

富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型
证券投资基金
2026 年中期报告

2026 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：2026 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	41
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	43
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	47
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	55
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	56
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	56
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	56
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	56
7.11 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 盈利投资者数量占比	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.4 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	57
§9 开放式基金份额变动	58
§10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	59
10.8 其他重大事件	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	66
§12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
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	富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金	
基金简称	国富亚洲机会股票（QDII）	
基金主代码	457001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 2 月 22 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	1,085,933,242.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国富亚洲机会股票（QDII）A	国富亚洲机会股票（QDII）C
下属分级基金的交易代码	457001	021662
报告期末下属分级基金的份额总额	357,842,615.05 份	728,090,627.14 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是通过投资在亚洲地区（不包括日本）证券市场进行交易以及公司总部或经营范围在亚洲地区（不包括日本）的上市公司以实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在投资过程中首先强调亚洲国家和地区上市公司的品质与成长性的结合。采取“自下而上”的选股策略，注重个股成长性指标分析，挖掘拥有更佳成长特性的公司，构建股票池。同时，在亚洲国家和地区经济发展格局下，筛选出具有国际比较优势的优质上市公司。最后通过深入的投资价值评估，形成优化的投资组合。 在固定收益类投资部分，其资产布局坚持安全性、流动性和收益性为资产配置原则，并结合现金管理、货币市场工具等来制订具体策略。
业绩比较基准	MSCI 亚洲（除日本）净总收益指数 (MSCI AC Asia ex Japan Index(Net Total Return))
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于较高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	Franklin Advisers, Inc.	JP Morgan Chase Bank, National Association
	中文	富兰克林顾问公司	摩根大通银行
注册地址		1 Franklin Parkway, San Mateo, CA, USA	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.
办公地址		1 Franklin Parkway, San Mateo, CA, USA	383 Madison Avenue, New York, NY 10179-0001, U.S.A.
邮政编码		94403	10179-0001

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	国富亚洲机会股票 (QDII) A	国富亚洲机会股票 (QDII) C
本期已实现收益	194,927,266.61	365,685,742.04
本期利润	411,966,416.94	666,367,895.43
加权平均基金份	1.3807	1.2703

额本期利润		
本期加权平均净 值利润率	55.65%	50.55%
本期基金份额净 值增长率	79.14%	78.68%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	424,046,012.77	802,269,434.62
期末可供分配基 金份额利润	1.1850	1.1019
期末基金资产净 值	1,157,568,373.12	2,322,871,763.65
期末基金份额净 值	3.2349	3.1904
3.1.3 累计期末 指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净 值增长率	266.92%	178.54%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则一第 1 号《主要财务指标的计算及披露》。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

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

国富亚洲机会股票（QDII）A

阶段	份额净 值增长 率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	66.23%	2.79%	27.02%	2.03%	39.21%	0.76%

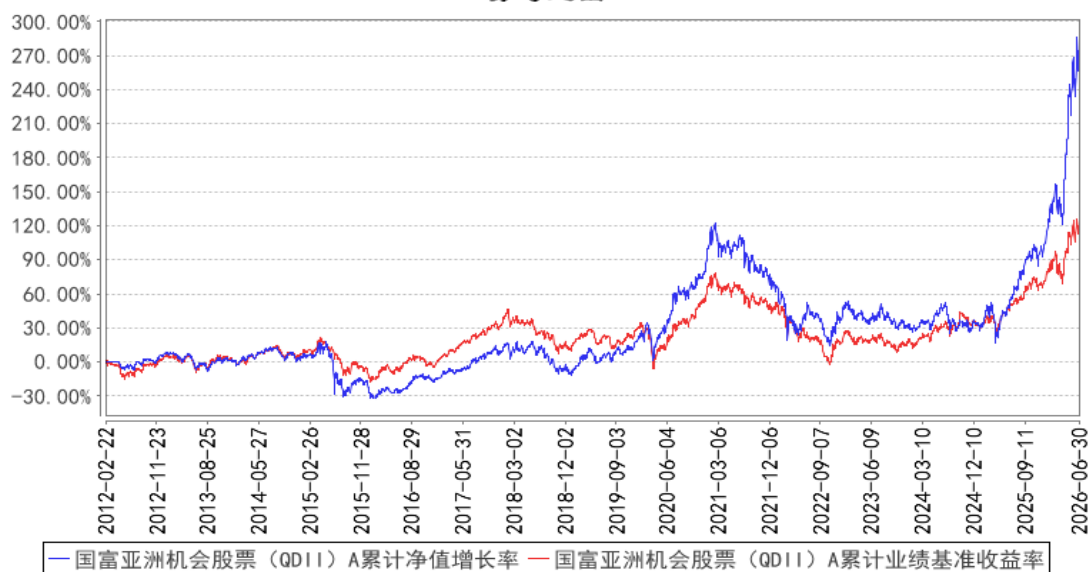
过去六个月	79.14%	2.43%	25.17%	1.94%	53.97%	0.49%
过去一年	135.80%	1.89%	43.52%	1.49%	92.28%	0.40%
过去三年	166.03%	1.55%	81.31%	1.21%	84.72%	0.34%
过去五年	74.11%	1.59%	28.51%	1.21%	45.60%	0.38%
过去七年	247.46%	1.56%	75.19%	1.23%	172.27 %	0.33%
过去十年	391.18%	1.44%	127.00%	1.13%	264.18 %	0.31%
自基金合同生效起 至今	266.92%	1.40%	115.07%	1.07%	151.85 %	0.33%

国富亚洲机会股票（QDII）C

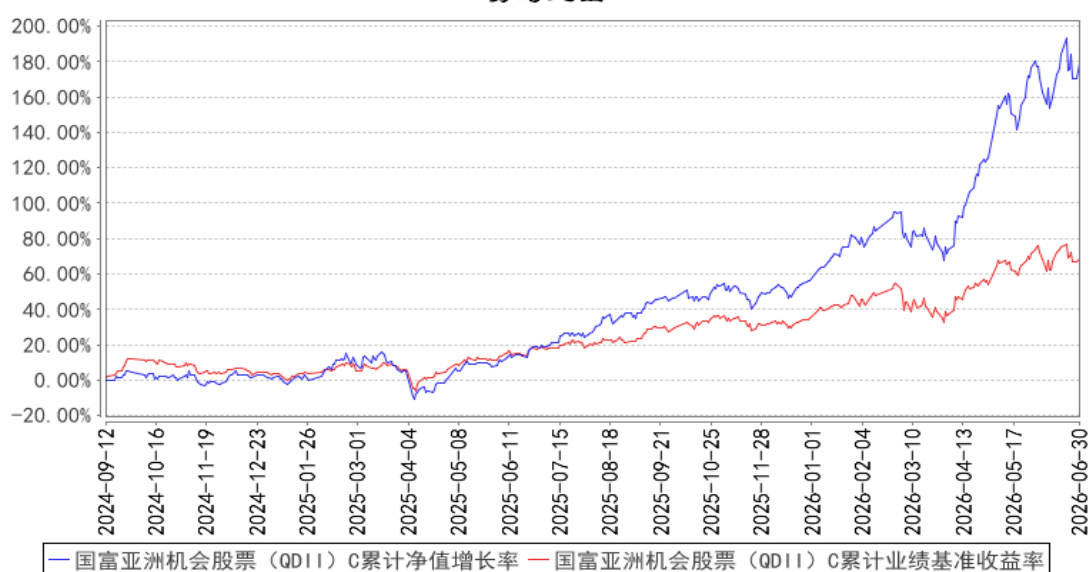
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	66.06%	2.79%	27.02%	2.03%	39.04%	0.76%
过去六个月	78.68%	2.43%	25.17%	1.94%	53.51%	0.49%
过去一年	134.67%	1.89%	43.52%	1.49%	91.15%	0.40%
自增设 C 类份额至 今	178.54%	1.80%	68.49%	1.36%	110.05 %	0.44%

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

国富亚洲机会股票（QDII）A 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



国富亚洲机会股票（QDII）C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2012 年 2 月 22 日，并于 2024 年 9 月 12 日增设 C 类份额。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。

§ 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 2026 年 6 月末，公司旗下合计管理 50 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	2015 年 12 月 24 日	—	20 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。

	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

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
苏库玛拉贾 (Sukumar Rajah)	邓普顿环球投资公司股票投资组合管理总监、高级常务董事	35	他负责监管亚洲单一国家、区域和多国产品、投资流程开发和增强，他是亚洲股票投资组合的首席投资组合经理。此外，他负责监督印度股票小组，是分布在印度以外的印度相关基金和机构账户的主要投资组合经理。

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《富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票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。

4.5 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

2026 年上半年，亚洲（除日本）市场表现较为较好，MSCI 亚洲（除日本）净总收益指数上涨 25.17%；3 月份由于中东危机的冲击，市场有所回落，但在 4-5 月份市场表现有所回升。

本基金在上半年主要配置在科技板块。在中国台湾市场上市的科技股公司较多，涉及半导体、AI、芯片设计等；我们将优选有望受益于科技发展的个股。优质的韩国科技公司也有不错的增长潜力，特别是在内存领域具有技术和规模上的优势。香港市场估值处于历史相对低位，我们将重点关注数字经济和硬科技等板块；此外，我们也将关注估值偏低且有不错增长潜力的公司。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，我们秉持着谨慎乐观的态度来看待亚洲（除日本）市场，特别是科技和互联网行业(AI 运用)。

亚洲科技公司有望从人工智能（AI）的进步中获得巨大收益。中长期来看 AI 的潜力巨大，运用不断破圈，需求有望逐步提升，企业投资较为积极。此外，中国和东南亚各国政府支持加速了 AI 的应用，确保亚洲科技公司实现持续增长和全球市场主导地位。亚洲的半导体、内存、AI 服务器、半导体设备、ASIC 设计公司等有望持续受益。

美联储 6 月议息会议大幅上调全年个人消费支出（PCE）通胀预测至 3.6%（较 3 月的 2.7%上修 0.9 个百分点）；点阵图显著转鹰，提交预测的 18 位官员中 9 人预计 2026 年至少加息一次，其中 6 人预计加息两次或以上；与此同时，政策声明大幅精简，删减了前瞻指引和宽松倾向措辞。关税、移民政策与能源（油价）上行共同推升通胀粘性，“更高更久”成为基准情景，对港股分母端构成压制。但边际上已出现缓和信号：若油价继续回落、通胀数据下行，年底或重新打开降息空间；最新非农数据“爆冷”亦延后了加息时点。

综合考量当前市场在近期回调后相对较为合理的估值以及向好的基本面（特别是科技和互联网行业），我们认为亚洲（除日本）市场在下半年有望延续震荡上涨的良好态势。在投资策略方面，重点关注半导体、硬科技、互联网、ASIC 设计公司等领域。

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。

4.7 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

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对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、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	355,251,641.00	26,938,307.79
结算备付金		91,012,987.19	550,188.71
存出保证金		993,376.48	31,787.61
交易性金融资产	6.4.7.2	3,117,190,163.14	421,377,732.73
其中：股票投资		2,937,509,984.75	398,440,245.61
基金投资		—	—
债券投资		179,680,178.39	22,937,487.12
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	88,007,498.08	—
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		92,897,329.55	8,159,010.10
应收股利		3,052,502.79	196,236.29
应收申购款		52,009,455.79	15,964,544.86
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	256,522,865.49	19,782,913.45
资产总计		4,056,937,819.51	493,000,721.54
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		189,146,143.19	5,715,071.93
应付赎回款		125,508,595.53	9,405,406.86

应付管理人报酬		3,173,409.34	429,980.01
应付托管费		528,901.55	71,663.36
应付销售服务费		707,558.58	21,831.92
应付投资顾问费		—	—
应交税费		3,490.72	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.9	257,429,583.83	20,045,767.66
负债合计		576,497,682.74	35,689,721.74
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,085,933,242.19	253,771,835.96
其他综合收益	6.4.7.11	—	—
未分配利润	6.4.7.12	2,394,506,894.58	203,539,163.84
净资产合计		3,480,440,136.77	457,310,999.80
负债和净资产总计		4,056,937,819.51	493,000,721.54

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,085,933,242.19 份，其中国富亚洲机会股票(QDII)A 基金份额净值 3.2349 元，基金份额总额 357,842,615.05 份；国富亚洲机会股票(QDII)C 基金份额净值 3.1904 元，基金份额总额 728,090,627.14 份。

6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,095,248,263.05	32,950,325.40
1. 利息收入		439,443.90	68,047.11
其中：存款利息收入	6.4.7.13	425,344.09	68,047.11
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		14,099.81	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		578,050,806.87	15,834,768.78
其中：股票投资收益	6.4.7.14	571,284,813.52	14,158,526.95
基金投资收益	6.4.7.15	—	—
债券投资收益	6.4.7.16	642,507.22	24,305.48
资产支持证券投资 收益	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	-	-
股利收益	6.4.7.20	6,123,486.13	1,651,936.35
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	517,721,303.72	17,701,064.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-2,983,470.99	-692,980.10
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	2,020,179.55	39,425.24
减：二、营业总支出		16,913,950.68	1,677,346.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,129,673.18	1,317,394.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,021,612.18	235,067.64
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,584,883.99	6,634.58
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		14,476.48	-
其中：卖出回购金融资产支出		14,476.48	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		4,273.14	-
8. 其他费用	6.4.7.24	159,031.71	118,250.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,078,334,312.37	31,272,979.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,078,334,312.37	31,272,979.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,078,334,312.37	31,272,979.00

6.3 净资产变动表

会计主体：富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	253,771,835.96	-	203,539,163.84	457,310,999.80
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	253,771,835.96	-	203,539,163.84	457,310,999.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	832,161,406.23	-	2,190,967,730.74	3,023,129,136.97
(一)、综合收益总额	-	-	1,078,334,312.37	1,078,334,312.37
(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)	832,161,406.23	-	1,112,633,418.37	1,944,794,824.60
其中：1. 基金申购款	1,403,228,109.35	-	1,915,994,768.13	3,319,222,877.48
2. 基金赎回款	-571,066,703.12	-	-803,361,349.76	-1,374,428,052.88
(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	1,085,933,242.19	-	2,394,506,894.58	3,480,440,136.77
项目	上年度可比期间 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	157,606,234.69	-	26,877,016.43	184,483,251.12
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	157,606,234.69	-	26,877,016.43	184,483,251.12

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,453,232.28	-	31,153,091.70	29,699,859.42
(一)、综合收益总额	-	-	31,272,979.00	31,272,979.00
(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)	-1,453,232.28	-	-119,887.30	-1,573,119.58
其中：1. 基金申购款	23,511,349.91	-	5,365,446.92	28,876,796.83
2. 基金赎回款	-24,964,582.19	-	-5,485,334.22	-30,449,916.41
(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	156,153,002.41	-	58,030,108.13	214,183,110.54

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

富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可字[2011]第 1380 号《关于同意富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金募集的批复》核准,由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息

共募集人民币 327,681,782.17 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 28 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 2 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 327,738,555.14 份，其中认购资金利息折合 56,772.97 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，境外托管人为摩根大通银行。

根据本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于 2024 年 9 月 12 日发布的《国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金增设 C 类基金份额、修改基金份额净值精度并修改法律文件的公告》，自 2024 年 9 月 12 日起，本基金增设 C 类基金份额。

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《富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，境内市场投资工具包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。境外市场投资工具包括银行存款、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；内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）；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）。本基金投资的主要区域为亚洲地区（除日本），包括中国香港、韩国、印度、中国台湾、新加坡、印度尼西亚、泰国、马来西亚和菲律宾等国家或地区。本基金将至少 80%的非现金基金资产投资于亚洲地区（除

日本）证券市场以及至少 50%的营业收入来自于亚洲地区而在亚洲以外交易所上市的企业。香港市场可通过合格境内机构投资者境外投资额度和港股通机制进行投资。本基金投资组合中股票及其他权益类证券（含存托凭证）市值占基金资产的比例不低于 80%，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不低于基金资产净值的 5%（若法律法规变更或取消本限制的，则本基金按变更或取消后的规定执行）。本基金的业绩比较基准为：MSCI 亚洲(除日本)净总收益指数(MSCIACAsiaexJapanIndex(NetTotalReturn))。

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 2026 年 8 月 31 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发布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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发布的其他相关规定。

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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 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

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3% 的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

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；

基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	355,251,641.00
等于：本金	355,231,227.84
加：应计利息	20,413.16
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	355,251,641.00

注：于 2026 年 06 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 163,739,188.53 元，含应计利息 20,413.16 元，美元活期存款 26,691,409.31 元(折合人民币 181,792,519.67 元)，新台币活期存款 45,453,370.00 元(折合人民币 9,719,885.64 元)，韩元活期存款 10,723.00 元(折合人民币 47.16 元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,379,733,822.04	-	2,937,509,984.75	557,776,162.71
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	178,125,415.93	1,468,398.39	179,680,178.39	86,364.07
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	178,125,415.93	1,468,398.39	179,680,178.39	86,364.07
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,557,859,237.97	1,468,398.39	3,117,190,163.14	557,862,526.78

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	88,007,498.08	-
银行间市场	-	-
合计	88,007,498.08	-

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
----	-----

	2026 年 6 月 30 日
应收利息	—
其他应收款	256,522,865.49
待摊费用	—
合计	256,522,865.49

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	78,335.21
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	713,871.27
其中：交易所市场	713,871.27
银行间市场	—
应付利息	—
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
应付未起息外汇交易	256,550,596.90
合计	257,429,583.83

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国富亚洲机会股票（QDII）A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	206,832,053.00	206,832,053.00
本期申购	258,081,471.10	258,081,471.10
本期赎回（以“-”号填列）	-107,070,909.05	-107,070,909.05
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	357,842,615.05	357,842,615.05

国富亚洲机会股票（QDII）C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,939,782.96	46,939,782.96
本期申购	1,145,146,638.25	1,145,146,638.25
本期赎回（以“-”号填列）	-463,995,794.07	-463,995,794.07
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	728,090,627.14	728,090,627.14

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

国富亚洲机会股票（QDII）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	117,853,510.44	48,812,669.17	166,666,179.61
本期期初	117,853,510.44	48,812,669.17	166,666,179.61
本期利润	194,927,266.61	217,039,150.33	411,966,416.94
本期基金份额交易产生的变动数	111,265,235.72	109,827,925.80	221,093,161.52
其中：基金申购款	191,710,675.23	186,940,628.92	378,651,304.15
基金赎回款	-80,445,439.51	-77,112,703.12	-157,558,142.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	424,046,012.77	375,679,745.30	799,725,758.07

国富亚洲机会股票（QDII）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,442,287.57	13,430,696.66	36,872,984.23
本期期初	23,442,287.57	13,430,696.66	36,872,984.23
本期利润	365,685,742.04	300,682,153.39	666,367,895.43
本期基金份额交易产生的变动数	413,141,405.01	478,398,851.84	891,540,256.85
其中：基金申购款	714,598,800.30	822,744,663.68	1,537,343,463.98
基金赎回款	-301,457,395.29	-344,345,811.84	-645,803,207.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	802,269,434.62	792,511,701.89	1,594,781,136.51

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	392,876.12
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	27,560.06
其他	4,907.91
合计	425,344.09

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	571,284,813.52
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	571,284,813.52

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	6,179,522,147.43
减：卖出股票成本总额	5,590,160,203.13
减：交易费用	18,077,130.78
买卖股票差价收入	571,284,813.52

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	639,713.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,793.93
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	642,507.22

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	27,773,121.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	27,598,781.07

本总额	
减：应计利息总额	171,546.97
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	2,793.93

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,123,486.13
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	6,123,486.13

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	517,721,303.72
股票投资	517,643,568.65
债券投资	77,735.07
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	517,721,303.72

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,020,179.55
合计	2,020,179.55

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费用	16,706.56
证券组合费	14,060.05
其他手续费	41,484.65
合计	159,031.71

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、关联关系

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
摩根大通银行（“JP Morgan Chase Bank, National Association”）	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
摩根大通证券公共有限公司（“JP Morgan Securities PLC”）	境外资产托管人的全资子公司
摩根大通证券（“摩根大通证券”）	境外资产托管人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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（%）
JP Morgan Securities PLC	480,251,683.90	3.48	81,801,730.32	5.41
摩根大通证券	311,224,858.42	2.26	18,785,472.01	1.24

6.4.10.1.2 权证交易

无。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	占期末应付佣金总量的比例（%）
JP Morgan Securities PLC	512,642.92	5.09	—	—
摩根大通证券	140,051.56	1.39	36,805.01	5.16
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	占期末应付佣金总量的比例（%）
JP Morgan Securities PLC	90,479.83	7.97	—	—

摩根大通证券	8,453.45	0.74	2,790.35	16.64
--------	----------	------	----------	-------

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，以未包含印花税、经手费、证管费和过户费等费用的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，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。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,129,673.18	1,317,394.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,949,012.04	436,602.07
应支付基金管理人的净管理费	7,180,661.14	880,791.97

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 1.80% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.80\% \div \text{当年天数}。$$

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低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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,021,612.18	235,067.64

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 0.35% 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×0.35%÷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低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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富亚洲机会股票 (QDII) A	国富亚洲机会股票 (QDII) C	合计
国海富兰克林基金管理有限公司	—	110,272.85	110,272.85
合计	—	110,272.85	110,272.85
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富亚洲机会股票 (QDII) A	国富亚洲机会股票 (QDII) C	合计
国海富兰克林基金管理有限公司	—	3.77	3.77
合计	—	3.77	3.77

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国海富兰克林基金管理有限公司，再由国海富兰克林基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类份额基金资产净值×0.40%/当年天数。

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

- 1. 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。
- 2. 本报告期和上年度可比期间(2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日)基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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（2025 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
摩根大通银行	191,512,445.73	181,170.36	19,978,223.36	47,235.85
中国农业银行	163,739,195.27	211,705.76	2,999,014.77	19,947.63

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（2026 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

001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁定	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
668 HK	安克创新	2026 年 06 月 29 日	1 个月内（含）	新股未上市	86.33	86.26	37,000	3,194,134.18	3,191,782.28	-

注：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中需要限售的部分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

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 2026 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	355,251,641.00	-	-	-	355,251,641.00
结算备付金	91,012,987.19	-	-	-	91,012,987.19
存出保证金	993,376.48	-	-	-	993,376.48
交易性金融资产	179,680,178.39	-	-	-2,937,509,984.75	3,117,190,163.14
买入返售金融资产	88,007,498.08	-	-	-	88,007,498.08
应收股利	-	-	-	3,052,502.79	3,052,502.79
应收申购款	-	-	-	52,009,455.79	52,009,455.79
应收清算款	-	-	-	92,897,329.55	92,897,329.55
其他资产	-	-	-	256,522,865.49	256,522,865.49
资产总计	714,945,681.14	-	-	-3,341,992,138.37	4,056,937,819.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	125,508,595.53	125,508,595.53
应付管理人报酬	-	-	-	3,173,409.34	3,173,409.34
应付托管费	-	-	-	528,901.55	528,901.55
应付清算款	-	-	-	189,146,143.19	189,146,143.19
应付销售服务费	-	-	-	707,558.58	707,558.58
应交税费	-	-	-	3,490.72	3,490.72
其他负债	-	-	-	257,429,583.83	257,429,583.83
负债总计	-	-	-	576,497,682.74	576,497,682.74
利率敏感度缺口	714,945,681.14	-	-	-2,765,494,455.63	3,480,440,136.77
上年度末 2025 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	26,938,307.79	-	-	-	26,938,307.79
结算备付金	550,188.71	-	-	-	550,188.71
存出保证金	31,787.61	-	-	-	31,787.61

交易性金融资产	22,937,487.12	-	-	398,440,245.61	421,377,732.73
应收股利	-	-	-	196,236.29	196,236.29
应收申购款	-	-	-	15,964,544.86	15,964,544.86
应收清算款	-	-	-	8,159,010.10	8,159,010.10
其他资产	-	-	-	19,782,913.45	19,782,913.45
资产总计	50,457,771.23	-	-	442,542,950.31	493,000,721.54
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	9,405,406.86	9,405,406.86
应付管理人报酬	-	-	-	429,980.01	429,980.01
应付托管费	-	-	-	71,663.36	71,663.36
应付清算款	-	-	-	5,715,071.93	5,715,071.93
应付销售服务费	-	-	-	21,831.92	21,831.92
其他负债	-	-	-	20,045,767.66	20,045,767.66
负债总计	-	-	-	35,689,721.74	35,689,721.74
利率敏感度缺口	50,457,771.23	-	-	406,853,228.57	457,310,999.80

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 5.16%（上年度末：5.02%），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 2026 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	181,792,519.67	-	9,719,932.80	191,512,452.47
交易性金融资产	518,456,959.61	641,707,148.58	1,585,665,487.54	2,745,829,595.73

应收股利	252,649.59	1,599,668.74	1,200,184.46	3,052,502.79
应收清算款	—	—	72,238,641.29	72,238,641.29
其他资产	114,353,592.22	84,701,978.76	57,467,294.51	256,522,865.49
资产合计	814,855,721.09	728,008,796.08	1,726,291,540.60	3,269,156,057.77
以外币计价的负债				
应付清算款	—	84,701,978.76	22,354,413.21	107,056,391.97
其他负债	142,205,665.50	—	114,344,931.40	256,550,596.90
负债合计	142,205,665.50	84,701,978.76	136,699,344.61	363,606,988.87
资产负债表外汇风险敞口净额	672,650,055.59	643,306,817.32	1,589,592,195.99	2,905,549,068.90
项目	上年度末 2025 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	19,310,597.58	—	177,697.97	19,488,295.55
交易性金融资产	114,243,227.21	89,228,542.00	185,750,736.40	389,222,505.61
应收股利	52,237.48	—	143,998.81	196,236.29
应收清算款	—	8,159,010.10	—	8,159,010.10
其他资产	11,290,428.57	3,136,580.65	5,355,904.23	19,782,913.45
资产合计	144,896,4	100,524,132.75	191,428,337.41	436,848,961.00

	90.84			
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	-	5,355,904.23	5,355,904.23
其他负债	8,532,935 .16	11,295,590.75	-	19,828,525.91
负债合计	8,532,935 .16	11,295,590.75	5,355,904.23	25,184,430.14
资产负债表外 汇风险敞口净 额	136,363,5 55.68	89,228,542.00	186,072,433.18	411,664,530.86

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 所有外币相对人 民币升值 5%	145,277,453.45	20,583,226.54
	2. 所有外币相对人 民币贬值 5%	-145,277,453.45	-20,583,226.54

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	2,937,509,984.75	84.40	398,440,245.61	87.13
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	2,937,509,984.75	84.40	398,440,245.61	87.13

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	189,140,223.04	24,459,255.99
	2. 业绩比较基准下降 5%	-189,140,223.04	-24,459,255.99

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	2,933,246,972.64	398,440,245.61
第二层次	182,871,960.67	22,937,487.12
第三层次	1,071,229.83	—
合计	3,117,190,163.14	421,377,732.73

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	2,937,509,984.75	72.41
	其中：普通股	2,692,067,025.37	66.36
	存托凭证	245,442,959.38	6.05
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	179,680,178.39	4.43
	其中：债券	179,680,178.39	4.43
	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	88,007,498.08	2.17
	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	446,264,628.19	11.00
8	其他各项资产	405,475,530.10	9.99
9	合计	4,056,937,819.51	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 553,907,756.80 元，占期末净值比例为 15.91%。

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（%）
韩国	711,128,866.82	20.43
中国台湾	703,227,884.09	20.21
中国香港	641,707,148.58	18.44
美国	518,456,959.61	14.90
中国	191,680,389.02	5.51
日本	171,308,736.63	4.92
合计	2,937,509,984.75	84.40

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	45,861,107.62	1.32
消费者非必需品	95,983,870.89	2.76
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	171,753,053.60	4.93
信息技术	2,428,490,486.27	69.78
电信服务	195,421,466.37	5.61
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	2,937,509,984.75	84.40

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	台湾积 体电路 制造股 份有限 公司	2330 TT	台湾证 券交易 所	中国 台湾	358,000	184,499,475.71	5.30
1	TSMC	台湾积 体电路 制造股 份有限 公司	TSM UN	纽约证 券交易 所	美国	38,800	126,204,042.70	3.63
2	SK Hynix Inc	SK 海力 士株式 会社	000660 KS	韩国证 券交易 所	韩国	23,838	276,775,581.88	7.95
3	Samsung Electroni cs Co Ltd	三星电 子有限 公司	005930 KS	韩国证 券交易 所	韩国	153,863	225,336,974.88	6.47
4	ASML Holding NV	阿斯麦 控股公 司	ASML US	纳斯达 克证券 交易所	美国	8,800	119,238,916.68	3.43
5	Delta Electroni cs Inc	台达电 子工业 股份有 限公司	2308 TT	台湾证 券交易 所	中国 台湾	280,000	116,758,285.70	3.35
6	MediaTek Inc	联发科 技术股 份有限 公司	2454 TT	台湾证 券交易 所	中国 台湾	118,000	107,116,104.19	3.08
7	Murata Manufactu ring Co Ltd	村田制 作所	6981 JP	东京证 券交易 所	日本	218,000	104,444,404.95	3.00
8	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	1,188,000	95,806,102.59	2.75
9	Samsung Electro-M echanics	三星电 机公司	009150 KS	韩国证 券交易 所	韩国	9,800	94,734,418.56	2.72

	Co Ltd							
10	Accton Technology Corp	智邦科技股份有限公司	2345 TT	台湾证券交易所	中国台湾	175,000	93,369,206.03	2.68
11	Baidu Inc	百度集团股份有限公司	9888 HK	香港联合交易所	中国香港	888,800	84,607,609.50	2.43
12	Intel Corp	英特尔公司	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	88,800	84,449,329.87	2.43
13	SK Square Co Ltd	SK Square 株式会社	402340 KS	韩国证券交易所	韩国	10,800	79,797,092.46	2.29
14	Sandisk Corp	闪迪公司/特拉华州	SNDK US	纳斯达克证券交易所	美国	5,000	77,430,738.29	2.22
15	ASE Technology Holding Co Ltd	日月光投资控股股份有限公司	3711 TT	台湾证券交易所	中国台湾	528,000	76,778,195.78	2.21
16	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	3,088,000	62,921,653.10	1.81
17	NAURA Technology Group Co Ltd	北方华创科技股份有限公司	002371	深圳证券交易所	中国	68,800	60,857,728.00	1.75
18	ASMPT Ltd	ASMPT 公司	522 HK	香港联合交易所	中国香港	288,800	59,899,932.91	1.72
19	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD US	纳斯达克证券交易所	美国	15,000	59,347,798.79	1.71
20	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	中国香港	158,800	59,280,483.05	1.70
21	Chroma	致茂电	2360 TT	台湾证	中国	117,000	54,042,406.52	1.55

	ATE Inc	子股份 有限公司		券交易 所	台湾			
22	SMIC	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	688,000	53,422,078.56	1.53
23	NVIDIA Corp	英伟达公司	NVDA US	纳斯达克证 券交易所	美国	38,000	51,786,133.28	1.49
24	KB LAMINATES	建滔积层板控 股有限公司	1888 HK	香港联合交易 所	中国 香港	588,000	50,636,638.71	1.45
25	Taiyo Yuden Co Ltd	太阳诱电株式 会社	6976 JT	东京证 券交易所	日本	58,800	49,815,756.90	1.43
26	Advanced Micro-Fabrication Equipment	中微半 导体设备（上海）股 份有限公司	688012	上海证 券交易所	中国	102,512	48,026,872.00	1.38
27	Kingsoft Cloud Holdings Ltd	金山云控 股有限公司	3896 HK	香港联合交易 所	中国 香港	11,888,000	47,909,495.94	1.38
28	Cambricon Technologies Corp Ltd	中科寒武纪科 技股份有限公司	688256	上海证 券交易所	中国	28,800	45,951,840.00	1.32
29	CNBM	中国建 材股份有 限公司	3323 HK	香港联合交易 所	中国 香港	9,888,000	45,861,107.62	1.32
30	J&T Global Express Ltd	极兔速 递环球有 限公司	1519 HK	香港联合交易 所	中国 香港	5,888,000	42,753,227.26	1.23
31	Time Interconnect Technolog	汇聚科 技有限公 司	1729 HK	香港联合交易 所	中国 香港	2,410,000	35,417,037.06	1.02

	y Ltd							
32	SK Telecom Co Ltd	SK 电讯株式会社	017670 KS	韩国证券交易所	韩国	88,800	34,484,799.04	0.99
33	LXJM	立讯精密工业股份有限公司	002475	深圳证券交易所	中国	388,800	27,371,520.00	0.79
34	LandMark Optoelectronics Corp	联亚光电工业股份有限公司	3081 TT	台湾证券交易所	中国台湾	57,000	24,621,884.64	0.71
35	SoftBank Group Corp	软银集团	9984 JP	东京证券交易所	日本	68,000	17,048,574.78	0.49
36	Formosa Sumco Technology Corp	台塑胜高科技股份有限公司	3532 TT	台湾证券交易所	中国台湾	218,000	16,968,870.85	0.49
37	Global Unichip Corp	创意电子股份有限公司	3443 TT	台湾证券交易所	中国台湾	15,000	15,541,041.05	0.45
38	Shin Zu Shing Co Ltd	新日兴股份有限公司	3376 TT	台湾证券交易所	中国台湾	318,000	13,532,413.62	0.39
39	Sj Semiconductor Corporation	盛合晶微半导体有限公司	688820	上海证券交易所	中国	23,902	4,503,047.30	0.13
40	Anker Innovations Technology Co Ltd	安克创新科技股份有限公司	668 HK	香港联合交易所	中国香港	37,000	3,191,782.28	0.09
41	DapuStor Corp	深圳大普微电子股份有限公司	301666	深圳证券交易所	中国	3,048	1,769,366.20	0.05
42	TFC	苏州天孚光通信股份有限公司	300394	深圳证券交易所	中国	4,580	1,386,274.40	0.04

		司						
43	Chongqing Genori Technology Co Ltd	重庆臻宝科技股份有限公司	688797	上海证券交易所	中国	2,070	1,382,689.62	0.04
44	Wuxi Rich Intelligent Equipment	无锡理奇智能装备股份有限公司	301599	深圳证券交易所	中国	4,325	189,900.07	0.01
45	Tianhai Auto Electronics Group	天海汽车电子集团股份有限公司	001365	深圳证券交易所	中国	2,394	88,339.39	0.00
46	Ningbo Hicon Industry Technology	宁波惠康工业科技股份有限公司	001237	深圳证券交易所	中国	947	64,219.54	0.00
47	Beijing Victory Electric Co Ltd	北京维通利电气股份有限公司	001393	深圳证券交易所	中国	1,287	63,383.13	0.00
48	Hangzhou Fuen Co Ltd	杭州福恩股份有限公司	001312	深圳证券交易所	中国	1,333	25,209.37	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	TSMC	TSM UN	239,130,053.66	52.29
1	TSMC	2330 TT	205,569,009.35	44.95
2	SingTel	ST SP	303,659,192.88	66.40
3	Baidu Inc	9888 HK	195,435,085.34	42.74
3	Baidu Inc	BIDU UW	102,034,094.02	22.31
4	SK Hynix Inc	000660 KS	286,546,958.20	62.66
5	China Yangtze Power Co Ltd	600900	252,959,940.00	55.31

6	Samsung Electronics Co Ltd	005930 KS	249,464,384.30	54.55
7	SK Square Co Ltd	402340 KS	241,107,097.17	52.72
8	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	229,415,999.33	50.17
9	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	155,135,418.67	33.92
10	Murata Manufacturing Co Ltd	6981 JP	154,741,227.13	33.84
11	Intel Corp	INTC US	148,474,491.82	32.47
12	Tokio Marine Holdings Inc	8766 JT	147,876,155.40	32.34
13	Tencent Holdings Ltd	700 HK	144,027,736.41	31.49
14	Doosan Co Ltd	000150 KS	130,482,830.66	28.53
15	ASML Holding NV	ASML US	126,764,006.55	27.72
16	Yum China Holdings Inc	YUMC US	122,894,425.00	26.87
17	TFC	300394	118,972,984.85	26.02
18	Ibiden Co Ltd	4062 JP	110,907,777.67	24.25
19	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	009150 KS	106,640,051.11	23.32
20	Delta Electronics Inc	2308 TT	101,631,370.74	22.22
21	Cowell e Holdings Inc	1415 HK	93,911,426.14	20.54
22	Cambricon Technologies Corp Ltd	688256	90,137,940.31	19.71
23	NVIDIA Corp	NVDA US	88,323,213.26	19.31
24	Oracle Corp	ORCL US	86,741,486.95	18.97
25	Unimicron Technology Corp	3037 TT	85,351,113.17	18.66
26	JOYY Inc	JOYY US	83,611,623.96	18.28
27	CNBM	3323 HK	82,340,086.76	18.01
28	China Mobile Ltd	941 HK	82,076,426.66	17.95
29	KB LAMINATES	1888 HK	79,038,454.92	17.28
30	Sandisk Corp	SNDK US	76,164,861.67	16.65
31	KB Financial Group Inc	105560 KS	74,845,410.08	16.37
32	Hana Financial Group Inc	086790 KS	74,273,061.02	16.24

33	ASE Technology Holding Co Ltd	3711 TT	65,373,847.38	14.30
34	Wanguo Gold Group Ltd	3939 HK	64,277,705.55	14.06
35	SMIC	981 HK	64,068,415.78	14.01
36	Taiyo Yuden Co Ltd	6976 JT	63,428,499.80	13.87
37	Kingsoft Cloud Holdings Ltd	3896 HK	63,253,022.48	13.83
38	MediaTek Inc	2454 TT	62,924,845.36	13.76
39	CNOOC Ltd	883 HK	62,217,271.61	13.61
40	Furukawa Electric Co Ltd	5801 JP	61,964,341.17	13.55
41	LXJM	002475	61,945,974.00	13.55
42	Globalwafers Co Ltd	6488 TT	61,354,639.07	13.42
43	Snowflake Inc	SNOW US	60,617,768.18	13.26
44	Time Interconnect Technology Ltd	1729 HK	59,922,854.78	13.10
45	NAURA Technology Group Co Ltd	002371	57,469,191.00	12.57
46	Accton Technology Corp	2345 TT	54,198,492.88	11.85
47	CATL	300750	53,638,080.00	11.73
48	China BlueChemical Ltd	3983 HK	53,502,307.59	11.70
49	Coherent Corp	COHR US	52,638,975.64	11.51
50	Zijin Mining Group Co Ltd	2899 HK	52,623,056.48	11.51
51	Salesforce Inc	CRM US	51,981,245.74	11.37
52	Microsoft Corp	MSFT US	51,964,689.58	11.36
53	Sea Ltd	SE US	50,596,250.54	11.06
54	Lumentum Holdings Inc	LITE US	50,314,674.72	11.00
55	LG Energy Solution Ltd	373220 KS	48,733,033.50	10.66
56	J&T Global Express Ltd	1519 HK	44,947,782.35	9.83
57	USISH	601231	44,405,448.00	9.71
58	SK Telecom Co Ltd	017670 KS	43,670,092.90	9.55
59	Yancoal Australia Ltd	3668 HK	41,659,583.78	9.11
60	Chroma ATE Inc	2360 TT	41,465,589.09	9.07
61	Kuaishou Technology	1024 HK	41,094,337.19	8.99
62	Wolfspeed Inc	WOLF US	40,693,983.62	8.90

63	Kioxia Holdings Corp	285A JP	39,310,720.02	8.60
64	Elite Material Co Ltd	2383 TT	37,661,603.85	8.24
65	Mitsui Kinzoku Co Ltd	5706 JP	37,197,868.47	8.13
66	Semcorp Industries Ltd	SCI SP	36,208,350.90	7.92
67	ASMPT Ltd	522 HK	35,628,396.00	7.79
68	Li Auto Inc	LI US	35,615,505.75	7.79
69	Corning Inc	GLW US	32,760,027.79	7.16
70	Bizlink Holding Inc	3665 TT	31,937,609.83	6.98
71	Win Semiconductors Corp	3105 TT	31,621,632.53	6.91
72	RoboTechnik Intelligent Technology	300757	31,325,392.00	6.85
73	LandMark Optoelectronics Corp	3081 TT	31,096,507.06	6.80
74	Vnet Group Inc	VNET US	29,128,738.52	6.37
75	Insilico Medicine Cayman TopCo	3696 HK	28,811,971.83	6.30
76	Advanced Micro-Fabrication Equipment	688012	28,198,723.15	6.17
77	H World Group Ltd	HTHT US	27,904,998.13	6.10
78	Peric Special Gases Co Ltd	688146	27,247,153.42	5.96
79	ATRenew Inc	RERE US	26,566,434.38	5.81
80	Yangtze Optical Fibre & Cable	6869 HK	26,139,824.61	5.72
81	Workday Inc	WDAY US	23,791,612.84	5.20
82	SoftBank Group Corp	9984 JP	23,287,736.46	5.09
83	Broadcom Inc	AVGO US	23,227,273.75	5.08
84	Sumitomo Electric Industries Ltd	5802 JP	22,723,012.51	4.97
85	Mobvista Inc	1860 HK	21,043,760.40	4.60
86	Kinsus Interconnect Technology	3189 TT	20,539,786.95	4.49
87	Vanguard International Semiconductor	5347 TT	20,481,734.28	4.48

88	Perfect World Co Ltd	002624	19,820,389.00	4.33
89	Formosa Sumco Technology Corp	3532 TT	19,486,594.85	4.26
90	China Shenhua Energy Co Ltd	601088	18,551,558.20	4.06
91	Lingbao Gold Group Co Ltd	3330 HK	17,861,264.17	3.91
92	China Shipbuilding Industry Group Power Co Ltd	600482	17,057,143.00	3.73
93	Global Unichip Corp	3443 TT	16,491,138.02	3.61
94	Shin Zu Shing Co Ltd	3376 TT	16,445,109.07	3.60
95	Yageo Corp	2327 TT	15,829,741.80	3.46
96	FOCI Fiber Optic Communication	3363 TT	15,620,848.56	3.42
97	TAL Education Group	TAL US	15,195,789.07	3.32
98	QUALCOMM Inc	QCOM US	14,823,813.72	3.24
99	Atour Lifestyle Holdings Ltd	ATAT US	14,791,063.98	3.23
100	Kingdee International Software	268 HK	14,607,306.52	3.19
101	Micron Technology Inc	MU US	14,016,410.10	3.06
102	Jiaxin International Resources	3858 HK	13,233,853.20	2.89
103	Kingsoft Corp Ltd	3888 HK	12,647,191.70	2.77
104	Celestica Inc	CLS US	12,482,724.76	2.73
105	Kokusai Electric Corp	6525 JT	11,514,163.30	2.52
106	Netease Inc	9999 HK	9,722,325.56	2.13
107	China Shengmu Organic Milk Ltd	1432 HK	9,458,142.68	2.07
108	InnoScience Suzhou Technology	2577 HK	9,149,172.85	2.00

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	SingTel	ST SP	299,037,900.28	65.39

2	SK Square Co Ltd	402340 KS	297,790,587.21	65.12
3	China Yangtze Power Co Ltd	600900	254,317,821.79	55.61
4	TSMC	TSM UN	164,581,873.77	35.99
4	TSMC	2330 TT	49,903,711.98	10.91
5	Baidu Inc	9888 HK	105,425,553.17	23.05
5	Baidu Inc	BIDU UW	96,091,812.35	21.01
6	Ibiden Co Ltd	4062 JP	197,835,438.70	43.26
7	SK Hynix Inc	000660 KS	183,751,303.01	40.18
8	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	009150 KS	149,252,570.37	32.64
9	Samsung Electronics Co Ltd	005930 KS	147,870,917.15	32.33
10	Doosan Co Ltd	000150 KS	147,782,855.02	32.32
11	Tokio Marine Holdings Inc	8766 JT	144,720,024.22	31.65
12	Unimicron Technology Corp	3037 TT	133,493,841.28	29.19
13	KB LAMINATES	1888 HK	128,992,716.96	28.21
14	Yum China Holdings Inc	YUMC US	119,990,654.09	26.24
15	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	119,327,496.10	26.09
16	Intel Corp	INTC US	118,343,400.50	25.88
17	TFC	300394	112,259,918.99	24.55
18	Furukawa Electric Co Ltd	5801 JP	104,479,763.67	22.85
19	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	99,384,084.41	21.73
20	JOYY Inc	JOYY US	94,676,848.76	20.70
21	Snowflake Inc	SNOW US	88,818,624.24	19.42
22	China Mobile Ltd	941 HK	82,673,312.96	18.08
23	Tencent Holdings Ltd	700 HK	82,146,395.64	17.96
24	Oracle Corp	ORCL US	78,441,172.16	17.15
25	Murata Manufacturing Co Ltd	6981 JP	74,553,483.84	16.30
26	Hana Financial Group Inc	086790 KS	70,696,505.52	15.46
27	KB Financial Group Inc	105560 KS	67,362,224.83	14.73
28	Coherent Corp	COHR US	65,594,316.66	14.34

29	Lumentum Holdings Inc	LITE US	64,315,561.25	14.06
30	Elite Material Co Ltd	2383 TT	64,259,566.52	14.05
31	Peric Special Gases Co Ltd	688146	63,387,438.69	13.86
32	CNOOC Ltd	883 HK	56,179,350.73	12.28
33	CATL	300750	55,726,986.00	12.19
34	Globalwafers Co Ltd	6488 TT	54,556,263.34	11.93
35	Sea Ltd	SE US	54,480,353.25	11.91
36	Wanguo Gold Group Ltd	3939 HK	52,252,956.63	11.43
37	Microsoft Corp	MSFT US	51,276,962.46	11.21
38	Cambricon Technologies Corp Ltd	688256	50,528,421.56	11.05
39	LG Energy Solution Ltd	373220 KS	50,400,348.38	11.02
40	LXJM	002475	49,349,135.60	10.79
41	Zijin Mining Group Co Ltd	2899 HK	49,006,782.58	10.72
42	China BlueChemical Ltd	3983 HK	45,488,097.27	9.95
43	Kioxia Holdings Corp	285A JP	44,559,783.66	9.74
44	USISH	601231	43,640,375.12	9.54
45	Salesforce Inc	CRM US	43,556,739.40	9.52
46	MediaTek Inc	2454 TT	43,009,414.79	9.40
47	Wolfspeed Inc	WOLF US	40,487,608.50	8.85
48	Win Semiconductors Corp	3105 TT	38,880,949.74	8.50
49	Corning Inc	GLW US	37,267,620.08	8.15
50	Sembcorp Industries Ltd	SCI SP	36,931,649.37	8.08
51	Mitsui Kinzoku Co Ltd	5706 JP	35,708,374.31	7.81
52	Jiaxin International Resources	3858 HK	35,623,372.60	7.79
53	Yancoal Australia Ltd	3668 HK	35,419,083.38	7.75
54	Yangtze Optical Fibre & Cable	6869 HK	35,376,288.38	7.74
55	Li Auto Inc	LI US	35,162,730.15	7.69

56	Broadcom Inc	AVGO US	32,458,862.07	7.10
57	SMIC	981 HK	32,228,237.01	7.05
58	Kuaishou Technology	1024 HK	32,141,663.69	7.03
59	Wasion Holdings Ltd	3393 HK	31,458,054.32	6.88
60	LandMark Optoelectronics Corp	3081 TT	30,848,306.20	6.75
61	Vnet Group Inc	VNET US	28,456,531.05	6.22
62	ATRenew Inc	RERE US	28,450,402.18	6.22
63	RoboTechnik Intelligent Technology	300757	28,386,806.00	6.21
64	Sumitomo Electric Industries Ltd	5802 JP	26,796,483.59	5.86
65	NVIDIA Corp	NVDA US	26,434,556.28	5.78
66	H World Group Ltd	HTHT US	26,390,659.14	5.77
67	Bizlink Holding Inc	3665 TT	25,374,129.94	5.55
68	Cowell e Holdings Inc	1415 HK	24,062,737.14	5.26
69	Insilico Medicine Cayman TopCo	3696 HK	24,033,237.84	5.26
70	Delta Electronics Inc	2308 TT	24,003,209.64	5.25
71	Vanguard International Semiconductor	5347 TT	22,889,773.76	5.01
72	CNBM	3323 HK	22,214,236.13	4.86
73	Lingbao Gold Group Co Ltd	3330 HK	21,209,653.82	4.64
74	Workday Inc	WDAY US	20,856,927.12	4.56
75	ASE Technology Holding Co Ltd	3711 TT	20,616,197.68	4.51
76	Taiyo Yuden Co Ltd	6976 JT	20,518,288.45	4.49
77	Kinsus Interconnect Technology	3189 TT	19,449,303.87	4.25
78	FOCI Fiber Optic Communication	3363 TT	19,012,004.32	4.16
79	Perfect World Co Ltd	002624	18,665,377.00	4.08
80	Mobvista Inc	1860 HK	17,105,953.31	3.74
81	Yageo Corp	2327 TT	16,901,300.63	3.70
82	China Shenhua	601088	16,258,604.00	3.56

	Energy Co Ltd			
83	Accton Technology Corp	2345 TT	15,898,143.64	3.48
84	China Shipbuilding Industry Group Power Co Ltd	600482	15,661,785.00	3.42
85	Time Interconnect Technology Ltd	1729 HK	15,659,394.83	3.42
86	Atour Lifestyle Holdings Ltd	ATAT US	15,190,002.07	3.32
87	TAL Education Group	TAL US	15,014,454.04	3.28
88	ASML Holding NV	ASML US	14,633,175.45	3.20
89	Harbin Electric Co Ltd	1133 HK	14,369,811.77	3.14
90	NAURA Technology Group Co Ltd	002371	14,004,806.60	3.06
91	QUALCOMM Inc	QCOM US	13,830,527.51	3.02
92	Alphabet Inc	GOOG US	13,233,321.94	2.89
93	Micron Technology Inc	MU US	12,975,369.34	2.84
94	Kingsoft Corp Ltd	3888 HK	12,354,274.07	2.70
95	Sandisk Corp	SNDK US	12,302,513.23	2.69
96	Kingdee International Software	268 HK	11,900,414.43	2.60
97	Celestica Inc	CLS US	11,299,578.06	2.47
98	Futu Holdings Ltd	FUTU US	11,231,449.81	2.46
99	CIG Shanghai Co Ltd	6166 HK	10,904,900.49	2.38
100	Kokusai Electric Corp	6525 JT	10,532,529.83	2.30
101	ASMPT Ltd	522 HK	9,413,807.90	2.06
102	Kanto Denka Kogyo Co Ltd	4047 JT	9,244,058.16	2.02

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

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	7,611,765,726.95
卖出收入（成交）总额	6,179,522,147.43

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	179,680,178.39	5.16

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	019827	26 国债 01	108,800,000	109,505,232.66	3.15
2	019785	25 国债 13	69,300,000	70,174,945.73	2.02

注：1、债券代码为 ISIN 码或当地市场代码。

2、数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

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约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	993,376.48
2	应收清算款	92,897,329.55
3	应收股利	3,052,502.79
4	应收利息	—
5	应收申购款	52,009,455.79
6	其他应收款	256,522,865.49
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	405,475,530.10

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

份额级别	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 (%)
国富亚洲 机会股票 (QDII) A	151,939	2,355.17	143,106,174.65	39.99	214,736,440.40	60.01
国富亚洲 机会股票 (QDII) C	389,589	1,868.87	202,717,288.94	27.84	525,373,338.20	72.16
合计	541,528	2,005.31	345,823,463.59	31.85	740,109,778.60	68.15

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	81.59

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	国富亚洲机会股票（QDII）A	382,634.78	0.106928
	国富亚洲机会股票（QDII）C	76,126.75	0.010456
	合计	458,761.53	0.042246

8.4 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	份额级别	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	国富亚洲机会股票（QDII）A	10~50
	国富亚洲机会股票（QDII）C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有	国富亚洲机会股票（QDII）A	10~50

本开放式基金	国富亚洲机会股票（QDII）C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富亚洲机会股票（QDII）A	国富亚洲机会股票（QDII）C
基金合同生效日 （2012 年 2 月 22 日） 基金份额总额	327,738,555.14	—
本报告期期初基金份额总额	206,832,053.00	46,939,782.96
本报告期基金总申购份额	258,081,471.10	1,145,146,638.25
减：本报告期基金总赎回份额	107,070,909.05	463,995,794.07
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	357,842,615.05	728,090,627.14

§ 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

无。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人没有受到调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员没有受到调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
Sanford C. Bernstein (HK) Limited	—	2,909,300,113.44	21.10	841,735.10	8.35	—
Macquarie Capital Asia Limited	—	1,460,081,777.77	10.59	1,155,005.20	11.46	—
Daiwa Capital Markets Hongkong Limited	—	1,337,568,340.08	9.70	936,297.18	9.29	—
Jefferies International Limited	—	1,090,047,191.60	7.90	1,352,874.84	13.42	—
CLSA Limited	—	611,609,695.94	4.44	1,207,188.66	11.98	—
Yuantan	—	555,691,537.0	4.03	555,691.84	5.51	—

Securities Co., LTD		6				
JP Morgan Securities PLC	–	480,251,683.90	3.48	512,642.92	5.09	–
华安证券	1	445,787,034.63	3.23	200,604.24	1.99	–
Goldman Sachs	–	424,960,111.67	3.08	735,080.98	7.29	–
中信证券	3	417,394,624.10	3.03	187,827.89	1.86	–
Citigroup Global Markets Limited	–	415,914,770.19	3.02	332,731.82	3.30	–
中金公司	2	412,415,820.86	2.99	185,587.17	1.84	–
国盛证券	1	361,405,962.22	2.62	162,632.67	1.61	–
东北证券	1	339,092,059.54	2.46	152,592.47	1.51	–
摩根大通证券	1	311,224,858.42	2.26	140,051.56	1.39	–
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	–	303,029,059.61	2.20	303,959.30	3.02	–
高盛中国	1	274,016,129.08	1.99	123,307.27	1.22	–
天风证券	1	266,741,691.33	1.93	120,034.16	1.19	–
国泰海通	2	264,781,249.26	1.92	119,151.88	1.18	–
Nomura	–	260,614,903.95	1.89	260,614.92	2.59	–
山西证券	2	191,901,993.80	1.39	86,355.81	0.86	–
西藏东财证券	2	110,421,044.99	0.80	49,689.94	0.49	–
国信证券	1	103,526,025.23	0.75	46,586.70	0.46	–
国投证券	1	103,271,873.9	0.75	46,472.34	0.46	–

		5				
方正证券	1	84,632,982.04	0.61	38,084.96	0.38	—
Cathay Securities	—	61,618,367.20	0.45	67,780.28	0.67	—
兴业证券	1	39,646,010.88	0.29	17,840.71	0.18	—
Haitong International Securities Company Limited	—	35,254,914.24	0.26	35,254.86	0.35	—
申万宏源	1	26,863,139.12	0.19	12,088.41	0.12	—
Soochow Securities Hong Kong Financial Holdings Ltd.	—	26,102,961.95	0.19	26,102.98	0.26	—
CMB International Securities Limited	—	24,254,409.92	0.18	36,381.62	0.36	—
中泰证券	1	12,529,455.22	0.09	5,638.25	0.06	—
BOCI Securities Limited	—	12,399,958.41	0.09	14,879.95	0.15	—
华泰证券	2	8,640,000.42	0.06	3,888.00	0.04	—
招商证券	1	7,076,488.00	0.05	3,184.42	0.03	—
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	—	146,326.23	0.00	1,463.61	0.01	—
第一创业	1	—	—	—	—	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
国海证券	2	—	—	—	—	—
平安证券	2	—	—	—	—	—

申港证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	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，本基金交易单元无变更。

2、上表列示交易单元数量为截至本报告期末本基金租用数量，成交金额及佣金为本报告期间数。

10.7.2 基金租用或者通过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	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	76,491,516.00	36.33	98,452,000.00	50.12	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	25,008,556.00	11.88	88,000,000.00	44.79	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	10,000,000.00	5.09	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
国信 证券	34,590,593.00	16.43	-	-	-	-	-	-
国投 证券	53,327,263.00	25.33	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	8,101,765.00	3.85	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	13,010,148.00	6.18	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一 创业	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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 2026 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	2026 年 1 月 15 日
2	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 1 月 22 日
3	富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 1 月 22 日

4	关于增加上海陆金所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定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 1 月 29 日
5	富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金暂停大额申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 1 月 30 日
6	富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金暂停大额申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 2 月 6 日
7	富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金暂停大额申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 2 月 25 日
8	关于增加东方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	2026 年 3 月 10 日
9	关于增加玄元保险代理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定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 11 日
10	关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构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	2026 年 3 月 20 日
11	富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金暂停大额申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 24 日
12	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	2026 年 3 月 31 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（2025 年度）	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 31 日
14	富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 31 日
15	富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金暂停大额申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 16 日
16	关于增加深圳前海微众银行股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构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	2026 年 4 月 17 日
17	富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金 2026 年第 1 季度报	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 22 日

	告		
18	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 22 日
19	富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金暂停大额申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 29 日
20	国海富兰克林基金管理有限公司对外行使表决权（2025 年度）情况信息披露	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 30 日
21	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下公募基金产品开展直销中心认购、申购（含定投）、转换费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 5 月 30 日
22	关于增加深圳腾元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	2026 年 6 月 6 日
23	富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金更新招募说明书（2026 年 1 号）	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20260101-20260128	90,385,373.87	-	-	90,385,373.87	8.32
产品特有风险							
1. 流动性风险 投资者大额赎回所持有的基金份额时，为了实现基金资产的迅速变现，在基金交易过程中可能存在无法实现交易价格最优；亦或导致基金仓位调整困难，基金资产不能迅速转变成现金，产生流动性风险。 一旦引发巨额赎回，当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，可能出现比例赎回、延期支付赎回款等情形。 管理人有权根据本基金合同和招募说明书的约定，基于投资者保护原则，暂停或拒绝申购、暂停赎回。							
2. 估值风险 投资者大额赎回所持有的基金份额时，基金份额净值可能受到尾差和部分赎回费归入基金资产的							

影响，从而导致非市场因素的净值异常波动。

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亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

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

2026 年 8 月 31 日