securities CO., LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Cathay Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Bank of America Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-
Southwest Securities International Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International plc	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS Capital	-	-	-	-	-	-	-	-
Core Pacific-Yamaichi International (H.K.) Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
CMB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CCb International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI Securities Co. Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
DAEWOO SECURITIES CO. LTD	-	-	-	-	-	-	-	-
DAISHIN SECURITIES-KOREA	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas	-	-	-	-	-	-	-	-

Zhongtai International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Bank of China (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-
BOC International	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
JPMorgan Chase & Co.	-	-	-	-	-	-	-	-
China Securities International	-	-	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCOM International Holdings Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	59,998,617.60	20.83%	420,000,000.00	36.59%	-	-	-	-
方正证券	102,811.59	0.04%	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财证券	117,069,921.40	40.65%	467,800,000.00	40.76%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	260,000,000.00	22.65%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	110,828,612.60	38.48%	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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	关于增加招商银行股份有限公司为富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金-美元现汇份额代销机构的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-01-20
2	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-01-22
3	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-01-22
4	关于增加部分代销机构为富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金-人民币份额代销机构并开通定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-02-25
5	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加海通证券股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-03-04
6	国海富兰克林基金关于与通联支付合作开通招商银行借记卡支付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	2021-03-09
7	关于增加中国国际金融股份有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-03-22
8	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通定期定额投资业务及相关	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-03-26

	费率优惠活动的公告		
9	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	2021-03-30
10	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-03-30
11	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-03-30
12	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年 1 号）	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-03-30
13	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新更新	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-03-30
14	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	2021-03-31
15	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-03-31
16	关于增加中国人寿保险股份有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-04-01
17	关于增加爱建证券有限责任公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-04-21
18	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	2021-04-21
19	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-04-21
20	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下部分基金于 2021 年非港股通交易日暂停基金交易业务的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-04-23
21	关于增加海通期货有限责任公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-05-18
22	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金在申万宏源证券有限公司开通定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-05-19
23	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中信建投证券股份有限公司申购、定期定额投资费率优惠活	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-05-21

	动的公告		
24	关于增加上海中欧财富基金销售有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-05-22
25	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行的股票的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-05-29
26	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	2021-06-15
27	关于增加宁波银行为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-06-24
28	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加交通银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-06-30
29	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年 2 号）	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-06-30
30	关于增加北京恒天明泽基金销售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业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-07-09
31	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银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-07-16
32	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	2021-07-21
33	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-07-21
34	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加国泰君安证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-07-31
35	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加上海浦东发展银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-07-31
36	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通定期定额投资业务并参加其申购及定期定额投资业务费率优惠	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-08-27

	活动的公告		
37	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-08-31
38	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-08-31
39	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资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	2021-09-10
40	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加江海证券有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-09-28
41	关于增加交通银行股份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	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-10-15
42	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中信证券（山东）有限责任公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-10-22
43	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中信期货有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-10-22
44	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	2021-10-27
45	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-10-27
46	国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-12-04
47	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-12-21

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

13.2 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。

13.3 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3月31日