

富兰克林国海深化价值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：中国农业银行股份有限公司

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 信息披露方式	6
2.5 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	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	54
8.3 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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
8.6 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	64
8.7 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	64

8.8 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	65
8.9 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	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
8.12 投资组合报告附注	65
§9 基金份额持有人信息	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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的情况	67
§10 开放式基金份额变动	68
§11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
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	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8 其他重大事件	72
§12 影响投资者决策的其他重要信息	79
12.1 影响投资者决策的其他重要信息	79
§13 备查文件目录	80
13.1 备查文件目录	80
13.2 存放地点	80
13.3 查阅方式	80

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金
基金简称	国富深化价值混合
基金主代码	450004
交易代码	450004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 7 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	708,612,336.77 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以富兰克林邓普顿投资集团环球资产管理平台为依托，针对证券市场发展中的结构性特征，投资于具有估值优势和成长潜力的上市公司的股票以及各种投资级债券，争取达到基金财产长期稳定增值的目的。
投资策略	本基金采取“自下而上”的选股策略和“自上而下”的资产配置相结合的主动投资管理策略；在股票投资上，本基金运用双层次价值发现模型进行股票选择；在资产配置上，本基金主要根据宏观经济、政策环境、利率走势、市场资金构成及流动性情况，通过深入的数量化分析和基本面研究，制定本基金股票、债券、现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围；在债券投资上，债券投资组合的回报主要来自于组合的久期管理、识别收益率曲线中价值低估的部分以及识别各类债券中价值低估的种类（例如企业债存在信用升级的潜力）。 本基金也可进行股指期货及权证投资。
业绩比较基准	85% × 沪深 300 指数 + 15% × 中债国债总指数（全价）
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	秦一楠

	联系电话	021-3855 5555	010-6606 0069
	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	010-6812 1816
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 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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

2.5 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	125,249,331.80	76,867,674.29	30,231,579.76
本期利润	157,712,512.68	154,042,035.72	62,825,583.90
加权平均基金份额本期利润	0.4681	1.2023	0.4968
本期加权平均净值利润率	15.49%	62.27%	40.60%
本期基金份额净值增长率	22.01%	81.60%	51.57%
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	1,307,528,010.61	271,317,300.09	71,644,639.25
期末可供分配基金份额利润	1.8452	1.4099	0.4459
期末基金资产净值	2,270,079,711.51	505,321,073.04	232,317,035.26
期末基金份额净值	3.204	2.626	1.446
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	362.36%	278.95%	108.67%

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。

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	2.76%	0.89%	1.36%	0.67%	1.40%	0.22%
过去六个月	8.54%	1.19%	-4.28%	0.87%	12.82%	0.32%
过去一年	22.01%	1.32%	-3.87%	1.00%	25.88%	0.32%

过去三年	235.85%	1.35%	54.22%	1.09%	181.63%	0.26%
过去五年	229.97%	1.26%	42.81%	1.02%	187.16%	0.24%
自基金合同生效起至今	362.36%	1.69%	79.18%	1.34%	283.18%	0.35%

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

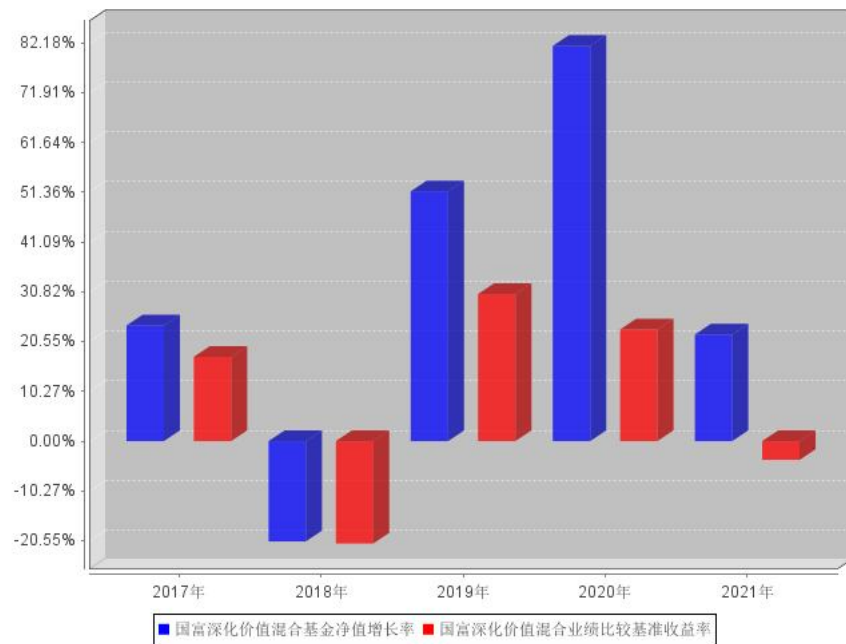
国富深化价值混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2008 年 7 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。

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

国富深化价值混合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		
刘晓	国富深化价值混合基金、国富新机遇混合基金、国富天颐混合基金、国富焦点驱动混合基金、国富匠心精选混合基金的基金经理	2017 年 2 月 18 日	—	15 年	刘晓女士，上海财经大学金融学硕士。历任国海富兰克林基金管理有限公司研究助理、研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理兼研究员。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富深化价值混合基金、国富新机遇混合基金、国富天颐混合基金、国富焦点驱动混合基金、国富匠心精选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《富兰克林国海深化价值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

2021 年全球在新冠疫情的阴霾下艰难前行，上半年受德尔塔变种的影响较大，四季度奥密戎变种新冠病毒的出现导致海外许多国家确诊人数快速上升，国内疫情全年呈现多点散发状态。国内经济依靠出口支撑，消费数据整体较弱，地产企业的风险暴露对银行、地产板块形成较大压制，大宗商品价格大幅上涨压制中下游企业盈利能力，稳增长压力加大。市场担忧经济下行速度超预期以及新的变种病毒对中国防疫机制的考验，货币政策宽松预期升温。新能源行业作为长期确定性高的高成长行业，受到广泛和持续的关注，热点持续扩散。全年来看，电气设备、有色、采掘、化工、钢铁和公用事业等板块涨幅居前，而低估值的家电、非银、房地产、食品饮料和医药板块全年整体表现较弱。

2021 年全年，本基金全年总体维持中性偏乐观的权益仓位，重点配置景气度持续性较强的行业里面，估值相对合理，有核心竞争力的优质公司。具体行业方面，电气设备新能源、化工、公用事业、有色、金融等配置相对较多，总体在行业和风格配置上保持均衡，继续自下而上的深入研究挖掘个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金份额净值 3.204 元，本报告期份额净值上涨 22.01%，同期

业绩比较基准下跌 3.87%，跑赢业绩比较基准 25.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，预计国内经济基本面前低后高，年初稳增长压力较大，未来随着新基建等稳增长政策发力，房地产板块在风险释放后，投资增速有望逐步企稳。而大宗商品的价格及运力影响基本达到阶段性顶部，未来预计会稳住甚至下行，国内对于煤炭、电力保供措施得力，有效的缓解市场担忧，中游制造业成本压力将有所改善，毛利率有望逐步修复。A 股市场整体估值仍然有很强的支撑，大幅调整的可能性较低。海外多国疫情走向及经济产能恢复进度也将继续影响各国的财政和货币政策，成为全球经济情况的重要影响因素，仍需重点关注变异病毒的传播和影响、全球疫苗接种情况及效果，以及新冠治疗药物的有效性及应用程度。

中长期看全球经济复苏趋势确定性仍强，中国经济韧性较强，有望在稳定增长的努力下实现经济结构的优化，并在科技发展中保持较为领先的态势。中国制造业通过过去几十年的不断积累，国内产业结构调整和技术进步非常显著，制造业受益工程师红利和产业链配套的完整，在国际市场上的产品竞争力大幅提升，即使短期受疫情影响下出口数据的整体影响，但相信未来在国际市场上的份额仍将稳步提升，会有一大批优质企业从中国龙头公司成长为世界龙头公司。另外，流动性上看，GDP 增速或将长期维持低速增长态势，流动性适度或宽松的状态或将长期持续。而从市场参与者结构看，我国居民资产配置向权益转移，机构化和外资比例的仍在提升，对 A 股市场也形成实质性的长期利好。

从投资策略的角度看，研究的重心始终应该更多的放在自下而上的角度，重视公司业绩增长和估值匹配的逻辑，长期重点关注高端制造和消费升级。本基金会在行业和风格配置上保持均衡，继续自下而上的深入研究挖掘个股。

本基金将继续按照基金合同及相关法律法规要求，努力做好基金投资工作，争取未来取得更好的长期投资收益。

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，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

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合规守信情况声明

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合规守信、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 23087 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	富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金(以下简称“国富深化价值混合基金”)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。 (二) 我们的意见 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，公允反映了国富深化价值混合基金 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。
形成审计意见的基础	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。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国富深化价值混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	国富深化价值混合基金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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估国富深化价值混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(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深化价值混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督国富深化价值混合基金的财务报告过

	程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (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。 (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。 (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。 (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，就可能导致对国富深化价值混合基金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深化价值混合基金不能持续经营。 (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。 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。	
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：富兰克林国海深化价值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	390,673,603.12	86,388,901.52
结算备付金		2,874,882.42	128,186.64
存出保证金		274,024.88	92,869.75
交易性金融资产	7.4.7.2	1,910,606,300.33	428,776,542.29
其中：股票投资		1,908,635,300.33	428,776,542.29
基金投资		-	-
债券投资		1,971,000.00	-
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	78,263.27	18,919.12
应收股利		-	-
应收申购款		13,031,346.27	661,134.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,317,538,420.29	516,066,554.01
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		24,944,552.20	9,032,293.39
应付赎回款		17,490,082.49	609,891.96
应付管理人报酬		2,538,754.98	503,665.40
应付托管费		423,125.85	83,944.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,725,580.01	270,581.77
应交税费		54,000.00	54,000.02
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	282,613.25	191,104.21
负债合计		47,458,708.78	10,745,480.97
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	708,612,336.77	192,442,701.40
未分配利润	7.4.7.10	1,561,467,374.74	312,878,371.64
所有者权益合计		2,270,079,711.51	505,321,073.04
负债和所有者权益总计		2,317,538,420.29	516,066,554.01

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.204 元，基金份额总额 708,612,336.77 份。

7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海深化价值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 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
一、收入		181,392,459.90	160,197,612.92
1. 利息收入		1,397,202.10	237,966.41
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,397,081.99	237,820.73
债券利息收入		120.11	145.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		146,557,270.18	82,460,499.82
其中：股票投资收益	7.4.7.12	139,207,281.31	79,778,291.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	185,493.22	289,765.69
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	7,164,495.65	2,392,442.83
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	32,463,180.88	77,174,361.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	974,806.74	324,785.26
减：二、费用		23,679,947.22	6,155,577.20
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	15,153,167.30	3,687,744.26
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,525,527.85	614,624.00
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	7.4.7.18	5,761,918.24	1,642,344.17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.22	0.51
7. 其他费用	7.4.7.19	239,333.61	210,864.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		157,712,512.68	154,042,035.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		157,712,512.68	154,042,035.72

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海深化价值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）	192,442,701.40	312,878,371.64	505,321,073.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	157,712,512.68	157,712,512.68
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）	516,169,635.37	1,090,876,490.42	1,607,046,125.79
其中：1. 基金申购款	725,185,159.70	1,503,189,656.50	2,228,374,816.20
2. 基金赎回款	-209,015,524.33	-412,313,166.08	-621,328,690.41
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）	708,612,336.77	1,561,467,374.74	2,270,079,711.51
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）	160,672,396.01	71,644,639.25	232,317,035.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	154,042,035.72	154,042,035.72
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）	31,770,305.39	87,191,696.67	118,962,002.06
其中：1. 基金申购款	170,544,232.67	194,815,575.54	365,359,808.21
2. 基金赎回款	-138,773,927.28	-107,623,878.87	-246,397,806.15
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）	192,442,701.40	312,878,371.64	505,321,073.04

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

富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金(原富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金,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[2008]第406号《关于核准富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金募集的批复》核准,由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海深化价值股票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758,977,333.76元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第101号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金基金合同》于2008年7月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为759,210,671.71份基金份额,其中认购资金利息折合233,337.95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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 8 日公告后更名为富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海深化价值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国内依法公开的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及中国证券监督管理委员会允许基金投资的其他金融工具，其中，股票投资范围包括所有在国内依法公开发行上市的股票、存托凭证；债券投资范围主要包括国内国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券和短期融资券等。本基金投资组合的范围为：股票(含存托凭证)投资占基金资产的 60%-95%，债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，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：85%×沪深 300 指数+15%×中债国债总指数(全价)。

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》、《富兰克林国海深化价值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。

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、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中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、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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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 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。

7.4.4.13 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

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

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

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	390,673,603.12	86,388,901.52
定期存款	—	—

其中：存款期限 1-3 个月 以内	-	-
其他存款	-	-
合计：	390,673,603.12	86,388,901.52

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	1,772,729,892.75	1,908,635,300.33	135,905,407.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,971,000.00	1,971,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,971,000.00	1,971,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,774,700,892.75	1,910,606,300.33	135,905,407.58
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	325,334,315.59	428,776,542.29	103,442,226.70
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	325,334,315.59	428,776,542.29	103,442,226.70

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	76,803.27	18,819.82
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	1,293.50	57.50
应收债券利息	43.20	-
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	-	-
其他	123.30	41.80
合计	78,263.27	18,919.12

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

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	1,725,580.01	270,581.77
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,725,580.01	270,581.77

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	78,113.25	1,604.21
审计费用	80,000.00	65,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
债券账户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	282,613.25	191,104.21

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	192,442,701.40	192,442,701.40
本期申购	725,185,159.70	725,185,159.70
本期赎回（以“-”号填列）	-209,015,524.33	-209,015,524.33
本期末	708,612,336.77	708,612,336.77

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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	271,317,300.09	41,561,071.55	312,878,371.64
本期利润	125,249,331.80	32,463,180.88	157,712,512.68
本期基金份额交易产生的变动数	910,961,378.72	179,915,111.70	1,090,876,490.42
其中：基金申购款	1,261,809,738.09	241,379,918.41	1,503,189,656.50
基金赎回款	-350,848,359.37	-61,464,806.71	-412,313,166.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,307,528,010.61	253,939,364.13	1,561,467,374.74

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	1,370,605.65	230,920.52
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	23,766.33	5,596.72
其他	2,710.01	1,303.49

合计	1,397,081.99	237,820.73
----	--------------	------------

7.4.7.12 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	1,511,515,331.51	524,064,832.99
减：卖出股票成本总额	1,372,308,050.20	444,286,541.69
买卖股票差价收入	139,207,281.31	79,778,291.30

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	185,493.22	289,765.69
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	185,493.22	289,765.69

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	838,571.99	1,215,454.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	653,000.00	925,500.00
减：应收利息总额	78.77	188.46
买卖债券差价收入	185,493.22	289,765.69

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 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
股票投资产生的股利收益	7,164,495.65	2,392,442.83
合计	7,164,495.65	2,392,442.83

7.4.7.16 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	32,463,180.88	77,174,361.43
—— 股票投资	32,463,180.88	77,174,361.43
—— 债券投资	—	—
—— 资产支持证券投资	—	—
—— 贵金属投资	—	—
—— 其他	—	—
2. 衍生工具	—	—
—— 权证投资	—	—
3. 其他	—	—
合计	32,463,180.88	77,174,361.43

7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	968,186.43	278,669.21
转换费收入	6,620.31	5,500.29
其他	—	40,615.76
合计	974,806.74	324,785.26

注：

1. 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。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

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
交易所市场交易费用	5,761,918.24	1,642,344.17
银行间市场交易费用	-	-
合计	5,761,918.24	1,642,344.17

7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	80,000.00	65,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行汇划费用	21,333.61	5,664.26
律师费	-	2,200.00
合计	239,333.61	210,864.26

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
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	-	-	11,232,110.00	1.03%

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	-	-	-	-
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
国海证券	10,460.46	1.09%	-	-

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	15,153,167.30	3,687,744.26
其中：支付销售机构的客户维护费	2,150,665.36	685,038.06

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 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	2,525,527.85	614,624.00

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 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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（2008 年 7 月 3 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	8,195,901.64	8,195,901.64
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	8,195,901.64	8,195,901.64
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.16%	4.26%

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国海富兰克林资产管理（上海）有限公司	8,195,901.64	1.16%	8,195,901.64	4.26%
国海证券股份有限公司	-	-	-	-
邓普顿国际股份有限公司（Templeton International, Inc.）	-	-	-	-
中国农业银行股份有限公司	-	-	-	-

注：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。

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
中国农业银行	390,673,603.12	1,370,605.65	86,388,901.52	230,920.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

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 8 月 3 日	2022 年 2 月 11 日	新股锁定	5.65	22.86	39,516	223,265.40	903,335.76	-
688176	亚虹医药	2021 年 12 月 29 日	2022 年 1 月 7 日	新股未上市	22.98	22.98	37,990	873,010.20	873,010.20	-
688105	诺唯赞	2021 年 11 月 5 日	2022 年 5 月 16 日	新股锁定	55.00	93.29	6,180	339,900.00	576,532.20	-
688230	芯导科技	2021 年 11 月 24 日	2022 年 6 月 1 日	新股锁定	134.81	130.31	2,594	349,697.14	338,024.14	-
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688248	南网	2021 年	2022	新股锁	12.24	18.90	11,763	143,979.12	222,320.70	-

	科技	12月14日	2021年6月22日	定						
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股锁定	60.66	96.75	995	60,356.70	96,266.25	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	116.88	116.08	766	89,530.08	88,917.28	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1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8月17日	2022年2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7月21日	2022年1月28日	新股锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股锁定	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1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9月1日	2022年3月9日	新股锁定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年5月23日	新股锁定	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6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6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6月28日	新股锁定	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3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6月20日	新股锁定	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-

301093	华兰股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股锁定	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301082	久盛电气	2021 年 10 月 14 日	2022 年 4 月 27 日	新股锁定	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
300994	久祺股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	新股锁定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301100	风光股份	2021 年 12 月 10 日	2022 年 6 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 9 月 6 日	2022 年 3 月 14 日	新股锁定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301088	戎美股份	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 28 日	新股锁定	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301091	深城交	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 29 日	新股锁定	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301101	明月镜片	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 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 6 月 24 日	新股锁定	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301118	恒光股份	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 18 日	新股锁定	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301108	洁雅股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 6 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 1 日	2022 年 6 月 8 日	新股锁定	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301089	拓新药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	新股锁定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301180	万祥科技	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 16 日	新股锁定	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-

		日	17 日							
301111	粤万年青	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股锁定	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301188	力诺特玻	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 11 日	新股锁定	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股锁定	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301199	迈赫股份	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股锁定	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁定	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301185	鸥玛软件	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 19 日	新股锁定	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301092	争光股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股锁定	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 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 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	新股锁定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
300774	倍杰特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 16 日	新股锁定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301078	孩子王	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 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 6 月 23 日	新股锁定	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301062	上海	2021 年	2022	新股锁	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-

	艾录	9月7日	年3月14日	定						
301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年2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7月6日	2022年1月24日	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3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8月4日	2022年2月14日	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5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6月2日	新股锁定	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股锁定	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年5月12日	新股锁定	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1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8月17日	2022年2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7月15日	2022年1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8月27日	2022年3月7日	新股锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-

301041	金百泽	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 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 9 月 22 日	2022 年 3 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 4 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 9 月 8 日	2022 年 3 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 9 月 9 日	2022 年 3 月 24 日	新股锁定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 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 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股锁定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 19 日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 30 日	新股锁定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股锁定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 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 4 月	新股锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

		日	19 日							
--	--	---	------	--	--	--	--	--	--	--

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 1 月 14 日	新债未上市	100.00	100.00	19,710	1,971,000.00	1,971,000.00	-

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，锁定期限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和债

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农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 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 0.09% (2020 年 12 月 31 日：本基金无固定收益品种投资)。

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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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、存出保证金和债券投资等。

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	390,673,603.12	-	-	-	390,673,603.12
结算备付金	2,874,882.42	-	-	-	2,874,882.42
存出保证金	274,024.88	-	-	-	274,024.88
交易性金融资产	-	-1,971,000.00	1,908,635,300.33	1,910,606,300.33	
应收利息	-	-	-	78,263.27	78,263.27
应收申购款	-	-	-	13,031,346.27	13,031,346.27
资产总计	393,822,510.42	-1,971,000.00	1,921,744,909.87	2,317,538,420.29	
负债					
应付证券清算款	-	-	-	24,944,552.20	24,944,552.20
应付赎回款	-	-	-	17,490,082.49	17,490,082.49
应付管理人报酬	-	-	-	2,538,754.98	2,538,754.98
应付托管费	-	-	-	423,125.85	423,125.85
应付交易费用	-	-	-	1,725,580.01	1,725,580.01
应交税费	-	-	-	54,000.00	54,000.00
其他负债	-	-	-	282,613.25	282,613.25
负债总计	-	-	-	47,458,708.78	47,458,708.78
利率敏感度缺口	393,822,510.42	-1,971,000.00	1,874,286,201.09	2,270,079,711.51	
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	86,388,901.52	-	-	-	86,388,901.52
结算备付金	128,186.64	-	-	-	128,186.64
存出保证金	92,869.75	-	-	-	92,869.75

交易性金融资产	-	-	-	428,776,542.29	428,776,542.29
应收利息	-	-	-	18,919.12	18,919.12
应收申购款	-	-	-	661,134.69	661,134.69
资产总计	86,609,957.91	-	-	429,456,596.10	516,066,554.01
负债					
应付证券清算款	-	-	-	9,032,293.39	9,032,293.39
应付赎回款	-	-	-	609,891.96	609,891.96
应付管理人报酬	-	-	-	503,665.40	503,665.40
应付托管费	-	-	-	83,944.22	83,944.22
应付交易费用	-	-	-	270,581.77	270,581.77
应交税费	-	-	-	54,000.02	54,000.02
其他负债	-	-	-	191,104.21	191,104.21
负债总计	-	-	-	10,745,480.97	10,745,480.97
利率敏感度缺口	86,609,957.91	-	-	418,711,115.13	505,321,073.04

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 0.09%(2020 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券、现金及其它短期金融工具为 5%-40%，其中每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，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。

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	1,908,635,300.33	84.08	428,776,542.29	84.85
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	1,908,635,300.33	84.08	428,776,542.29	84.85

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		
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 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 11,966	增加约 2,931

	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 11,966	减少约 2,931
--	----------------	------------	-----------

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 1,904,246,230.88 元，属于第二层次的余额为 3,224,239.55 元，属于第三层次的余额为 3,135,829.90 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次 424,582,940.69 元，第二层次 4,193,601.60 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；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 3,135,829.90(2020 年 12 月 31 日：无)。于 2021 年度，本基金购买第三层次金融工具 1,721,738.14 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 1,414,091.76 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 1,414,091.76 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 3,135,829.90 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	1,908,635,300.33	82.36
	其中：股票	1,908,635,300.33	82.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,971,000.00	0.09
	其中：债券	1,971,000.00	0.09
	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	393,548,485.54	16.98
8	其他各项资产	13,383,634.42	0.58
9	合计	2,317,538,420.29	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	37,239,210.00	1.64
B	采矿业	71,546,561.90	3.15
C	制造业	1,257,041,766.41	55.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	185,027,692.99	8.15
E	建筑业	20,177,519.99	0.89
F	批发和零售业	177,627.66	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,591,290.03	2.67
J	金融业	252,944,101.51	11.14
K	房地产业	9,935,991.00	0.44
L	租赁和商务服务业	12,901,308.00	0.57
M	科学研究和技术服务业	961,699.76	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	0.00

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	46,409.59	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,908,635,300.33	84.08

注：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”。

8.2.2 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。

8.3 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	002001	新 和 成	2,529,939	78,731,701.68	3.47
2	002648	卫星化学	1,537,140	61,531,714.20	2.71
3	300059	东方财富	1,487,968	55,218,492.48	2.43
4	601985	中国核电	6,038,587	50,120,272.10	2.21
5	600900	长江电力	2,072,214	47,039,257.80	2.07
6	600519	贵州茅台	22,012	45,124,600.00	1.99
7	002028	思源电气	906,200	44,594,102.00	1.96
8	002756	永兴材料	299,800	44,376,396.00	1.95
9	600036	招商银行	886,155	43,164,610.05	1.90
10	601677	明泰铝业	936,800	41,303,512.00	1.82
11	603728	鸣志电器	1,726,298	40,930,525.58	1.80
12	300751	迈为股份	61,380	39,424,374.00	1.74
13	300750	宁德时代	66,900	39,337,200.00	1.73
14	600406	国电南瑞	977,692	39,137,010.76	1.72
15	600030	中信证券	1,475,300	38,962,673.00	1.72
16	300274	阳光电源	257,200	37,499,760.00	1.65
17	000887	中鼎股份	1,716,000	37,425,960.00	1.65
18	300498	温氏股份	1,933,500	37,239,210.00	1.64
19	000568	泸州老窖	142,400	36,151,088.00	1.59
20	600483	福能股份	2,201,607	35,842,161.96	1.58
21	601012	隆基股份	378,826	32,654,801.20	1.44

22	002271	东方雨虹	601,182	31,670,267.76	1.40
23	002568	百润股份	522,600	31,267,158.00	1.38
24	601966	玲珑轮胎	850,095	31,070,972.25	1.37
25	600745	闻泰科技	233,400	30,178,620.00	1.33
26	601799	星宇股份	142,800	29,166,900.00	1.28
27	600988	赤峰黄金	1,937,971	28,875,767.90	1.27
28	600011	华能国际	2,844,500	27,563,205.00	1.21
29	603960	克来机电	735,900	26,772,042.00	1.18
30	600031	三一重工	1,156,500	26,368,200.00	1.16
31	600989	宝丰能源	1,501,700	26,069,512.00	1.15
32	600919	江苏银行	4,440,300	25,886,949.00	1.14
33	688599	天合光能	324,776	25,624,826.40	1.13
34	002216	三全食品	1,260,030	25,465,206.30	1.12
35	002466	天齐锂业	236,700	25,326,900.00	1.12
36	603606	东方电缆	492,700	25,206,532.00	1.11
37	600905	三峡能源	3,257,363	24,462,796.13	1.08
38	605376	博迁新材	282,400	23,730,072.00	1.05
39	000012	南玻A	2,382,500	23,658,225.00	1.04
40	601899	紫金矿业	2,411,800	23,394,460.00	1.03
41	000776	广发证券	939,830	23,110,419.70	1.02
42	300207	欣旺达	541,300	22,821,208.00	1.01
43	002475	立讯精密	453,800	22,326,960.00	0.98
44	002142	宁波银行	576,520	22,069,185.60	0.97
45	300286	安科瑞	640,400	21,248,472.00	0.94
46	000932	华菱钢铁	4,113,300	21,018,963.00	0.93
47	603039	泛微网络	300,550	20,969,373.50	0.92
48	300776	帝尔激光	81,160	20,768,844.00	0.91
49	601117	中国化学	1,680,500	20,166,000.00	0.89
50	601658	邮储银行	3,834,400	19,555,440.00	0.86
51	601898	中煤能源	3,064,600	19,276,334.00	0.85
52	600702	舍得酒业	82,100	18,661,330.00	0.82
53	601838	成都银行	1,528,600	18,343,200.00	0.81
54	002011	盾安环境	1,125,600	15,420,720.00	0.68
55	600111	北方稀土	327,000	14,976,600.00	0.66
56	300014	亿纬锂能	123,800	14,630,684.00	0.64
57	002825	纳尔股份	625,300	14,156,792.00	0.62
58	300490	华自科技	629,900	14,134,956.00	0.62
59	002643	万润股份	581,530	13,747,369.20	0.61
60	300308	中际旭创	307,100	13,051,750.00	0.57

61	601888	中国中免	58,800	12,901,308.00	0.57
62	002594	比亚迪	46,900	12,574,828.00	0.55
63	002585	双星新材	450,727	12,205,687.16	0.54
64	000338	潍柴动力	679,705	12,159,922.45	0.54
65	600048	保利发展	635,700	9,935,991.00	0.44
66	600438	通威股份	219,600	9,873,216.00	0.43
67	000403	派林生物	308,139	8,637,136.17	0.38
68	601318	中国平安	130,200	6,563,382.00	0.29
69	002459	晶澳科技	70,300	6,516,810.00	0.29
70	600875	东方电气	210,400	4,506,768.00	0.20
71	688779	长远锂科	39,516	903,335.76	0.04
72	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.04
73	688105	诺唯赞	6,180	576,532.20	0.03
74	688230	芯导科技	2,594	338,024.14	0.01
75	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
76	688248	南网科技	11,763	222,320.70	0.01
77	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.01
78	688236	春立医疗	4,052	110,984.28	0.00
79	301155	海力风电	995	96,266.25	0.00
80	301177	迪阿股份	766	88,917.28	0.00
81	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
82	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.00
83	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
84	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
85	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
86	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
87	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
88	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
89	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
90	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
91	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
92	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
93	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
94	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
95	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
96	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
97	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
98	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
99	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00

100	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
101	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
102	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
103	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
104	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
105	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
106	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
107	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
108	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
109	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
110	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
111	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
112	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
113	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
114	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
115	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
116	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
117	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
118	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
119	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
120	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
121	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
122	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
123	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
124	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
125	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
126	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
127	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
128	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
129	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
130	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
131	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
132	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
133	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
134	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
135	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
136	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
137	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
138	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00

139	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
140	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
141	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
142	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
143	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
144	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
145	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
146	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
147	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
148	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
149	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
150	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
151	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
152	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
153	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
154	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

注：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”。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002001	新 和 成	79,415,854.20	15.72
2	601677	明泰铝业	55,140,916.90	10.91
3	600900	长江电力	49,978,869.11	9.89
4	601985	中国核电	45,891,110.19	9.08
5	002756	永兴材料	43,635,869.80	8.64
6	300751	迈为股份	42,946,997.32	8.50
7	603728	鸣志电器	42,640,011.56	8.44
8	300059	东方财富	40,251,957.58	7.97
9	002648	卫星化学	38,338,348.07	7.59
10	600030	中信证券	38,188,006.42	7.56
11	600036	招商银行	38,025,371.68	7.52
12	000887	中鼎股份	36,506,395.06	7.22

13	600519	贵州茅台	36,066,235.74	7.14
14	300498	温氏股份	35,724,046.66	7.07
15	002028	思源电气	34,032,097.00	6.73
16	300750	宁德时代	33,591,726.40	6.65
17	000568	泸州老窖	33,571,270.86	6.64
18	002568	百润股份	33,195,467.26	6.57
19	600406	国电南瑞	32,301,838.00	6.39
20	600745	闻泰科技	31,592,743.00	6.25
21	600988	赤峰黄金	30,726,728.71	6.08
22	601799	星宇股份	30,554,792.54	6.05
23	000932	华菱钢铁	30,233,205.00	5.98
24	600483	福能股份	30,020,434.35	5.94
25	600989	宝丰能源	29,441,583.45	5.83
26	600919	江苏银行	28,337,656.00	5.61
27	600702	舍得酒业	28,280,839.00	5.60
28	603960	克来机电	27,244,573.00	5.39
29	300207	欣旺达	27,081,936.00	5.36
30	002466	天齐锂业	26,553,359.00	5.25
31	601669	中国电建	25,558,501.98	5.06
32	600011	华能国际	25,445,390.00	5.04
33	605376	博迁新材	25,366,481.10	5.02
34	002216	三全食品	24,960,839.20	4.94
35	000012	南玻A	24,950,206.35	4.94
36	002460	赣锋锂业	24,622,399.48	4.87
37	603606	东方电缆	24,089,897.87	4.77
38	000776	广发证券	23,381,288.80	4.63
39	600438	通威股份	23,244,387.00	4.60
40	002714	牧原股份	23,169,631.00	4.59
41	601966	玲珑轮胎	22,968,304.89	4.55
42	601225	陕西煤业	22,936,723.00	4.54
43	600111	北方稀土	22,800,472.00	4.51
44	600323	瀚蓝环境	22,593,782.37	4.47
45	688599	天合光能	22,024,644.98	4.36
46	300274	阳光电源	21,690,734.00	4.29
47	300286	安科瑞	21,585,311.00	4.27
48	600886	国投电力	21,488,416.00	4.25

49	600031	三一重工	21,334,189.68	4.22
50	000301	东方盛虹	21,192,635.38	4.19
51	601898	中煤能源	20,871,110.00	4.13
52	601117	中国化学	20,405,767.00	4.04
53	600905	三峡能源	20,229,013.95	4.00
54	600958	东方证券	20,032,099.00	3.96
55	603039	泛微网络	19,850,154.76	3.93
56	000422	湖北宜化	19,831,342.00	3.92
57	601658	邮储银行	19,777,893.79	3.91
58	002475	立讯精密	19,624,196.86	3.88
59	000651	格力电器	19,571,922.00	3.87
60	300490	华自科技	19,452,160.82	3.85
61	002080	中材科技	18,740,551.72	3.71
62	600809	山西汾酒	18,553,620.60	3.67
63	601012	隆基股份	18,323,504.12	3.63
64	600426	华鲁恒升	17,374,047.50	3.44
65	002271	东方雨虹	16,939,318.50	3.35
66	601888	中国中免	16,866,189.00	3.34
67	601899	紫金矿业	16,610,616.58	3.29
68	002812	恩捷股份	16,157,405.63	3.20
69	300850	新强联	16,126,260.25	3.19
70	601838	成都银行	15,888,534.00	3.14
71	002011	盾安环境	15,600,366.00	3.09
72	000338	潍柴动力	15,462,140.00	3.06
73	688008	澜起科技	15,385,853.94	3.04
74	300343	联创股份	15,108,000.78	2.99
75	002142	宁波银行	14,648,822.40	2.90
76	603260	合盛硅业	14,617,456.00	2.89
77	002825	纳尔股份	14,555,019.00	2.88
78	601636	旗滨集团	14,333,579.64	2.84
79	300124	汇川技术	13,920,542.05	2.75
80	601088	中国神华	13,709,073.00	2.71
81	600570	恒生电子	13,645,761.20	2.70
82	600585	海螺水泥	13,474,622.00	2.67
83	002643	万润股份	13,345,561.50	2.64
84	002459	晶澳科技	13,282,222.18	2.63

85	300776	帝尔激光	13,224,484.00	2.62
86	600461	洪城环境	12,534,121.00	2.48
87	002386	天原股份	12,470,968.00	2.47
88	002706	良信股份	12,237,806.70	2.42
89	300003	乐普医疗	12,236,487.00	2.42
90	601058	赛轮轮胎	11,885,941.00	2.35
91	300122	智飞生物	11,723,479.00	2.32
92	002585	双星新材	11,674,338.00	2.31
93	300308	中际旭创	11,495,643.82	2.27
94	000656	金科股份	11,299,799.00	2.24
95	603799	华友钴业	11,126,305.91	2.20
96	600048	保利发展	11,079,923.00	2.19
97	000002	万科A	11,035,349.44	2.18
98	003022	联泓新科	10,983,886.00	2.17
99	002493	荣盛石化	10,927,346.00	2.16
100	600887	伊利股份	10,567,220.12	2.09
101	300769	德方纳米	10,216,067.00	2.02
102	600546	山煤国际	10,206,443.00	2.02

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。

8.4.2 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	000422	湖北宜化	44,625,066.53	8.83
2	601669	中国电建	28,571,893.00	5.65
3	300343	联创股份	26,868,243.60	5.32
4	601225	陕西煤业	24,497,801.59	4.85
5	002714	牧原股份	24,291,622.54	4.81
6	603260	合盛硅业	23,384,763.88	4.63
7	000651	格力电器	23,131,169.00	4.58
8	002460	赣锋锂业	23,122,162.00	4.58
9	000301	东方盛虹	22,409,381.82	4.43
10	300274	阳光电源	22,017,299.59	4.36
11	300850	新强联	21,598,561.00	4.27
12	600887	伊利股份	21,075,764.57	4.17

13	600958	东方证券	20,769,758.00	4.11
14	002601	龙佰集团	19,960,786.10	3.95
15	600323	瀚蓝环境	19,601,228.20	3.88
16	601677	明泰铝业	19,106,273.40	3.78
17	600886	国投电力	18,697,482.00	3.70
18	002812	恩捷股份	18,394,361.70	3.64
19	600600	青岛啤酒	17,999,094.02	3.56
20	601166	兴业银行	16,676,452.44	3.30
21	601636	旗滨集团	16,418,671.11	3.25
22	600809	山西汾酒	16,296,590.20	3.22
23	002080	中材科技	16,257,301.04	3.22
24	600426	华鲁恒升	15,378,604.00	3.04
25	601012	隆基股份	15,126,727.11	2.99
26	002064	华峰化学	15,042,808.00	2.98
27	002459	晶澳科技	14,790,984.00	2.93
28	300124	汇川技术	14,661,031.00	2.90
29	688008	澜起科技	14,593,825.78	2.89
30	000338	潍柴动力	14,359,374.00	2.84
31	600570	恒生电子	13,849,800.68	2.74
32	600011	华能国际	13,424,188.74	2.66
33	003022	联泓新科	13,373,126.00	2.65
34	300750	宁德时代	13,284,557.00	2.63
35	601088	中国神华	12,950,874.00	2.56
36	600461	洪城环境	12,825,194.00	2.54
37	000858	五粮液	12,566,732.00	2.49
38	688122	西部超导	12,464,972.93	2.47
39	002386	天原股份	12,437,616.00	2.46
40	600660	福耀玻璃	12,411,523.00	2.46
41	600438	通威股份	12,262,931.00	2.43
42	002706	良信股份	12,209,769.30	2.42
43	300003	乐普医疗	11,882,681.00	2.35
44	601058	赛轮轮胎	11,776,430.00	2.33
45	002304	洋河股份	11,499,540.50	2.28
46	603799	华友钴业	10,684,317.00	2.11
47	000830	鲁西化工	10,639,845.00	2.11
48	600585	海螺水泥	10,630,108.00	2.10
49	600499	科达制造	10,374,801.00	2.05
50	002709	天赐材料	10,266,988.60	2.03

51	300769	德方纳米	10,188,126.00	2.02
----	--------	------	---------------	------

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。

8.4.3 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	2,819,703,627.36
卖出股票收入（成交）总额	1,511,515,331.51

注：买入股票成本及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。

8.5 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	-	-
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）	1,971,000.00	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,971,000.00	0.09

8.6 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	113052	兴业转债	19,710	1,971,000.00	0.09

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	274,024.88

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	78,263.27
5	应收申购款	13,031,346.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,383,634.42

8.12.4 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。

8.12.5 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
208,523	3,398.25	554,525,750.36	78.26%	154,086,586.41	21.74%

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	402,214.07	0.056761%

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2008 年 7 月 3 日 ）基金份额总额	759,210,671.71
本报告期期初基金份额总额	192,442,701.40
本报告期基金总申购份额	725,185,159.70
减:本报告期基金总赎回份额	209,015,524.33
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	708,612,336.77

§ 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 80,000.00 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）基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

（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	
兴业证券	1	566,656,635.26	13.21%	527,725.56	13.96%	—
天风证券	1	489,816,759.15	11.42%	358,202.38	9.48%	—
中金公司	2	451,832,896.05	10.53%	420,786.54	11.13%	—
安信证券	2	431,853,380.36	10.07%	402,181.53	10.64%	—
高华证券	1	421,752,239.34	9.83%	392,780.02	10.39%	—
中泰证券	2	412,459,017.00	9.61%	307,557.08	8.14%	—
中信证券	2	411,777,558.18	9.60%	383,490.89	10.15%	—
东兴证券	1	248,586,829.24	5.79%	231,509.52	6.13%	—
方正证券	1	230,003,420.14	5.36%	214,202.94	5.67%	—
西藏东方财富证券	2	185,683,663.29	4.33%	135,791.30	3.59%	—
国泰君安	1	125,282,837.55	2.92%	116,675.68	3.09%	—
华泰证券	2	106,573,785.41	2.48%	99,251.35	2.63%	—
中信建投	1	63,362,640.20	1.48%	59,149.22	1.57%	—
海通证券	1	43,951,529.31	1.02%	40,931.68	1.08%	—
华安证券	1	32,600,579.00	0.76%	30,361.14	0.80%	—
东北证券	1	24,087,775.95	0.56%	22,432.98	0.59%	—
国盛证券	1	22,670,233.76	0.53%	16,576.08	0.44%	—
招商证券	1	21,210,136.47	0.49%	19,752.58	0.52%	—
银河证券	1	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—
西南证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
第一创业	1	—	—	—	—	—

国海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	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	
	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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	630,816.99	75.23%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
海通证券	207,755.00	24.77%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

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	关于在招商银行招赢通平台开通公司旗下部分基金销售业务并参加其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 1 月 21 日
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 年 1 月 22 日
3	富兰克林国海深化价值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 年 1 月 22 日
4	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
5	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
6	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加华夏银行股份有限公司	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 3 月 17 日

	有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告		
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 年 3 月 22 日
8	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加宁波银行股份有限公司申购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 25 日
9	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 26 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	富兰克林国海深化价值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 年 3 月 31 日
12	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 年 4 月 21 日
13	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
14	富兰克林国海深化价值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 年 4 月 21 日

15	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 年 5 月 18 日
16	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西部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 年 5 月 19 日
17	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 年 5 月 19 日
18	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动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 5 月 21 日
19	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 年 5 月 22 日
20	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股票的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 5 月 29 日
21	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公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 6 月 15 日

22	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 年 6 月 24 日
23	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 年 6 月 30 日
24	富兰克林国海深化价值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 年 6 月 30 日
25	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 年 7 月 9 日
26	富兰克林国海深化价值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 年 7 月 21 日
27	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 7 月 21 日
28	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 年 7 月 31 日
29	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	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 7 月 31 日

	证券股份有限公司费率优惠活动的公告		
30	国海富兰克林基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低申购金额、最低定期定额投资金额、最低赎回份额、最低基金转换份额、最低转托管份额以及最低持有份额限制的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 8 月 13 日
31	关于增加平安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 年 8 月 16 日
32	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活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021 年 8 月 27 日
33	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 年 8 月 31 日
34	富兰克林国海深化价值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 年 8 月 31 日
35	富兰克林国海深化价值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 年 9 月 10 日
36	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 年 9 月 28 日

37	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国光大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 年 10 月 13 日
38	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 年 10 月 15 日
39	关于增加平安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 年 10 月 22 日
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 年 10 月 22 日
41	富兰克林国海深化价值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 年 10 月 27 日
42	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 10 月 27 日
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国信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 年 11 月 5 日
44	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 年 12 月 4 日
45	关于增加上海银行股份有限公司	中国证监会指定报	2021 年 12 月 14 日

	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	刊及指定网站	
46	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 年 12 月 21 日

§ 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深化价值股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金合同》；
- 3、《富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海深化价值股票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