

富兰克林国海大中华精选混合型证券投资
基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	39
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	39
7.4 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	39

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	45
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	49
7.7 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	49
7.8 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	49
7.9 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	49
7.10 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	49
7.11 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	57
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	799,380,930.02 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) × 60% + 同期人民币一年期定期存款利率（税后）× 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	储丽莉	任航
	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	南宁高新区中国-东盟企业总部基地三期综合楼 A 座 17 层 1707 室	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	刘峻	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 Street, New York, New York 10286 USA
办公地址		-	240 Greenwich Street, 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.6 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	260,925,121.99
本期利润	351,422,160.42
加权平均基金份额本期利润	0.4080
本期加权平均净值利润率	18.60%
本期基金份额净值增长率	20.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	417,770,359.18
期末可供分配基金份额利润	0.5226
期末基金资产净值	1,945,702,273.21

期末基金份额净值	2.434
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	143.40%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 0.3400 美元。

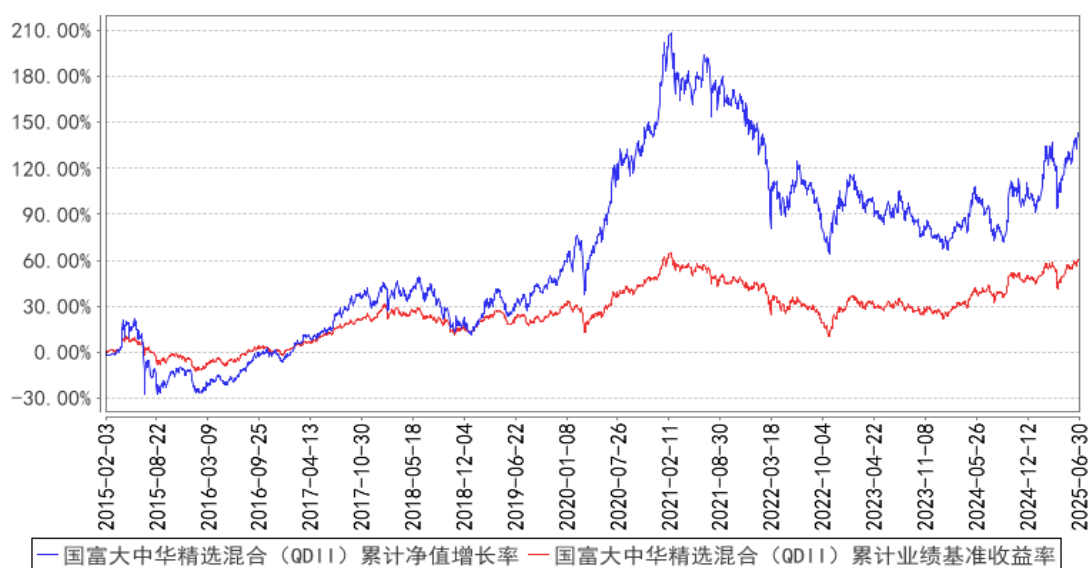
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	9.05%	1.07%	3.02%	0.59%	6.03%	0.48%
过去三个月	11.29%	1.94%	4.29%	1.17%	7.00%	0.77%
过去六个月	20.08%	1.82%	7.06%	0.98%	13.02%	0.84%
过去一年	27.70%	1.61%	13.91%	0.85%	13.79%	0.76%
过去三年	10.19%	1.39%	18.85%	0.79%	-8.66%	0.60%
自基金合同生效起至今	143.40%	1.51%	59.00%	0.73%	84.40%	0.78%

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. 上述对比图展示的是人民币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。

§ 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 75 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 2025 年 6 月末，公司旗下合计管理 47 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、国富美元债一年持有期债券 (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	2015 年 12 月 24 日	-	19 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、国富美元债一年持有期债券 (QDII) 基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金、国富全球科技互联混合 (QDII) 基金及国富港股通远见价值混合基金的基金经理。

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

2. 表中“证券从业年限”的计算标准为该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 公平交易制度的执行情况

报告期内公司严格执行《公平交易管理制度》，明确了公平交易的原则和目标，制订了实现公平交易的具体措施，并在技术上按照公平交易原则实现了严格的交易公平分配。

报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。

报告期内公司不存在投资组合之间发生交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，港股市场涨势强劲，恒生指数上涨 20%左右。从板块表现来看，科技、创新药、新消费、以及高股息板块表现突出。而地产和能源等行业指数则相对滞后，在市场的板块轮动中暂处下风。中国台湾市场科技在 2 季度表现亮眼。

本基金在上半年基本维持均衡偏成长的策略，相对看好数字经济、硬科技、医药和消费，但同时也配置了公共事业、上游资源等板块。数字经济：未来增长空间较大、估值相对便宜、盈利逐步复苏；硬科技：受益于 AI 的运用、技术含量较高且有较高的准入门槛；医药：新药研发有所突破，政策也有支持；公共事业：未来几年盈利相对较为稳定，股息率较高；上游资源：受益于需求改善、估值相对偏低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.434 元，本报告期内份额净值上涨 20.08%，同期业绩基准上涨 7.06%，跑赢业绩比较基准 13.02%。

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 2025 年下半年，我们秉持着谨慎乐观的态度来看待港股市场，这主要基于以下几方面：

一是宏观政策方面，2025 年，货币政策与财政政策仍将形成合力，继续拉动经济高质量增长。扩内需、稳楼市、稳股市依旧是核心看点，一系列政策举措将为市场营造更为有利的发展环境。事实上，当下部分宏观和行业数据已初现积极变化的端倪，财新制造业采购经理人指数（PMI）在

上半年的 6 个月中有 5 个月站稳 50 荣枯线之上,这些都为经济的持续复苏提供了有力的证据支持。2025 年下半年,经济增长的风险点主要集中在出口领域,出口表现是否会低于预期或将成为影响经济增长的一个重要变数。

二是企业盈利方面,2025 年上半年,上市公司整体业绩有所改善,企业盈利整体稳定。展望 2025 年下半年,随着利好政策的继续发酵,企业盈利有望在政策的拉动下实现同比改善。尤其是那些在各自领域具备核心竞争力的公司,将成为市场的亮点,尤其在科技领域(涵盖多个细分板块)、生物医药、新消费、互联网、以及中高端的自动化和机械等行业。

三是流动性方面,2025 年 1 季度美国新政府上台后的一系列政策举措,包括关税、移民等政策的调整可能对美国国内通胀水平的影响产生一定影响;但是能源价格目前有所回落。考虑到美国经济面临的增长压力,目前市场普遍预期美联储下半年有望降息。南下资金对港股的青睐仍将为港股市场提供源源不断的流动性。

四是估值方面,尽管 2025 年上半年港股市场表现可圈可点,但与全球主要市场(如美国、日本、印度等)相比,其估值仍存在较大的差距,这也意味着港股市场存在着较大的估值修复空间。实际上,中国拥有一批在全球市场上极具核心竞争力的优秀企业,这些企业的价值在当前市场环境下可能被低估,蕴含着一定的投资潜力。此外,高股息的公司在低利率环境下也具有较强的吸引力,为投资者提供了稳定的现金流回报,成为市场中的避险港湾和价值投资的优选标的。

综合考量当前港股市场的低估值优势以及国内政策的持续推进,我们认为港股有望在 2025 年有望延续震荡上涨的良好态势。在投资策略方面,重点关注数字经济、硬科技、电信、公共事业、消费和医药、以及出口相关公司等领域。同时,积极挖掘具有增长潜力的个股,把握市场的结构性投资机会。同时本基金也将关注中国台湾等市场的科技股。

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,争取未来更好的长期投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程,按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会(简称“估值委员会”),并已制订了《投资产品估值管理办法》。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务,确保基金估值的公允、合理,保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由总经理或其任命者负责,成员包括投研、风险控制、监察稽核、交易、基金核算方面的部门主管,相关人员均具有丰富的证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大

化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未分配的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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报告期内基金的投资运作，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，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中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	190,939,997.95	124,928,969.14

结算备付金		15,712,721.71	34,261,054.47
存出保证金		39,543.13	146,537.01
交易性金融资产	6.4.7.2	1,810,341,269.81	1,762,183,827.81
其中：股票投资		1,711,865,490.30	1,666,896,927.53
基金投资		—	—
债券投资		98,475,779.51	95,286,900.28
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
债权投资	6.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	6.4.7.6	—	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—	—
应收清算款		12,234,701.12	20,698,428.62
应收股利		7,897,093.58	1,428,099.03
应收申购款		1,237,253.84	912,230.70
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	311,023.77	16,471,731.18
资产总计		2,038,713,604.91	1,961,030,877.96
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		74,367,776.49	62,790,632.45
应付赎回款		15,169,714.53	7,992,195.02
应付管理人报酬		1,868,376.13	2,390,125.04
应付托管费		311,396.02	430,222.50
应付销售服务费		—	—
应付投资顾问费		—	—
应交税费		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.9	1,294,068.53	18,043,069.44
负债合计		93,011,331.70	91,646,244.45
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	799,380,930.02	922,209,800.97
其他综合收益	6.4.7.11	—	—

未分配利润	6.4.7.12	1,146,321,343.19	947,174,832.54
净资产合计		1,945,702,273.21	1,869,384,633.51
负债和净资产总计		2,038,713,604.91	1,961,030,877.96

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 799,380,930.02 份，其中国富大中华精选混合基金人民币份额 745,369,451.28 份，份额净值人民币 2.434 元；国富大中华精选混合基金美元份额为 54,011,478.74 份，份额净值美元 0.3400 元。

6.2 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		366,060,059.78	145,308,307.02
1. 利息收入		650,907.41	1,081,541.58
其中：存款利息收入	6.4.7.13	650,907.41	1,077,933.36
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,608.22
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		274,961,072.51	115,572,727.76
其中：股票投资收益	6.4.7.14	259,422,173.69	98,763,891.15
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	223,300.32	725,553.38
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	15,315,598.50	16,083,283.23
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	90,497,038.43	29,742,811.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-347,139.49	-1,169,392.49
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	298,180.92	80,618.72
减：二、营业总支出		14,637,899.36	15,616,739.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,173,102.02	13,045,669.59

2. 托管费	6.4.10.2.2	2,092,154.76	2,348,220.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	—	—
4. 投资顾问费		—	—
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 信用减值损失	6.4.7.23	—	—
7. 税金及附加		—	—
8. 其他费用	6.4.7.24	372,642.58	222,849.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		351,422,160.42	129,691,567.69
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		351,422,160.42	129,691,567.69
五、其他综合收益的税后净额		—	—
六、综合收益总额		351,422,160.42	129,691,567.69

6.3 净资产变动表

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	922,209,800.97	—	947,174,832.54	1,869,384,633.51
加：会计政策变更	—	—	—	—
前期差错更正	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
二、本期期初净资产	922,209,800.97	—	947,174,832.54	1,869,384,633.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-122,828,870.95	—	199,146,510.65	76,317,639.70
（一）、综合收益总额	—	—	351,422,160.42	351,422,160.42
（二）、本期基金份额交易产生的	-122,828,870.9	—	-152,275,649.7	-275,104,520.72

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)	5		7	
其中：1. 基金申 购款	33,290,860.38	-	40,735,564.98	74,026,425.36
2. 基金赎 回款	-156,119,731.3 3	-	-193,011,214.7 5	-349,130,946.08
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动(净资 产减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	799,380,930.02	-	1,146,321,343. 19	1,945,702,273.2 1
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产	950,819,994.15	-	731,846,366.28	1,682,666,360.4 3
加：会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产	950,819,994.15	-	731,846,366.28	1,682,666,360.4 3
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	-1,141,165.58	-	129,022,433.50	127,881,267.92
(一)、综合收益 总额	-	-	129,691,567.69	129,691,567.69
(二)、本期基金 份额交易产生的 净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)	-1,141,165.58	-	-669,134.19	-1,810,299.77

其中：1. 基金申购款	82,460,315.37	-	68,508,922.58	150,969,237.95
2. 基金赎回款	-83,601,480.95	-	-69,178,056.77	-152,779,537.72
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	949,678,828.57	-	860,868,799.78	1,810,547,628.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 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》注册，由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海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 and 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) 上市公司中最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 and 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) $\times$ 60% + 同期人民币一年期定期存款利率（税后） $\times$ 40%。

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 2025 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定；

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加；

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，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

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，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	190,939,997.95
等于：本金	190,930,707.30
加：应计利息	9,290.65
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	190,939,997.95

注：于 2025 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 82,887,931.62 元，含应计利息 9,244.83，美元活期存款 8,745,552.66 元（折合人民币 62,605,913.28 元），含应计利息 6.40 元（折合人民币 45.82 元），新台币活期存款 185,584,806.00 元（折合人民币 45,446,153.05 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1, 526, 510, 613. 16	-	1, 711, 865, 490. 30	185, 354, 877. 14
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	97, 873, 484. 58	885, 539. 51	98, 475, 779. 51	-283, 244. 58
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	97, 873, 484. 58	885, 539. 51	98, 475, 779. 51	-283, 244. 58
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1, 624, 384, 097. 74	885, 539. 51	1, 810, 341, 269. 81	185, 071, 632. 56

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	311,023.77
待摊费用	-
合计	311,023.77

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10,768.05
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	871,057.34
其中：交易所市场	871,057.34
银行间市场	-
应付利息	-
审计费用	37,191.88
信息披露费	59,507.37
债券账户维护费	4,500.00
应付未起息外汇交易	311,043.89
合计	1,294,068.53

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	922,209,800.97	922,209,800.97
本期申购	33,290,860.38	33,290,860.38
本期赎回（以“-”号填列）	-156,119,731.33	-156,119,731.33
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	799,380,930.02	799,380,930.02

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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	200,587,621.33	746,587,211.21	947,174,832.54
本期期初	200,587,621.33	746,587,211.21	947,174,832.54
本期利润	260,925,121.99	90,497,038.43	351,422,160.42
本期基金份额交易产生的变动数	-43,742,384.14	-108,533,265.63	-152,275,649.77
其中：基	12,376,984.74	28,358,580.24	40,735,564.98

金申购款			
基金赎回款	-56,119,368.88	-136,891,845.87	-193,011,214.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	417,770,359.18	728,550,984.01	1,146,321,343.19

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	615,046.37
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	35,526.86
其他	334.18
合计	650,907.41

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	259,422,173.69
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	259,422,173.69

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,501,245,750.20
减：卖出股票成本总额	5,227,286,158.33
减：交易费用	14,537,418.18
买卖股票差价收入	259,422,173.69

6.4.7.15 基金投资收益

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	659,996.23
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-436,695.91
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	223,300.32

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	116,843,725.27
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	115,318,350.91
减：应计利息总额	1,962,070.27
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	-436,695.91

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	15,315,598.50
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	15,315,598.50

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	90,497,038.43
股票投资	90,504,487.52
债券投资	-7,449.09
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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	90,497,038.43

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	298,180.92
合计	298,180.92

注：1、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、基金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。

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	37,191.88

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
债券账户维护费	9,000.00
银行汇划费用	13,384.96
证券组合费	33,076.29
其他手续费	220,482.08
合计	372,642.58

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
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”）	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,173,102.02	13,045,669.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,455,534.77	4,951,204.09
应支付基金管理人的净管理费	7,717,567.25	8,094,465.50

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。

根据与基金托管人协商一致的《国海富兰克林基金管理有限公司关于调整旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2025 年 3 月 3 日起，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 1.20% 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×1.20%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,092,154.76	2,348,220.46

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：日托管费＝前一日基金资产净值×0.27%÷当年天数。

根据与基金托管人协商一致的《国海富兰克林基金管理有限公司关于调整旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2025 年 3 月 3 日起，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 0.20% 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×0.20%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	10,545,688.44	10,545,688.44
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	10,545,688.44	-
报告期末持有的基金份额	-	10,545,688.44
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	1.11%

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。

6.4.10.5.2 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（2024 年 12 月 31 日）除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
纽约梅隆银行股份有限公司	105,312,355.78	386,010.91	106,546,280.57	679,070.76

中国农业银行	85,627,642.17	229,035.46	42,606,750.10	257,462.70
--------	---------------	------------	---------------	------------

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常投资管理中面临的与各种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等。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及绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，主要是发掘各类风险的风险点，判断风险发生的频度和损失，对风险实行分级管理。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的分析报告，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时对各种风险进行监控和评估，并通过风险处置流程，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格、合格境外机构投资者托管人资格或其他经管理人评估资质良好的商业银行，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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性

风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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%。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，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%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，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。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
货币资金	190,939,997.95	-	-	-	190,939,997.95
结算备付金	15,712,721.71	-	-	-	15,712,721.71
存出保证金	39,543.13	-	-	-	39,543.13
交易性金融资产	98,475,779.51	-	-	-1,711,865,490.30	1,810,341,269.81
应收股利	-	-	-	7,897,093.58	7,897,093.58
应收申购款	-	-	-	1,237,253.84	1,237,253.84
应收清算款	-	-	-	12,234,701.12	12,234,701.12
其他资产	-	-	-	311,023.77	311,023.77
资产总计	305,168,042.30	-	-	-1,733,545,562.61	2,038,713,604.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,169,714.53	15,169,714.53
应付管理人报酬	-	-	-	1,868,376.13	1,868,376.13
应付托管费	-	-	-	311,396.02	311,396.02
应付清算款	-	-	-	74,367,776.49	74,367,776.49
其他负债	-	-	-	1,294,068.53	1,294,068.53
负债总计	-	-	-	93,011,331.70	93,011,331.70
利率敏感度缺口	305,168,042.30	-	-	-1,640,534,230.91	1,945,702,273.21
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	124,928,969.14	-	-	-	124,928,969.14
结算备付金	34,261,054.47	-	-	-	34,261,054.47
存出保证金	146,537.01	-	-	-	146,537.01
交易性金融资产	95,286,900.28	-	-	-1,666,896,927.53	1,762,183,827.81
应收股利	-	-	-	1,428,099.03	1,428,099.03
应收申购款	-	-	-	912,230.70	912,230.70
应收清算款	-	-	-	20,698,428.62	20,698,428.62
其他资产	-	-	-	16,471,731.18	16,471,731.18
资产总计	254,623,460.90	-	-	-1,706,407,417.06	1,961,030,877.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,992,195.02	7,992,195.02
应付管理人报酬	-	-	-	2,390,125.04	2,390,125.04
应付托管费	-	-	-	430,222.50	430,222.50
应付清算款	-	-	-	62,790,632.45	62,790,632.45
其他负债	-	-	-	18,043,069.44	18,043,069.44
负债总计	-	-	-	91,646,244.45	91,646,244.45
利率敏感度缺口	254,623,460.90	-	-	-1,614,761,172.61	1,869,384,633.51

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.06%（上年

度末：5.10%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产或负债，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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 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				
货币资金	62,605,913.28	—	45,446,153.05	108,052,066.33
交易性金融资产	504,383,755.95	984,690,036.58	192,926,857.77	1,682,000,650.30
应收股利	2,404,810.47	4,594,116.13	662,006.98	7,660,933.58
应收申购款	384,367.50	—	—	384,367.50
应收清算款	11,923,657.23	311,043.89	—	12,234,701.12
其他资产	311,023.77	—	—	311,023.77
资产合计	582,013,528.20	989,595,196.60	239,035,017.80	1,810,643,742.60
以外币计价的负债				
应付清算款	—	—	17,887,716.98	17,887,716.98
应付赎回款	845,436.82	—	—	845,436.82

其他负债	1,251.25	311,043.89	-	312,295.14
负债合计	846,688.07	311,043.89	17,887,716.98	19,045,448.94
资产负债表外 汇风险敞口净 额	581,166,840.13	989,284,152.71	221,147,300.82	1,791,598,293.66
项目	上年度末 2024 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				
货币资金	69,909,132.52	-	4,070,739.87	73,979,872.39
交易性金融资 产	467,951,532.40	1,066,280,718.11	132,454,103.49	1,666,686,354.00
应收股利	866,921.04	457,284.10	103,893.89	1,428,099.03
应收申购款	72,026.98	-	-	72,026.98
应收清算款	11,708,021.25	-	8,990,407.37	20,698,428.62
其他资产	8,849,595.18	7,622,136.00	-	16,471,731.18
资产合计	559,357,229.37	1,074,360,138.21	145,619,144.62	1,779,336,512.20
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	7,622,136.00	-	7,622,136.00
应付赎回款	525,238.49	-	-	525,238.49
其他负债	7,625,212.97	-	8,990,407.37	16,615,620.34
负债合计	8,150,451	7,622,136.00	8,990,407.37	24,762,994.83

	. 46			
资产负债表外 汇风险敞口净 额	551, 206, 7 77. 91	1, 066, 738, 002. 21	136, 628, 737. 25	1, 754, 573, 517. 37

6. 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			
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：人民币元）		
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）	
	1. 所有外币相对人 民币升值 5%	89, 579, 914. 68	87, 728, 675. 87	
	2. 所有外币相对人 民币贬值 5%	-89, 579, 914. 68	-87, 728, 675. 87	

6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金持有的证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，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，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6. 4. 13. 4. 3. 1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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, 711, 865, 490. 30	87. 98	1, 666, 896, 927. 53	89. 17

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	1,711,865,490.30	87.98	1,666,896,927.53	89.17

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	149,410,443.22	136,354,656.02
	2. 业绩比较基准下降 5%	-149,410,443.22	-136,354,656.02

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	1,711,865,490.30	1,666,876,507.08
第二层次	98,475,779.51	95,286,900.28
第三层次	-	20,420.45

合计	1, 810, 341, 269. 81	1, 762, 183, 827. 81
----	----------------------	----------------------

6.4.14.2.2 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。对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行业等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1, 711, 865, 490. 30	83. 97
	其中：普通股	1, 395, 973, 049. 61	68. 47
	存托凭证	315, 892, 440. 69	15. 49
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	98, 475, 779. 51	4. 83
	其中：债券	98, 475, 779. 51	4. 83
	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	206,652,719.66	10.14
8	其他各项资产	21,719,615.44	1.07
9	合计	2,038,713,604.91	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 830,107,229.66 元，占期末净值比例为 42.66%。

7.2 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	984,690,036.58	50.61
美国	504,383,755.95	25.92
中国台湾	145,359,764.93	7.47
韩国	47,567,092.84	2.44
中国	29,864,840.00	1.53
合计	1,711,865,490.30	87.98

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。

7.3 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（%）
基础材料	153,785,831.02	7.90
消费者非必需品	204,131,945.15	10.49
消费者常用品	20,243,452.42	1.04
能源	34,849,257.30	1.79
金融	147,265,313.24	7.57
医疗保健	133,543,222.15	6.86
工业	164,569,711.59	8.46
信息技术	605,104,895.86	31.10
电信服务	161,107,056.00	8.28
公用事业	-	-
房地产	87,264,805.57	4.49
合计	1,711,865,490.30	87.98

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.4 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	TSMC	台湾集	2330 TT	台湾证	中 国	300,000	77,872,089.76	4.00

		成电路 制造股 份有限 公司		券交易 所	台湾			
1	TSMC	台湾集 成电路 制造股 份有限 公司	TSM UN	纽约证 券交易 所	美国	30,000	48,640,539.42	2.50
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控 股有限 公司	700 HK	香港联 合交易 所	中 国 香港	150,000	68,806,627.50	3.54
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控 股有限 公司	TCEHY US	美 国 OTC 市 场	美国	50,000	23,086,485.00	1.19
3	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴 巴集团 控股有 限公司	BABA US	纽约证 券交易 所	美国	58,000	47,087,695.91	2.42
3	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴 巴集团 控股有 限公司	9988 HK	香港联 合交易 所	中 国 香港	329,800	33,023,569.88	1.70
4	Dongyue Group Ltd	东岳集 团有限 公司	189 HK	香港联 合交易 所	中 国 香港	5,800,0 00	55,431,968.80	2.85
5	Futu Holdings Ltd	富途控 股有限 公司	FUTU US	纳斯达 克证券 交易所	美国	58,000	51,314,419.69	2.64
6	China Yuchai Internati onal Ltd	中国玉 柴国际 有限公 司	CYD US	纽约证 券交易 所	美国	288,000	49,294,692.29	2.53
7	SK HYNIX INC	SK 海力 士株式 会社	000660 KS	韩国证 券交易 所	韩国	30,800	47,567,092.84	2.44
8	3SBIO INC	三生制 药	1530 HK	香港联 合交易 所	中 国 香港	2,180,0 00	47,017,406.15	2.42
9	Kuaishou Technology	快手科 技	1024 HK	香港联 合交易 所	中 国 香港	800,000	46,181,148.00	2.37
10	Vnet Group Inc	世纪互 联集团	VNET US	纳斯达 克证券	美国	880,000	43,467,019.20	2.23

				交易所				
11	Celestica Inc	天弘股份有限公司	CLS US	纽约证券交易所	美国	38,000	42,466,103.75	2.18
12	Shanghai Conant Optical Co Ltd	上海康耐特光学科技集团股份有限公司	2276 HK	香港联合交易所	中国香港	1,200,000	40,928,316.00	2.10
13	Semiconductor Manufacturing International Corp	中芯国际集成电路制造有限公司	981 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000,000	40,764,165.00	2.10
14	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD US	纳斯达克证券交易所	美国	38,000	38,600,602.92	1.98
15	Wasion Holdings Ltd	威胜控股有限公司	3393 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000,000	38,028,315.00	1.95
16	Marvell Technology Inc	美满电子科技公司	MRVL US	纳斯达克证券交易所	美国	68,000	37,677,143.52	1.94
17	EHang Holdings Ltd	亿航智能	EH US	纳斯达克证券交易所	美国	288,993	35,914,112.63	1.85
18	Cowell e Holdings Inc	高伟电子控股有限公司	1415 HK	香港联合交易所	中国香港	1,380,000	34,293,879.75	1.76
19	China Hongqiao Group Ltd	中国宏桥集团有限公司	1378 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000,000	32,793,722.00	1.69
20	Poly Property Services Co Ltd	保利物业服务股份有限公司	6049 HK	香港联合交易所	中国香港	989,600	29,916,738.62	1.54
21	China International Capital Corp Ltd	中国国际金融股份有限公司	3908 HK	香港联合交易所	中国香港	1,804,800	29,132,206.27	1.50

22	CNOOC Ltd	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港联合交易所	中国香港	1,800,000	29,087,557.20	1.49
23	BeOne Medicines Ltd	百济神州有限公司	6160 HK	香港联合交易所	中国香港	200,000	26,957,242.00	1.39
24	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	香港交易及结算有限公司	388 HK	香港联合交易所	中国香港	68,000	25,970,876.88	1.33
25	Chifeng Jilong Gold Mining Co Ltd	赤峰吉隆黄金矿业股份有限公司	6693 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000,000	24,896,235.00	1.28
26	China Resources Land Ltd	华润置地有限公司	1109 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000,000	24,257,870.00	1.25
27	Yangtze Optical Fibre & Cable Joint Stock Ltd Co	长飞光纤光缆股份有限公司	6869 HK	香港联合交易所	中国香港	1,200,000	23,309,442.00	1.20
28	Bilibili Inc	哔哩哔哩股份有限公司	BILI US	纳斯达克证券交易所	美国	150,000	23,032,795.50	1.18
29	AAC Technologies Holdings Inc	瑞声科技控股有限公司	2018 HK	香港联合交易所	中国香港	611,000	22,678,099.02	1.17
30	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML US	纳斯达克证券交易所	美国	3,800	21,799,955.73	1.12
31	Youdao Inc	网易有道	DAO US	纽约证券交易所	美国	350,033	21,549,417.61	1.11
32	Haier Smart Home Co	海尔智家股份有限公司	6690 HK	香港联合交易所	中国香港	1,008,000	20,637,063.72	1.06

	Ltd	司						
33	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	18,084	20,452,772.78	1.05
34	Harbin Electric Co Ltd	哈尔滨电气股份有限公司	1133 HK	香港联合交易所	中国香港	3,800,000	20,272,648.50	1.04
35	Nexteer Automotive Group Ltd	耐世特汽车系统集团有限公司	1316 HK	香港联合交易所	中国香港	3,800,000	19,752,837.00	1.02
36	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	鸿海精密工业股份有限公司	2317 TT	台湾交易所	中国台湾	500,000	19,712,903.22	1.01
37	Pop Mart International Group Ltd	泡泡玛特国际集团有限公司	9992 HK	香港联合交易所	中国香港	80,000	19,450,069.60	1.00
38	BYD Co Ltd	比亚迪股份有限公司	1211 HK	香港联合交易所	中国香港	174,000	19,438,214.25	1.00
39	Abbisko Cayman Ltd	和誉开曼有限责任公司	2256 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000,000	18,640,258.00	0.96
40	Dongfang Electric Corp Ltd	东方电气股份有限公司	1072 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500,000	18,330,195.00	0.94
41	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业集团股份有限公司	2899 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000,000	18,284,597.50	0.94
42	Henderson Land Development Co Ltd	恒基兆业地产有限公司	12 HK	香港联合交易所	中国香港	698,000	17,473,053.20	0.90
43	Wiwynn Corp	纬颖	6669 TT	台湾交易所	中国台湾	28,000	17,347,354.84	0.89
44	CITIC Securities	中信证券股份	6030 HK	香港联合交易所	中国香港	800,000	17,290,572.00	0.89

	s Co Ltd	有限公司		所				
45	Bank of Chengdu Co Ltd	成都银行股份有限公司	601838	上海证券交易所	中国	858,400	17,253,840.00	0.89
46	Gold Circuit Electronics Ltd	金像电子(股)公司	2368 TT	台湾交易所	中国台湾	228,000	16,470,681.63	0.85
47	China Overseas Property Holdings Ltd	中海物业集团有限公司	2669 HK	香港联合交易所	中国香港	3,125,000	15,617,143.75	0.80
48	CITIC Ltd	中国中信股份有限公司	267 HK	香港联合交易所	中国香港	1,549,000	15,227,941.73	0.78
49	Delta Electronics Inc	台达电子工业股份有限公司	2308 TT	台湾交易所	中国台湾	138,000	13,956,735.48	0.72
50	CMOC Group Ltd	洛阳栾川钼业集团股份有限公司	3993 HK	香港联合交易所	中国香港	1,797,000	13,077,417.72	0.67
51	China Southern Airlines Co Ltd	中国南方航空股份有限公司	1055 HK	香港联合交易所	中国香港	3,524,000	12,919,121.44	0.66
52	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	宁德时代新能源科技股份有限公司	300750	深圳证券交易所	中国	50,000	12,611,000.00	0.65
53	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd	佛山市海天调味食品股份有限公司	3288 HK	香港联合交易所	中国香港	369,700	11,817,034.42	0.61
54	Laopu Gold Co Ltd	老铺黄金股份有限公司	6181 HK	香港联合交易所	中国香港	12,800	11,766,343.68	0.60

		司						
55	Meituan	美团	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	100,000	11,426,733.50	0.59
56	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	招金矿业股份有限公司	1818 HK	香港联合交易所	中国香港	500,000	9,301,890.00	0.48
57	Guoquan Food Shanghai Co Ltd	锅圈食品（上海）股份有限公司	2517 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000,000	8,426,418.00	0.43
58	Guolian Minsheng Securities Co Ltd	国联民生证券股份有限公司	1456 HK	香港联合交易所	中国香港	1,600,000	6,303,398.40	0.32
59	CGN Mining Co Ltd	中广核矿业股份有限公司	1164 HK	香港联合交易所	中国香港	2,600,000	5,761,700.10	0.30

注：上述表格“所属国家（地区）”均按照股票及存托凭证上市交易地点统计。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 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	Futu Holdings Ltd	FUTU US	318,697,358.71	17.05
2	TSMC	TSM UN	151,815,543.02	8.12
2	TSMC	2330 TT	111,107,717.62	5.94
3	Meituan	MPNGY US	123,268,928.66	6.59
3	Meituan	3690 HK	99,253,537.82	5.31
4	Alibaba Group Holding Ltd	BABA US	135,376,077.74	7.24
4	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	81,508,954.81	4.36
5	JD.com Inc	9618 HK	175,712,244.08	9.40
6	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	148,002,321.76	7.92
7	Horizon Robotics Inc	9660 HK	140,951,347.86	7.54
8	KE Holdings Inc	2423 HK	64,431,071.91	3.45

8	KE Holdings Inc	BEKE US	60,232,777.96	3.22
9	Full Truck Alliance Co Ltd	YMM US	108,659,497.59	5.81
10	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	104,416,907.10	5.59
11	Vnet Group Inc	VNET US	103,014,838.07	5.51
12	SK HYNIX INC	000660 KS	102,336,958.59	5.47
13	Chifeng Jilong Gold Mining Co Ltd	6693 HK	80,666,302.06	4.32
14	Kingsoft Cloud Holdings Ltd	KC US	80,456,001.76	4.30
15	NVIDIA Corp	NVDA US	79,963,179.20	4.28
16	Lenovo Group Ltd	992 HK	75,752,620.61	4.05
17	Celestica Inc	CLS US	74,117,547.79	3.96
18	Pop Mart International Group Ltd	9992 HK	72,284,670.27	3.87
19	AAC Technologies Holdings Inc	2018 HK	68,510,027.24	3.66
20	ASML Holding NV	ASML US	67,927,714.37	3.63
21	3SBio Inc	1530 HK	63,033,589.57	3.37
22	GDS Holdings Ltd	9698 HK	44,356,985.71	2.37
22	GDS Holdings Ltd	GDS US	16,227,821.47	0.87
23	Hesai Group	HSAI US	54,945,924.61	2.94
24	Lingbao Gold Group Co Ltd	3330 HK	53,379,107.57	2.86
25	BeOne Medicines Ltd	6160 HK	52,908,860.10	2.83
26	CNOOC Ltd	883 HK	52,359,301.40	2.80
27	Broadcom Inc	AVGO US	49,324,144.57	2.64
28	BYD Co Ltd	1211 HK	47,350,125.85	2.53
29	Cowell e Holdings Inc	1415 HK	45,647,652.49	2.44
30	Marvell Technology Inc	MRVL US	45,094,973.42	2.41
31	China Yuchai International Ltd	CYD US	43,484,738.57	2.33
32	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	42,890,082.88	2.29
33	Kuaishou Technology	1024 HK	42,852,065.78	2.29
34	EHang Holdings Ltd	EH US	42,009,655.21	2.25
35	China International	3908 HK	41,995,713.07	2.25

	Capital Corp Ltd			
36	Mao Geping Cosmetics Co LTD	1318 HK	41,973,432.69	2.25
37	Kanzhun Ltd	BZ US	41,878,187.71	2.24
38	AppLovin Corp	APP US	41,447,004.93	2.22
39	China Hongqiao Group Ltd	1378 HK	39,613,816.36	2.12
40	Nexteer Automotive Group Ltd	1316 HK	37,534,286.30	2.01

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 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	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	FUTU US	285,764,130.05	15.29
2	TSMC	TSM UN	107,170,484.97	5.73
2	TSMC	2330 TT	106,458,387.36	5.69
3	Meituan	MPNGY US	114,105,265.91	6.10
3	Meituan	3690 HK	81,289,314.99	4.35
4	Horizon Robotics	9660 HK	174,074,683.46	9.31
5	JD.com Inc	9618 HK	163,977,609.46	8.77
6	KE Holdings Inc	2423 HK	93,977,476.25	5.03
6	KE Holdings Inc	BEKE US	66,428,042.71	3.55
7	Full Truck Alliance Co Ltd	YMM US	143,867,073.04	7.70
8	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	388 HK	133,144,901.76	7.12
9	Alibaba Group Holding Ltd	BABA US	84,940,733.42	4.54
9	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	45,659,432.05	2.44
10	Xiaomi Corp	1810 HK	117,567,667.54	6.29
11	Kingsoft Cloud Holdings Ltd	KC US	116,679,847.48	6.24
12	Trip.com Group Ltd	TCOM UW	65,273,172.88	3.49
12	Trip.com Group Ltd	9961 HK	48,174,407.84	2.58
13	Lenovo Group Ltd	992 HK	105,232,505.67	5.63
14	Broadcom Inc	AVGO US	90,223,695.55	4.83
15	Pop Mart International Group Ltd	9992 HK	85,732,246.42	4.59
16	BYD CO LTD-H	1211 HK	81,047,012.98	4.34

17	SK HYNIX INC	000660 KS	77,522,243.40	4.15
18	Semiconductor Manufacturing International Corp	981 HK	77,377,109.65	4.14
19	Tencent Holdings Ltd	700 HK	66,691,455.90	3.57
19	Tencent Holdings Ltd	TCEHY US	5,502,048.16	0.29
20	China Telecom Corp Ltd	728 HK	71,784,361.02	3.84
21	Hesai Group	HSAI US	68,846,691.85	3.68
22	Chifeng Jilong Gold Mining Co Ltd	6693 HK	68,267,558.31	3.65
23	EHang Holdings Ltd	EH US	67,629,656.02	3.62
24	Kanzhun Ltd	BZ US	66,144,921.07	3.54
25	GDS Holdings Ltd	9698 HK	45,653,752.78	2.44
25	GDS Holdings Ltd	GDS US	18,388,839.08	0.98
26	Keymed Biosciences Inc	2162 HK	59,357,855.47	3.18
27	Mao Geping Cosmetics Co LTD	1318 HK	58,862,399.46	3.15
28	NetEase Inc	NTES US	58,546,482.03	3.13
29	Lingbao Gold Group Co Ltd	3330 HK	57,689,333.81	3.09
30	NVIDIA Corp	NVDA US	55,723,432.47	2.98
31	Vnet Group Inc	VNET US	53,342,758.53	2.85
32	MINISO Group Holding Ltd	MNSO US	53,205,346.49	2.85
33	Huadian Power International Corp Ltd	1071 HK	52,501,767.35	2.81
34	CNOOC Ltd	883 HK	51,750,255.87	2.77
35	ASML Holding NV	ASML US	48,454,840.37	2.59
36	New Oriental Education & Technology Group Inc	EDU US	45,493,566.90	2.43
37	Celestica Inc	CLS US	45,338,171.05	2.43
38	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	44,239,141.20	2.37
39	Giant Biogene Holding Co ltd	2367 HK	43,625,942.25	2.33
40	Nitto Boseki Co Ltd	3110 JP	43,454,479.42	2.32
41	AAC Technologies	2018 HK	41,728,229.23	2.23

	Holdings Inc			
42	AppLovin Corp	APP US	41,345,804.45	2.21
43	Shandong Gold Mining Co Ltd	1787 HK	39,261,553.40	2.10
44	Laopu Gold Co Ltd	6181 HK	37,933,282.84	2.03

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 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	5,181,750,233.58
卖出收入（成交）总额	5,501,245,750.20

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

7.6 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（%）
未评级	98,475,779.51	5.06

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。

7.7 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	019758	24 国债 21	97,600,000	98,475,779.51	5.06

注：数量列示债券面值。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	39,543.13
2	应收清算款	12,234,701.12
3	应收股利	7,897,093.58
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,237,253.84
6	其他应收款	311,023.77
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	21,719,615.44

7.11.4 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换债券。

7.11.5 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
99,531	8,031.48	255,664,508.41	31.98	543,716,421.61	68.02

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	457,432.60	0.057223

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 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	922,209,800.97
本报告期基金总申购份额	33,290,860.38
减：本报告期基金总赎回份额	156,119,731.33
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	799,380,930.02

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（一）基金管理人重大人事变动

经国海富兰克林基金管理有限公司股东会 2025 年第三次会议审议通过，自 2025 年 3 月 20 日起，刘峻先生接替吴显玲女士担任公司董事长及法定代表人，相关公告已于 2025 年 3 月 22 日在《上海证券报》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

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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监管部门稽查或处罚。

10.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
Jefferies International Limited	—	1,377,250,660.62	12.89	826,869.16	11.51	—
Sanford C. Bernstein (HK) Limited	—	1,364,882,282.87	12.78	744,443.73	10.36	—
华安证券	1	1,215,921,736.38	11.38	547,164.72	7.61	—
中金公司	2	1,106,791,657.34	10.36	498,056.21	6.93	—
Macquarie Capital Asia Limited	—	850,126,393.02	7.96	574,055.97	7.99	—
摩根大通证券	1	784,289,650.80	7.34	352,930.37	4.91	—
中信证券	3	704,569,569.56	6.60	317,056.29	4.41	—
Daiwa Capital Markets Hongkong Limited	—	694,945,617.45	6.51	557,401.61	7.76	—
Citigroup Global Markets	—	541,233,685.91	5.07	434,989.40	6.05	—

Limited						
Yuanta Securities Co., LTD	-	339,353,564.49	3.18	339,353.94	4.72	-
JP Morgan Securities PLC	-	260,689,973.77	2.44	268,543.37	3.74	-
Goldman Sachs	-	229,922,566.39	2.15	354,601.45	4.93	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	213,506,100.42	2.00	218,460.66	3.04	-
CLSA Limited	-	197,414,867.08	1.85	567,509.12	7.90	-
国泰海通	2	189,749,644.95	1.78	85,387.33	1.19	-
天风证券	1	128,091,109.79	1.20	57,641.01	0.80	-
Haitong International Securities Company Limited	-	112,949,236.98	1.06	112,949.22	1.57	-
Nomura	-	101,208,772.52	0.95	100,723.12	1.40	-
Cathay Securities	-	86,561,763.65	0.81	95,218.19	1.33	-
BOCI Securities Limited	-	52,853,194.68	0.49	63,423.84	0.88	-
华泰证券	2	50,289,330.87	0.47	22,630.20	0.31	-
方正证券	1	31,264,389.75	0.29	14,068.98	0.20	-
高盛中国	1	15,108,028.24	0.14	6,798.61	0.09	-
西南证券	1	12,954,694.52	0.12	5,829.66	0.08	-
CMB	-	11,130,290.1	0.10	16,695.44	0.23	-

International Securities Limited		5				
国投证券	2	6,115,482.00	0.06	2,751.97	0.04	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	3,672,636.24	0.03	-	-	-
国盛证券	1	146,376.44	0.00	65.87	0.00	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：1、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，国泰君安证券股份有限公司（简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（简称“海通证券”），公司更名为国泰海通证券股份有限公司（简称“国泰海通”）。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。相关佣金协议已根据此规定完成了更新。

10.7.2 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 (%)
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	3,996,781.00	2.81	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	16,098,436.00	11.32	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	5,499,179.00	3.87	-	-	-	-	-	-
国盛证券	108,133,463.00	76.03	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
华宝 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
首创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏 东财 证券	3,799,240.00	2.67	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	4,695,796.00	3.30	-	-	-	-	-	-
中信 建投	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 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	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下部分基金于 2025 年非港股通交易日暂停基金交易业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 1 月 8 日
2	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下部分基金于 2025 年境外主要市场节假日暂停基金交易业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 1 月 8 日
3	国海富兰克林基金管理有限公司关于北京分公司营业场所变更的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 1 月 17 日
4	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	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 1 月 22 日
5	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 1 月 22 日
6	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 3 月 1 日
7	富兰克林国海大中华精选混合型证券	中国证监会规定报刊及	2025 年 3 月 1 日

	投资基金更新招募说明书（2025 年 1 号）	规定网站	
8	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金（国富大中华精选混合（QDII）人民币类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 3 月 1 日
9	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金（国富大中华精选混合（QDII）美元现汇类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 3 月 1 日
10	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 3 月 1 日
11	国海富兰克林基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 3 月 1 日
12	国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 3 月 22 日
13	国海富兰克林基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 3 月 31 日
14	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 3 月 31 日
15	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 3 月 31 日
16	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	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 4 月 22 日
17	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 4 月 22 日
18	国海富兰克林基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 6 月 17 日
19	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（2025 年 2 号）	中国证监会规定报刊及规定网站	2025 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况
无。

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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

2025 年 8 月 29 日