

富兰克林国海大中华精选混合型证券投资  
基金 (QDII)  
2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	42
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	42

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 .....	42
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	48
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
7.11 投资组合报告附注 .....	53
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	63
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</b>
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 .....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录 .....	65
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## § 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(QDII)
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	993,842,611.15 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国海富兰克林基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	储丽莉
	联系电话	021-3855 5555
	电子邮箱	service@ftsfund.com
客户服务电话	400-700-4518、9510-5680 和	95599

	021-38789555	
传真	021-6888 3050	010-68121816
注册地址	广西南宁市西乡塘区总部路 1 号 中国-东盟科技企业孵化基地一期 A-13 栋三层 306 号房	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 9 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	吴显玲	谷澍

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	127,745,398.59
本期利润	-55,701,090.39
加权平均基金份额本期利润	-0.0535
本期加权平均净值利润率	-2.70%
本期基金份额净值增长率	-2.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	213,540,780.32
期末可供分配基金份额利润	0.2149

期末基金资产净值	1,885,355,286.73
期末基金份额净值	1.897
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	89.70%

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 0.2625 美元。

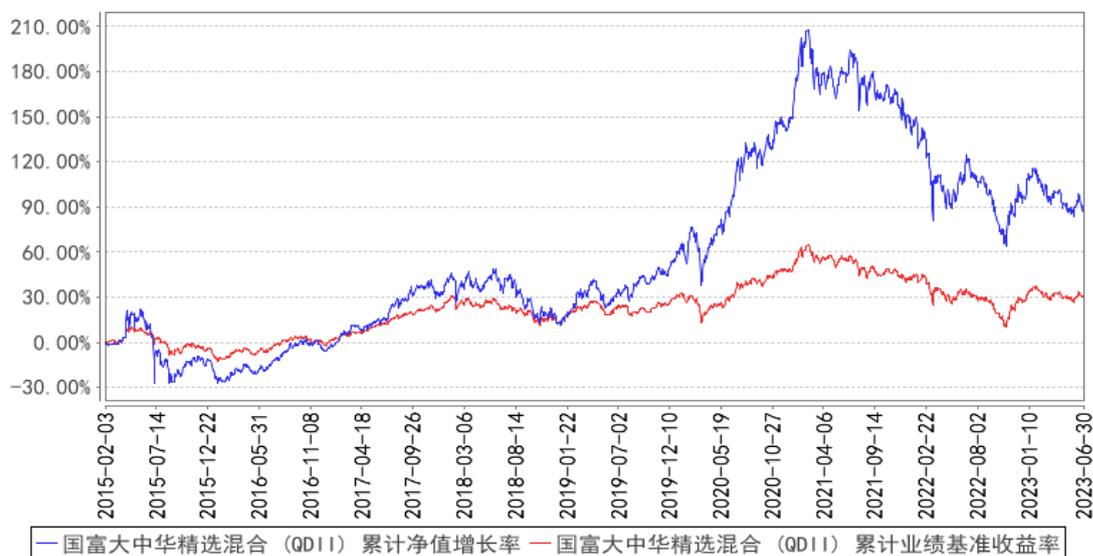
## 3.2 基金净值表现

### 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	3.27%	1.18%	2.39%	0.68%	0.88%	0.50%
过去三个月	-5.34%	0.99%	-2.27%	0.56%	-3.07%	0.43%
过去六个月	-2.97%	1.22%	1.74%	0.66%	-4.71%	0.56%
过去一年	-14.12%	1.45%	-2.88%	0.84%	-11.24%	0.61%
过去三年	-4.67%	1.54%	-0.59%	0.82%	-4.08%	0.72%
自基金合同生效起至今	89.70%	1.54%	29.93%	0.72%	59.77%	0.82%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国富大中华精选混合 (QDII) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 本基金的基金合同生效日为 2015 年 2 月 3 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

2. 以上收益率折算为人民币计算。

## § 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 2023 年 6 月 30 日，公司旗下合计管理 42 只公募基金产品。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐成	公司 QDII 投资总监，国富亚洲机会股票（QDII）基金、国富大中华精选混合（QDII）基金、国富美元债定期债券（QDII）基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金、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	-	17 年	徐成先生，CFA，朴茨茅斯大学（英国）金融决策分析硕士。历任永丰金证券（亚洲）有限公司上海办事处研究员，新加坡东京海上国际资产管理有限公司上海办事处研究员、高级研究员、首席代表，国海富兰克林基金管理有限公司 QDII 投资副总监。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司 QDII 投资总监，国富亚洲机会股票（QDII）基金、国富大中华精选混合（QDII）基金、国富美元债定期债券（QDII）基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金、国富全球科技互联混合（QDII）基金及国富港股通远见价值混合基金的基金经理。

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

2. 表中“证券从业年限”的计算标准为该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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

### 4.3 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。

### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

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

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

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年一季度，国内经济总体企稳回升。受疫情影响，1 月份投资和消费均不理想；但节后，出行、消费以及部分城市地产销售逐步有所改善。二季度，国内经济复苏并不特别强。地产和汽车销售数据一般，投资和消费均不理想；但二季度出口数据好于预期。

上半年，港股表现一般。一月份，市场表现较好；但 2-5 月份恒生指数震荡走弱，6 月份有所回升。行业方面，地产、物业、互联网和科技表现欠佳；高股息标的总体表现较为突出，反应市场投资者较为谨慎的心态。美国通胀数据仍维持高位，市场对流动性也有些担忧。

本基金行业配置上重点关注数字经济、硬科技、物业、电信、上游资源等板块。数字经济：未来增长空间较大、估值相对较低、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；物业：相对稳定的现金流、估值相对较低、央企有较为稳定的业绩增加；电信：股息率高、业绩稳健；上游资源：估值相对较低、市场预期低。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值 1.897 元，本报告期份额净值下降 2.97%，同期业绩比较基准上涨 1.74%，跑输业绩比较基准 4.71%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对 23 年下半年市场整体偏乐观：1) 目前港股估值仍在其历史平均水平以下；相对于 A 股，港股在平均估值上仍有一定优势；2) 美国通胀有所缓解，美联储加息接近尾声，海外流动性也有望改善；3) 中国经济有望企稳回升且上市公司业绩将逐步改善。

同时，中国经济处在转型期，新经济方兴未艾、未来发展的空间较大。新经济中有核心企业盈利能力有望逐步得到改善。硬科技、数字经济、新能源、高端制造、生物医药等领域的增速仍有望维持在价高的水平。

本基金将重点关注有结构性增长机会的行业，如硬科技、新能源、数字经济、大消费、物业和医药等；同时，也将关注有望受益于经济复苏的板块，如有色和工程机械等，配置上总体偏均衡。中国市场规模大，给优秀的企业提供了很好的舞台；此外，凭借自身过硬的实力，国内企业在海外市场也有望取得更大的斩获。上市公司层面，我们加大对质地优秀、行业口配好、有核心竞争力企业的研究，重点把握结构性成长的机会，将在估值合理的时候重点考虑。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——国海富兰克林基金管理有限公司 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 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，未发现有关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（QDII）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	141,378,880.62	122,967,415.68
结算备付金		62,333,759.57	27,080,101.79
存出保证金		333,769.48	627,964.80
交易性金融资产	6.4.7.2	1,642,275,197.28	1,917,702,640.26
其中：股票投资		1,543,001,969.06	1,811,952,505.13
基金投资		-	-
债券投资		99,273,228.22	105,750,135.13
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		74,613,858.23	12,977,641.53
应收股利		10,032,670.71	51,452.35
应收申购款		691,287.41	1,497,964.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	61,668,030.32	3,687,786.83
资产总计		1,993,327,453.62	2,086,592,967.54
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		35,771,372.77	230.86
应付赎回款		5,682,425.29	15,214,882.76
应付管理人报酬		2,357,877.75	2,668,522.98
应付托管费		424,417.99	480,334.11
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	63,736,073.09	7,178,902.10
负债合计		107,972,166.89	25,542,872.81
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	993,842,611.15	1,054,009,460.68
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	891,512,675.58	1,007,040,634.05
净资产合计		1,885,355,286.73	2,061,050,094.73
负债和净资产总计		1,993,327,453.62	2,086,592,967.54

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 993,842,611.15 份，其中国富大中华精选混合(QDII)人民币份额 927,975,792.12 份，份额净值人民币 1.897 元；国富大中华精选混合(QDII)美元现汇份额 65,866,819.03 份，份额净值 0.2625 美元。

## 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 (QDII)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-37,249,536.08	-463,584,822.23
1. 利息收入		1,098,072.70	904,724.28
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,098,072.70	904,724.28
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		143,282,047.72	-768,528,689.59
其中：股票投资收益	6.4.7.14	128,920,820.66	-788,227,724.30
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	1,158,836.90	1,737,095.45
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	87,873.37	-
股利收益	6.4.7.20	13,114,516.79	17,961,939.26
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	-183,446,488.98	298,897,030.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		1,328,572.35	3,753,181.00
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	488,260.13	1,388,931.57
<b>减：二、营业总支出</b>		18,451,554.31	24,609,830.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	15,421,601.78	20,576,948.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,775,888.28	3,703,850.67
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		-	0.77
8. 其他费用	6.4.7.24	254,064.25	329,031.13

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-55,701,090.39	-488,194,652.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-55,701,090.39	-488,194,652.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-55,701,090.39	-488,194,652.96

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金 (QDII)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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（基金净值）	1,054,009,460.68	-	1,007,040,634.05	2,061,050,094.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,054,009,460.68	-	1,007,040,634.05	2,061,050,094.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-60,166,849.53	-	-115,527,958.47	-175,694,808.00
（一）、综合收益总额	-	-	-55,701,090.39	-55,701,090.39
（二）、本期基金份额交易产	-60,166,849.53	-	-59,826,868.08	-119,993,717.61

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	131,394,933.52	-	128,511,056.82	259,905,990.34
2. 基金赎回款	-191,561,783.05	-	-188,337,924.90	-379,899,707.95
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	993,842,611.15	-	891,512,675.58	1,885,355,286.73
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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(基金净值)	1,407,868,893.97	-	2,124,301,652.83	3,532,170,546.80
加:会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	1,407,868,893.97	-	2,124,301,652.83	3,532,170,546.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-249,866,944.42	-	-724,721,477.98	-974,588,422.40
(一)、综合收益总额	-	-	-488,194,652.96	-488,194,652.96
(二)、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)	-249,866,944.42	-	-236,526,825.02	-486,393,769.44
其中:1. 基金申购款	179,060,408.67	-	217,954,708.15	397,015,116.82
2. 基金赎回款	-428,927,353.09	-	-454,481,533.17	-883,408,886.26
(三)、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)				
(四)、 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末 净资产(基金 净值)	1,158,001,949.55	-	1,399,580,174.85	2,557,582,124.40

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和在其他证券市场发行的“大中华企业”股票、存托凭证、债券和衍生品等。“大中华地区证券市场”为中国证监会允许投资的香港、台湾和中国内地证券市场等。“大中华企业”是指满足以下三个条件之一的上市公司：1) 上市公司注册在大中华地区（中国内地、香港、台湾、澳门）；2) 上市公司中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和在其他证券市场发行的“大中华企业”的资产不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：MSCI 金龙净总收益指数 (MSCI Golden Dragon Net Total Return Index) X60%+同期人民币一年期定期存款利率（税后）X40%。

本财务报表由本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于 2023 年 8 月 31 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、

中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期间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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司 (以下简称“中国结算”) 提出申请, 由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利, 由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

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

(4) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	141,378,880.62
等于：本金	141,356,353.24
加：应计利息	22,527.38
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	141,378,880.62

注：于 2023 年 06 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 69,077,641.64 元，美元活期存款 5,758,262.17 元(折合人民币 41,608,050.79 元)，新台币活期存款 132,333,525.00 元(折合人民币 30,693,188.19 元)。

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,568,936,125.27	-	1,543,001,969.06	-25,934,156.21	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	97,329,069.94	2,282,928.22	99,273,228.22	-338,769.94
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	97,329,069.94	2,282,928.22	99,273,228.22	-338,769.94
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,666,265,195.21	2,282,928.22	1,642,275,197.28	-26,272,926.15	

注：股票投资包含了存托凭证。

#### 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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 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 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	61,668,030.32
待摊费用	-
合计	61,668,030.32

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,722.16
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,942,491.25
其中：交易所市场	1,942,491.25
银行间市场	-
应付利息	-
债券账户维护费	4,500.00
信息披露费	59,507.37
应付未起息外汇交易	61,674,263.74
审计费用	49,588.57
合计	63,736,073.09

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,054,009,460.68	1,054,009,460.68
本期申购	131,394,933.52	131,394,933.52
本期赎回（以“-”号填列）	-191,561,783.05	-191,561,783.05
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	993,842,611.15	993,842,611.15

## 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	96,863,449.30	910,177,184.75	1,007,040,634.05
本期利润	127,745,398.59	-183,446,488.98	-55,701,090.39
本期基金份额交易产生的变动数	-11,068,067.57	-48,758,800.51	-59,826,868.08
其中：基金申购款	24,147,006.93	104,364,049.89	128,511,056.82
基金赎回款	-35,215,074.50	-153,122,850.40	-188,337,924.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	213,540,780.32	677,971,895.26	891,512,675.58

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	939,482.90
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	152,632.77
其他	5,957.03
合计	1,098,072.70

#### 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	128,920,820.66
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	128,920,820.66

##### 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	4,990,564,156.37
减：卖出股票成本总额	4,844,389,699.63
减：交易费用	17,253,636.08
买卖股票差价收入	128,920,820.66

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,241,101.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-82,264.52
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	1,158,836.90

## 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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	25,901,625.47
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	25,491,490.52
减：应计利息总额	492,399.47
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-82,264.52

## 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

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	88,059.41
减: 卖出权证成本总额	-
减: 交易费用	186.04
减: 买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-
买卖权证差价收入	87,873.37

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	13,114,516.79
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	13,114,516.79

#### 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-183,446,488.98
股票投资	-183,396,682.50
债券投资	-49,806.48
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	-183,446,488.98

注: 股票投资包含了存托凭证。

#### 6.4.7.22 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	488,260.13

合计	488,260.13
----	------------

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	13,860.67
债券账户维护费	9,000.00
证券组合费	41,155.34
其他费用	80,952.30
合计	254,064.25

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、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 Corporation)	基金境外资产托管人
国海证券股份有限公司（“国海证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
国海证券	456,051,486.98	4.68	82,892,831.32	0.86

## 6.4.10.1.2 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。

## 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国海证券	364,841.16	4.68	364,841.16	18.78
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国海证券	66,314.27	0.78	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	15,421,601.78
其中：支付销售机构的客户维护费	5,714,412.14	6,970,508.84

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 1.5%的

年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% \div \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,775,888.28	3,703,850.67

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.27% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	5,811,313.44	5,811,313.44
报告期间申购/买入总份额	4,734,375.00	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份	-	-

额		
报告期末持有的基金份额	10,545,688.44	5,811,313.44
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.06%	0.50%

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（2022 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	72,279,069.07	575,846.05	48,663,309.64	20,010.52
中国农业银行	69,099,811.55	363,636.85	112,816,180.30	672,638.15

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

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.10.8 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
002487	大金	2022 年	6 个	非公	37.35	30.52	977,243	36,500,026.05	29,825,456.36	-

	重工	12月30日	月	发行流通受限						
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股锁定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股锁定	131.11	53.24	392	34,219.71	20,870.08	其中131股为锁定期送股的股份
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-

注：1、根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的非公开发行股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

2、根据《上海证券交易所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或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的股票设置不低于6个月的限售期。

3、根据《深圳证券交易所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或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的股票设置不低于6个月的限售期。

4、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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 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

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中风险收益特征的证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险控制部负责投资风险管理与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的分析报告，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充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行和境外托管人纽约梅隆银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的固定收益品种 (2022 年 12 月 31 日：同)。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公

司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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 2023 年 6 月 30 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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	141,378,880.62	-	-	-	141,378,880.62
结算备付金	62,333,759.57	-	-	-	62,333,759.57
存出保证金	333,769.48	-	-	-	333,769.48
交易性金融资产	99,273,228.22	-	-	1,543,001,969.06	1,642,275,197.28
应收股利	-	-	-	10,032,670.71	10,032,670.71
应收申购款	-	-	-	691,287.41	691,287.41
应收清算款	-	-	-	74,613,858.23	74,613,858.23
其他资产	-	-	-	61,668,030.32	61,668,030.32
资产总计	303,319,637.89	-	-	1,690,007,815.73	1,993,327,453.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,682,425.29	5,682,425.29
应付管理人报酬	-	-	-	2,357,877.75	2,357,877.75
应付托管费	-	-	-	424,417.99	424,417.99
应付清算款	-	-	-	35,771,372.77	35,771,372.77
其他负债	-	-	-	63,736,073.09	63,736,073.09
负债总计	-	-	-	107,972,166.89	107,972,166.89
利率敏感度缺口	303,319,637.89	-	-	-1,582,035,648.84	1,885,355,286.73
上年度末 2022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	122,967,415.68	-	-	-	122,967,415.68
结算备付金	27,080,101.79	-	-	-	27,080,101.79
存出保证金	627,964.80	-	-	-	627,964.80
交易性金融资产	105,750,135.13	-	-	1,811,952,505.13	1,917,702,640.26
应收股利	-	-	-	51,452.35	51,452.35
应收申购款	-	-	-	1,497,964.30	1,497,964.30
应收清算款	-	-	-	12,977,641.53	12,977,641.53
其他资产	-	-	-	3,687,786.83	3,687,786.83
资产总计	256,425,617.40	-	-	1,830,167,350.14	2,086,592,967.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,214,882.76	15,214,882.76
应付管理人报酬	-	-	-	2,668,522.98	2,668,522.98
应付托管费	-	-	-	480,334.11	480,334.11
应付清算款	-	-	-	230.86	230.86
其他负债	-	-	-	7,178,902.10	7,178,902.10
负债总计	-	-	-	25,542,872.81	25,542,872.81
利率敏感度缺口	256,425,617.40	-	-	-1,804,624,477.33	2,061,050,094.73

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 2023 年 6 月 30 日, 本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.27%(2022 年 12 月 31 日: 5.13%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日: 同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			合计
	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	
以外币计价的资产				
银行存款	41,608,050.79	-	30,693,188.19	72,301,238.98
交易性金融资产	270,202,063.92	1,201,167,947.31	19,761,127.30	1,491,131,138.53
应收股利	-	9,161,406.78	871,263.93	10,032,670.71
应收申购款	82,094.77	-	-	82,094.77
应收清算款	12,916,974.70	61,674,263.77	-	74,591,238.47
其他资产	61,668,030.32	-	-	61,668,030.32
资产合计	386,477,214.50	1,272,003,617.86	51,325,579.42	1,709,806,411.78
以外币计价的负债				
应付赎回款	376,972.44	-	-	376,972.44

其他负债	33.46	61,674,263.74	-	61,674,297.20
负债合计	377,005.90	61,674,263.74	-	62,051,269.64
资产负债表外汇 风险敞口净额	386,100,208 .60	1,210,329,354.12	51,325,579.42	1,647,755,142.14
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	42,908,519. 50	-	2,587,098.83	45,495,618.33
交易性金融资产	281,399,017 .29	1,443,917,785.96	-	1,725,316,803.25
应收股利	-	51,452.35	-	51,452.35
应收申购款	149,966.85	-	-	149,966.85
应收清算款	9,140,411.9 4	3,688,109.98	-	12,828,521.92
其他资产	3,687,786.8 3	-	-	3,687,786.83
资产合计	337,285,702 .41	1,447,657,348.29	2,587,098.83	1,787,530,149.53
以外币计价的负债				
应付赎回款	45,068.83	-	-	45,068.83
其他负债	85.39	3,688,109.95	-	3,688,195.34
负债合计	45,154.22	3,688,109.95	-	3,733,264.17
资产负债表外汇 风险敞口净额	337,240,548 .19	1,443,969,238.34	2,587,098.83	1,783,796,885.36

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元)

		本期末 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
分析	1. 所有外币相对人民币升值 5%	增加约 8,239	增加约 8,919
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 8,239	减少约 8,919

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票（含存托凭证）等权益类资产投资比例为基金资产的 40%-95%，债券、货币市场工具、现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具投资比例为 5%-60%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	1,543,001,969.06	81.84	1,811,952,505.13	87.91
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	1,543,001,969.06	81.84	1,811,952,505.13	87.91

#### 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		
	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 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 15,478	增加约 16,277
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 15,478	减少约 16,277

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,513,099,081.38	1,772,921,352.66
第二层次	99,273,228.22	105,750,135.13
第三层次	29,902,887.68	39,031,152.47
合计	1,642,275,197.28	1,917,702,640.26

**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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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。

**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	1,543,001,969.06	77.41
	其中：普通股	1,429,020,537.93	71.69
	存托凭证	113,981,431.13	5.72
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	99,273,228.22	4.98
	其中：债券	99,273,228.22	4.98
	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	-	-

	产		
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	203,712,640.19	10.22
8	其他各项资产	147,339,616.15	7.39
9	合计	1,993,327,453.62	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 922,345,910.73 元，占期末净值比例为 48.92%。

## 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	1,201,167,947.31	63.71
美国	270,202,063.92	14.33
中国	51,870,830.53	2.75
中国台湾	19,761,127.30	1.05
合计	1,543,001,969.06	81.84

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（%）
电信业务	227,619,159.98	12.07
消费者非必需品	318,336,279.54	16.88
消费者常用品	28,544,500.80	1.51
能源	46,085,723.49	2.44
金融	21,694,115.64	1.15
医疗保健	37,201,965.85	1.97
工业	232,170,451.11	12.31
信息技术	405,381,276.03	21.50
原材料	63,774,862.95	3.38
房地产	162,193,633.67	8.60
公用事业	-	-
合计	1,543,001,969.06	81.84

注：以上分类采用 GICS 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	China	中海物	2669 HK	香港联	中国	11,030,	80,236,876.87	4.26

	Overseas Property Holdings Limited	业		合交易所	香港	000		
2	Microsoft Corporation	微软	MSFT US	纳斯达克	美国	30,000	73,820,217.96	3.92
3	Tencent Holdings Limited	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	230,000	70,317,570.64	3.73
4	H World Group Limited	华住集团	1179 HK	香港联合交易所	中国香港	2,300,000	64,146,758.50	3.40
5	New Oriental Education & Technology Group Inc.	新东方	9901 HK	香港联合交易所	中国香港	1,500,000	42,526,327.50	2.26
5	New Oriental Education & Technology Group Inc.	新东方	EDU US	纽约证券交易所	美国	75,000	21,401,013.15	1.14
6	Netease, Inc.	网易	9999 HK	香港联合交易所	中国香港	428,000	60,217,095.34	3.19
7	China Mobile Limited	中国移动	941 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000,000	59,052,819.00	3.13
8	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	台积电	TSM UN	纽约证券交易所	美国	79,000	57,608,991.14	3.06
9	Advanced Micro Devices, Inc.	美国超微公司	AMD US	纽约证券交易所	美国	60,000	49,385,452.68	2.62
10	Zte	中兴通	763 HK	香港联	中国	1,700,0	49,215,292.40	2.61

	Corporation	讯		合交易所	香港	00		
11	CNOOC Limited	中国海洋石油	883 HK	香港联合交易所	中国香港	4,463,000	46,085,723.49	2.44
12	Morimatsu International Holdings Company Limited	森松国际	2155 HK	香港联合交易所	中国香港	7,496,600	44,442,329.17	2.36
13	BYD Company Limited	比亚迪股份	1211 HK	香港联合交易所	中国香港	180,000	41,489,100.00	2.20
14	Alibaba Group Holding Limited	阿里巴巴	9988 HK	香港联合交易所	中国香港	536,300	40,149,979.37	2.13
15	China Telecom Corporation Limited	中国电信	728 HK	香港联合交易所	中国香港	11,000,000	38,031,675.00	2.02
16	Xinyi Solar Holdings Limited	信义光能	968 HK	香港联合交易所	中国香港	4,500,000	37,547,635.50	1.99
17	Flat Glass Group Co., Ltd.	福莱特玻璃	6865 HK	香港联合交易所	中国香港	1,493,000	36,821,806.75	1.95
18	Meituan	美团-W	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	325,213	36,670,417.54	1.95
19	PDD Holdings Inc.	拼多多	PDD US	纳斯达克	美国	70,000	34,971,426.84	1.85
20	China Railway Group Limited	中国中铁	390 HK	香港联合交易所	中国香港	7,000,000	33,366,456.20	1.77
21	NVIDIA Corporation	英伟达	NVDA US	纳斯达克	美国	10,801	33,014,962.15	1.75

22	China Resources Land Limited	华润置地	1109 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000,000	30,609,736.00	1.62
23	Hisense Home Appliances Group Co., Ltd.	海信家电	921 HK	香港联合交易所	中国香港	1,643,000	30,447,744.11	1.61
24	Dajin Heavy Industry Co., Ltd.	大金重工	002487	深圳证券交易所	中国	977,243	29,825,456.36	1.58
25	China Resources Beer (Holdings) Company Limited	华润啤酒	291 HK	香港联合交易所	中国香港	600,000	28,544,500.80	1.51
26	Kingsoft Corporation Limited	金山软件	3888 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000,000	28,443,083.00	1.51
27	Boc Aviation Limited	中银航空租赁	2588 HK	香港联合交易所	中国香港	397,100	23,193,591.64	1.23
28	Yuexiu Services Group Limited	越秀服务	6626 HK	香港联合交易所	中国香港	8,500,000	22,413,333.80	1.19
29	Cosco Shipping Energy Transportation Co., Ltd.	中远海能	1138 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000,000	21,740,288.40	1.15
30	China Citic Bank Corporation Limited	中信银行	998 HK	香港联合交易所	中国香港	6,394,000	21,694,115.64	1.15
31	Sunny Optical Technology	舜宇光学科技	2382 HK	香港联合交易所	中国香港	300,000	21,615,821.10	1.15

	chnology (Group) Company Limited			所				
32	Poly Property Services Co., Ltd.	保利物 业	6049 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	613,600	21,469,336.92	1.14
33	Wiwynn Corporati on	纬颖	6669 TT	台湾证 券交易 所	中 国 台 湾	60,000	19,761,127.30	1.05
34	China Co mmunicati ons Cons truction Compa ny Limit ed	中国交 通建设	1800 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	4,990,0 00	19,690,911.26	1.04
35	Luxshare Precision Industry Co., Ltd.	立讯精 密	002475	深圳证 券交易 所	中 国	605,600	19,651,720.00	1.04
36	Innovent Biologics , Inc.	信达生 物	1801 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	700,000	19,103,425.60	1.01
37	Air China Limited	中国国 航	753 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	3,600,0 00	18,520,734.24	0.98
38	Remegen Co., Ltd.	荣昌生 物-B	9995 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	563,000	17,778,309.85	0.94
39	Zhaojin Mining Industry Company Limited	招金矿 业	1818 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	1,800,0 00	16,230,535.92	0.86
40	Lenovo Group Limited	联想集 团	992 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	2,000,0 00	15,065,153.20	0.80
41	China Ea stern Ai rlines C orporatio n Limi ted	中国东 方航空 股份	670 HK	香港联 合交易 所	中 国 香 港	5,732,0 00	14,004,691.80	0.74

42	Anhui Expressway Company Limited	安徽皖通高速公路	995 HK	香港联合交易所	中国香港	2,000,000	13,958,777.20	0.74
43	L.K. Technology Holdings Limited	力劲科技	558 HK	香港联合交易所	中国香港	2,042,500	13,332,660.58	0.71
44	Zijin Mining Group Company Limited	紫金矿业	2899 HK	香港联合交易所	中国香港	1,000,000	10,602,770.00	0.56
45	Country Garden Services Holdings Company Limited	碧桂园服务	6098 HK	香港联合交易所	中国香港	800,000	7,464,350.08	0.40
46	Shangri-La Asia Ltd.	香格里拉(亚洲)	69 HK	香港联合交易所	中国香港	892,000	4,926,212.90	0.26
47	Zhejiang Cfmoto Power Co., Ltd	春风动力	603129	上海证券交易所	中国	7,800	1,262,820.00	0.07
48	Yili Chuanning Biotechnology Co., Ltd.	川宁生物	301301	深圳证券交易所	中国	35,740	320,230.40	0.02
49	Guangdong Lvtong New Energy Electric Vehicle Technology Co., Ltd.	绿通科技	301322	深圳证券交易所	中国	3,907	218,237.33	0.01
50	Weihaishi Honglin Electronics	泓淋电力	301439	深圳证券交易所	中国	9,486	168,338.18	0.01

	c Co., Ltd.							
51	Zhejiang Taotao Vehicles Co., Ltd.	涛涛车业	301345	深圳证券交易所	中国	2,652	126,242.30	0.01
52	Zhejiang Zhongke Magnetic Industry Co., Ltd.	中科磁业	301141	深圳证券交易所	中国	2,617	119,750.28	0.01
53	Suzhou Future Electrical Company Co., Ltd.	未来电器	301386	深圳证券交易所	中国	3,776	94,554.26	0.01
54	Hangzhou Huasu Technology Co., Ltd.	华塑科技	301157	深圳证券交易所	中国	1,498	83,481.42	0.00

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	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	191,216,752.44	9.28
1	Alibaba Group Holding Limited	BABA US	144,760,630.61	7.02
2	Baidu, Inc.	9888 HK	161,166,258.19	7.82
2	Baidu, Inc.	BIDU UW	54,605,852.60	2.65
3	Microsoft Corporation	MSFT US	183,120,241.38	8.88
4	H World Group Limited	1179 HK	127,625,861.73	6.19
4	H World Group Limited	HTHT US	54,124,099.60	2.63
5	PDD Holdings Inc.	PDD US	180,725,629.98	8.77

6	New Oriental Education & Technology Group Inc.	9901 HK	105,430,588.51	5.12
6	New Oriental Education & Technology Group Inc.	EDU US	56,910,172.59	2.76
7	NVIDIA Corporation	NVDA US	137,415,803.09	6.67
8	Tencent Holdings Limited	700 HK	135,045,473.10	6.55
9	Advanced Micro Devices, Inc.	AMD US	116,787,533.11	5.67
10	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	TSM UN	106,588,545.89	5.17
11	Huaneng Power International, Inc.	902 HK	100,210,460.48	4.86
12	Meituan	3690 HK	98,313,533.25	4.77
13	BYD Company Limited	1211 HK	82,611,317.24	4.01
14	China Resources Power Holdings Company Limited	836 HK	80,744,765.68	3.92
15	Kingsoft Corporation Limited	3888 HK	79,952,168.89	3.88
16	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	78,924,923.70	3.83
17	COSCO Shipping Energy Transportation Co., Ltd.	1138 HK	67,278,741.99	3.26
18	First Solar, Inc.	FSLR US	64,686,424.18	3.14
19	Zijin Mining Group Company	2899 HK	61,124,033.81	2.97

	Limited			
20	China Mobile Limited	941 HK	60,954,325.55	2.96
21	NetEase, Inc.	9999 HK	60,230,249.91	2.92
22	Wuxi Biologics (Cayman) Inc.	2269 HK	59,785,870.93	2.90
23	Xiaomi Corporation	1810 HK	58,861,995.55	2.86
24	Tesla, Inc.	TSLA US	58,295,925.92	2.83
25	Zte Corporation	763 HK	57,941,590.60	2.81
26	Cowell e Holdings Inc.	1415 HK	57,547,877.80	2.79
27	Xinyi Solar Holdings Limited	968 HK	53,878,721.00	2.61
28	East Buy Holding Limited	1797 HK	47,903,112.21	2.32
29	China Citic Bank Corporation Limited	998 HK	47,754,770.10	2.32
30	CNOOC Limited	883 HK	47,572,957.28	2.31
31	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	44,887,975.56	2.18
32	ASPEED Technology Inc	5274 TT	44,680,403.78	2.17
33	L. K. Technology Holdings Limited	558 HK	42,534,976.97	2.06

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	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	259,628,823.74	12.60
1	Alibaba Group Holding Limited	BABA US	238,718,007.44	11.58
2	PDD Holdings Inc.	PDD US	274,103,424.01	13.30
3	Baidu, Inc.	9888 HK	156,184,119.87	7.58
3	Baidu, Inc.	BIDU UW	50,065,524.55	2.43
4	Tencent Holdings	700 HK	185,807,259.20	9.02

	Limited			
5	NVIDIA Corporation	NVDA US	182,291,449.13	8.84
6	H World Group Limited	1179 HK	115,150,084.65	5.59
6	H World Group Limited	HTHT US	52,539,622.29	2.55
7	New Oriental Education & Technology Group Inc.	9901 HK	110,418,866.71	5.36
7	New Oriental Education & Technology Group Inc.	EDU US	36,559,251.48	1.77
8	Microsoft Corporation	MSFT US	134,943,941.87	6.55
9	Meituan	3690 HK	120,371,846.29	5.84
10	Tesla, Inc.	TSLA US	116,271,079.66	5.64
11	Huaneng Power International, Inc.	902 HK	109,788,633.91	5.33
12	China Resources Power Holdings Company Limited	836 HK	100,983,875.47	4.90
13	Hong Kong Exchanges And Clearing Ltd.	388 HK	87,750,043.33	4.26
14	East Buy Holding Limited	1797 HK	87,086,429.73	4.23
15	Trip.com Group Limited	9961 HK	77,489,807.93	3.76
16	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	77,152,731.52	3.74
17	Hainan Meilan International Airport Company Limited	357 HK	76,626,637.95	3.72
18	Cowell e Holdings Inc.	1415 HK	71,591,115.30	3.47
19	Kuaishou Technology	1024 HK	65,102,400.82	3.16
20	Zhaojin Mining	1818 HK	64,974,940.67	3.15

	Industry Company Limited			
21	Advanced Micro Devices, Inc.	AMD US	64,179,127.99	3.11
22	Kingsoft Corporation Limited	3888 HK	61,423,472.28	2.98
23	First Solar, Inc.	FSLR US	61,016,277.26	2.96
24	Wuxi Biologics (Cayman) Inc.	2269 HK	54,219,333.43	2.63
25	Xiaomi Corporation	1810 HK	52,856,860.79	2.56
26	Kingsoft Cloud Holdings Limited	KC US	41,234,705.29	2.00
26	Kingsoft Cloud Holdings Limited	3896 HK	11,178,547.06	0.54
27	China Overseas Land & Investment Ltd.	688 HK	51,563,519.35	2.50
28	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	TSM UN	51,459,826.42	2.50
29	Zijin Mining Group Company Limited	2899 HK	50,477,173.10	2.45
30	ASPEED Technology Inc	5274 TT	48,398,361.95	2.35
31	China Merchants Bank Co., Ltd.	600036	31,136,050.50	1.51
31	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	16,375,059.22	0.79
32	Kingdee International Software Group Company Limited	268 HK	45,177,903.23	2.19
33	BYD Company Limited	1211 HK	45,136,693.24	2.19
34	COSCO Shipping Energy Transportation Co., Ltd.	1138 HK	41,996,704.55	2.04

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	4,758,835,846.06
卖出收入（成交）总额	4,990,564,156.37

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	99,273,228.22	5.27

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	019638	20 国债 09	97,000,000	99,273,228.22	5.27

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	333,769.48
2	应收清算款	74,613,858.23
3	应收股利	10,032,670.71
4	应收利息	-
5	应收申购款	691,287.41
6	其他应收款	61,668,030.32
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	147,339,616.15

#### 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 (%)
154,271	6,442.19	219,581,947.64	22.09	774,260,663.51	77.91

### 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	191,112.74	0.019230

### 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、基金投资和研发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	1,054,009,460.68
本报告期基金总申购份额	131,394,933.52
减：本报告期基金总赎回份额	191,561,783.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	993,842,611.15

## § 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

本报告期内，本基金基金管理人无重大人事变动。

#### (二) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

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

本基金自成立以来对其进行审计的均为普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

### 10.6 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 (%)	
天风证券	1	1,790,799,406.98	18.37	1,432,639.51	18.38	-
Sanford C.	1	1,571,225,460.80	16.12	805,406.80	10.34	-

Bernstein (HK) Limited						
Jefferies International Limited	1	815,852,807.51	8.37	783,326.11	10.05	-
Macquarie Capital Asia Limited	1	803,609,983.73	8.24	511,798.71	6.57	-
华安证券	1	781,037,117.96	8.01	624,890.05	8.02	-
国泰君安	1	711,156,506.97	7.30	568,970.29	7.30	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	2	707,203,191.87	7.25	707,203.19	9.08	-
国海证券	2	456,051,486.98	4.68	364,841.16	4.68	-
中金公司	2	406,111,333.38	4.17	324,889.04	4.17	-
Daiwa Capital Markets Hongkong Limited	2	382,272,242.47	3.92	382,272.30	4.91	-
安信证券	2	371,329,549.48	3.81	304,070.14	3.90	-
Yuanta Securities Co., LTD	1	153,327,635.71	1.57	153,327.35	1.97	-
BOCI Securities Limited	1	113,295,665.14	1.16	135,954.79	1.74	-
Credit Suisse	2	102,100,371.70	1.05	102,100.38	1.31	-
首创证券	1	95,047,129.01	0.98	69,508.91	0.89	-
华泰证券	2	91,170,170.71	0.94	84,907.89	1.09	-

Nomura	2	72,152,159.77	0.74	72,152.17	0.93	-
Cathay Securities	2	67,100,260.29	0.69	73,810.44	0.95	-
高盛中国	1	55,916,269.70	0.57	52,075.21	0.67	-
招商证券	1	43,892,139.41	0.45	40,875.72	0.52	-
华宝证券	1	40,369,078.02	0.41	29,521.00	0.38	-
中信证券	3	30,459,934.50	0.31	28,367.35	0.36	-
东兴证券	1	22,805,657.63	0.23	21,238.86	0.27	-
东北证券	1	16,771,388.25	0.17	15,619.08	0.20	-
方正证券	1	16,281,560.00	0.17	15,163.78	0.19	-
中泰证券	2	8,863,393.69	0.09	8,189.38	0.11	-
国盛证券	1	8,653,790.00	0.09	6,327.89	0.08	-
Haitong International Securities Company Limited	2	5,810,734.20	0.06	58,107.34	0.75	-
西藏东财证券	2	3,589,691.40	0.04	2,625.26	0.03	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	2	2,195,482.80	0.02	10,977.41	0.14	-
银河证券	1	1,231,574.00	0.01	1,146.87	0.01	-
国信证券	1	286,368.00	0.00	266.70	0.00	-
申港证券	2	89,287.60	0.00	65.31	0.00	-
CLSA Limited	1	-	-	-	-	-

JP Morgan Securities	1	-	-	-	-	-
Everbright Securities International Company Limited	1	-	-	-	-	-
China Renaissance Securities (HK)	1	-	-	-	-	-
Masterlink Securities	1	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	2	-	-	-	-	-
Bank of America Merrill Lynch	2	-	-	-	-	-
Southwest Securities (HK) Brokerage Ltd	1	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	2	-	-	-	-	-
Barclays Capital	1	-	-	-	-	-
Core Pacific-Yamaichi International (H.K.) Ltd.	1	-	-	-	-	-
CMB International	1	-	-	-	-	-

Securities Limited						
CCB International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
KGI Securities Co. Ltd	1	-	-	-	-	-
DAEWOO Securities Co. LTD	1	-	-	-	-	-
Daishin Securities Korea	1	-	-	-	-	-
BNP Paribas	1	-	-	-	-	-
Zhongtai International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Bank of China(HK)	1	-	-	-	-	-
BOC International	1	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	1	-	-	-	-	-
JP Morgan Chase & Co.	1	-	-	-	-	-
China Securities International	1	-	-	-	-	-
Guotai Junan	1	-	-	-	-	-

Securities (Hong Kong) Limited							
BOCOM International Holdings Company Limited	1	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-	-

注：管理人对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其他相关因素后决定的。报告期内，本基金新增申港证券上海及深圳交易单元各 1 个。因北京高华相关业务并入高盛高华，本基金原租用的北京高华交易单元变更为高盛高华。截至报告期末，高盛高华已更名为高盛中国。

### 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 (%)
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Jefferies International	-	-	-	-	-	-	-	-

Limited									
Macquarie Capital Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	88,059.41	100.00	-	-	-
Daiwa Capital Markets Hongkong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Yuanta Securities Co., LTD	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	5,301,677.00	12.21	-	-	-	-	-	-	-
Nomura	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cathay Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	9,203,363.00	21.19	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	7,711,428.00	17.76	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	2,101,256.00	4.84	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	3,904,920.00	8.99	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	5,600,472.00	12.90	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	6,702,412.00	15.43	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Everbright Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
China Renaissance Securities (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Masterlink Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Bank of America Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Southwest Securities (HK) Brokerage Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Barclays Capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Core Pacific-Yamaichi International (H.K.) Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CMB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI Securities Co. Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-

DAEWOO Securities Co. LTD	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Daishin Securities Korea	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Zhongtai International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Bank of China(HK)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BOC International	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Chase & Co.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
China Securities International	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCOM International Holdings Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	2,900,455.00	6.68	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行的股票的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 1 月 4 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 2023 年境外主要	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 1 月 9 日

	市场节假日暂停基金交易业务的公告		
3	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下部分基金于 2023 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	2023 年 1 月 9 日
4	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金(QDII)2022 年第四季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 1 月 20 日
5	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	2023 年 1 月 20 日
6	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加长江证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 2 月 1 日
7	关于增加万家财富基金销售(天津)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	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 2 月 8 日
8	关于增加上海万得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	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 2 月 14 日
9	关于增加国金证券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	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 2 月 18 日
10	关于增加和信证券投资咨询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	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 3 月 3 日
11	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	2023 年 3 月 31 日
12	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金(QDII)2022 年年度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 3 月 31 日
13	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加兴业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	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 3 月 31 日
14	国海富兰克林基金管理有限公司关于调整旗下部分基金于 2023 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	2023 年 4 月 7 日
15	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加南京证券股份有限公司	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 4 月 12 日

	申购及定期定额投资费率优惠活动的公告		
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	2023 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（QDII）2023 年第一季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 4 月 22 日
18	关于增加中国中金财富证券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	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 6 月 26 日
19	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	2023 年 6 月 27 日
20	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	2023 年 6 月 27 日
21	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（2023 年 1 号）	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 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](http://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](http://www.ftsfund.com) 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日