2020年年度報告

2020年12月31日

# 富蘭克林國海潛力組合混合型證券投資基金

## 中港互認基金

This report shall not constitute an offer or a solicitation of an offer to buy units of Franklin Sealand China Prospect Mixed Assets Fund (the "Fund"). Subscriptions are to be made on the basis of the current Prospectus, the Hong Kong Covering Document and the Product Key Facts Statement accompanied by a copy of the latest available audited annual report and, if published thereafter, the latest unaudited interim report.

Investors should note that this report may contain information on unit classes that are not authorised for public distribution in Hong Kong as at 31 December 2020 and which are not available to Hong Kong investors.

本報告並不構成要約或招攬購買富蘭克林國海潛力組合混合型證券投資基金（"本基金"）的單位。基金單位須根據現行招募說明書、香港說明文件及產品資料概要（連同最近期的經審核年報及（如在其後刊發）最近期的未經審核中期報告的副本）認購。

投資者應注意，本報告可能載有截至2020年12月31日不可於香港作公開銷售及不可供香港投資者認購的單位類別的資料。

# 富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金
# 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

**§1 重要提示及目录.....2**
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
**§2 基金简介.....5**
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....5
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....6
**§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....7**
3.1 主要会计数据和财务指标.....7
3.2 基金净值表现.....8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....10
**§4 管理人报告.....12**
4.1 基金管理人及基金经理情况.....12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....16
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.....16
**§5 托管人报告.....17**
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....17
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.....17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....17
**§6 审计报告.....18**
6.1 审计报告基本信息.....18
6.2 审计报告的基本内容.....18
**§7 年度财务报表.....21**
7.1 资产负债表.....21
7.2 利润表.....22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....23
7.4 报表附注.....24
**§8 投资组合报告.....56**
8.1 期末基金资产组合情况.....56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....56
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....61
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....62
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....62

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... 62
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 ..... 62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 ..... 62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 62
8.12 投资组合报告附注 ..... 63
**§9 基金份额持有人信息 ..... 65**
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 ..... 65
**§10 开放式基金份额变动 ..... 67**
**§11 重大事件揭示 ..... 68**
11.1 基金份额持有人大会决议 ..... 68
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 ..... 68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 68
11.4 基金投资策略的改变 ..... 68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 ..... 68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 69
11.8 其他重大事件 ..... 70
**§12 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 76**
12.1 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 76
**§13 备查文件目录 ..... 77**
13.1 备查文件目录 ..... 77
13.2 存放地点 ..... 77
13.3 查阅方式 ..... 77
**§14 补充披露 ..... 78**

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 国富潜力组合混合 | |
| 基金主代码 | 450003 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2007 年 3 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 | 中国银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,885,609,946.27 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称： | 国富潜力组合混合 A-人民币 | 国富潜力组合混合 H-人民币 |
| 下属分级基金的交易代码： | 450003 | 960021 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,881,759,271.52 份 | 3,850,674.75 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 注重基金资产长期增值，投资未来收益具有成长性和资产价值低估的上市公司股票，为投资者赚取长期稳定的资本增值。 |
| 投资策略 | 在资产配置上，本基金采用“自下而上”的组合构建方法，从上市公司的具体发展前景和未来的盈利分析，到行业的发展趋势，再到宏观经济形势，确定大类资产的配置。<br>在运用了“自下而上”策略之后，根据市场环境的变化、市场出现的各种套利机会和未来的发展趋势判断，确定本基金资产配置最终的选择标准。<br>在股票投资上，本基金将运用定性和定量方法，通过对上市公司的财务分析和增长潜力分析，挑选出其中股价下跌风险最低且上涨空间最大的股票构建具体的股票组合。<br>在债券投资上，本基金的债券投资为股票投资由于市场条件所限，不易实施预定投资策略时，使部分资产保值增值的防守性措施。 |
| 业绩比较基准 | 85%×MSCI 中国 A 股指数+ 10%×中债国债总指数（全价）+ 5%×同业存款息率 |
| 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基金品种。 |

## 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 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 储丽莉 | 许俊 |
| | 联系电话 | 021-3855 5555 | 010-66594319 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 电子邮箱 | service@ftsfund.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-700-4518、9510-5680 和 021－38789555 | 95566 |
| 传真 | | 021-6888 3050 | 010-66594942 |
| 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 | 北京市西城区复兴门内大街 1 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 1 号 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100818 |
| 法定代表人 | | 吴显玲 | 刘连舸 |

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼 |
| 注册登记机构 | 国海富兰克林基金管理有限公司 | 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 9 层 |

# §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2020 年 | | 2019 年 | | 2018 年 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 国富潜力组合混合 A-人民币 | 国富潜力组合混合 H-人民币 | 国富潜力组合混合 A-人民币 | 国富潜力组合混合 H-人民币 | 国富潜力组合混合 A-人民币 | 国富潜力组合混合 H-人民币 |
| 本期已实现收益 | 739,651,829.83 | 635,072.07 | 181,197,765.20 | 222,666.00 | -30,638,905.77 | -1,783.46 |
| 本期利润 | 1,078,845,172.80 | 766,397.17 | 648,417,449.32 | 517,033.42 | -249,265,294.77 | -8,277.18 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.7451 | 0.6430 | 0.4787 | 0.3440 | -0.2149 | -0.2284 |
| 本期加权平均净值利润率 | 47.83% | 32.89% | 37.71% | 26.14% | -19.36% | -21.37% |
| 本期基金份额净值增长率 | 64.49% | 64.64% | 52.09% | 52.14% | -18.16% | -18.14% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2020 年末 | | 2019 年末 | | 2018 年末 | |
| 期末可供分配利润 | 947,032,153.89 | 1,569,503.08 | 363,220,496.97 | 201,957.42 | -25,523,144.77 | -4,161.03 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.5033 | 0.4076 | 0.2141 | 0.0979 | -0.0224 | -0.0299 |
| 期末基金资产净值 | 3,077,089,814.97 | 7,463,179.19 | 2,059,712,861.98 | 2,770,493.61 | 1,114,538,685.02 | 134,839.54 |
| 期末基金份额净值 | 1.635 | 1.938 | 1.214 | 1.343 | 0.978 | 0.970 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2020 年末 | | 2019 年末 | | 2018 年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 394.71% | 142.97% | 200.75% | 47.58% | 97.75% | -3.00% |

注：

1. 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则－第 1 号

《主要财务指标的计算及披露》。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益.

3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4. 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

## 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

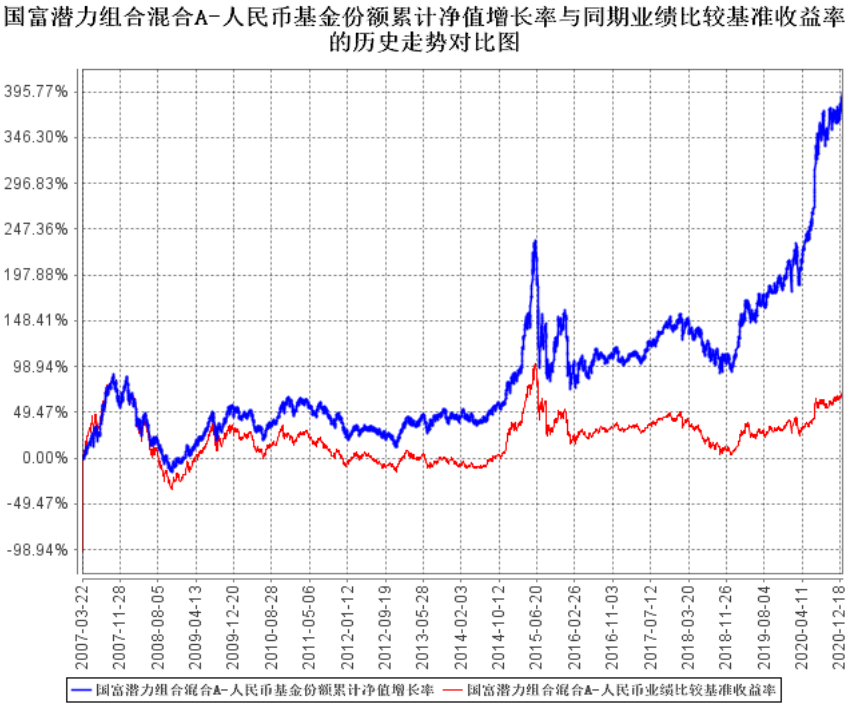
国富潜力组合混合 A-人民币

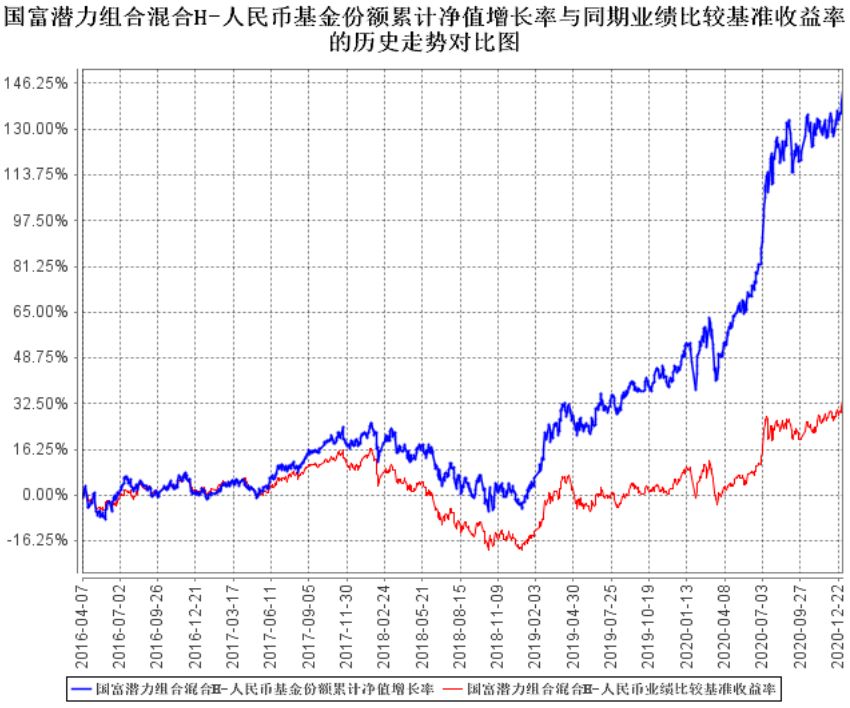
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 9.54% | 1.12% | 10.88% | 0.87% | -1.34% | 0.25% |
| 过去六个月 | 30.86% | 1.35% | 19.02% | 1.16% | 11.84% | 0.19% |
| 过去一年 | 64.49% | 1.46% | 24.93% | 1.25% | 39.56% | 0.21% |
| 过去三年 | 104.74% | 1.38% | 21.06% | 1.16% | 83.68% | 0.22% |
| 过去五年 | 96.84% | 1.38% | 15.51% | 1.10% | 81.33% | 0.28% |
| 自基金合同生效起至今 | 394.71% | 1.56% | 71.70% | 1.46% | 323.01% | 0.10% |

国富潜力组合混合 H-人民币

| 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 | 9.46% | 1.11% | 10.88% | 0.87% | -1.42% | 0.24% |
| 过去六个月 | 30.84% | 1.34% | 19.02% | 1.16% | 11.82% | 0.18% |
| 过去一年 | 64.64% | 1.46% | 24.93% | 1.25% | 39.71% | 0.21% |
| 过去三年 | 105.04% | 1.38% | 21.06% | 1.16% | 83.98% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 142.97% | 1.22% | 33.38% | 1.01% | 109.59% | 0.21% |

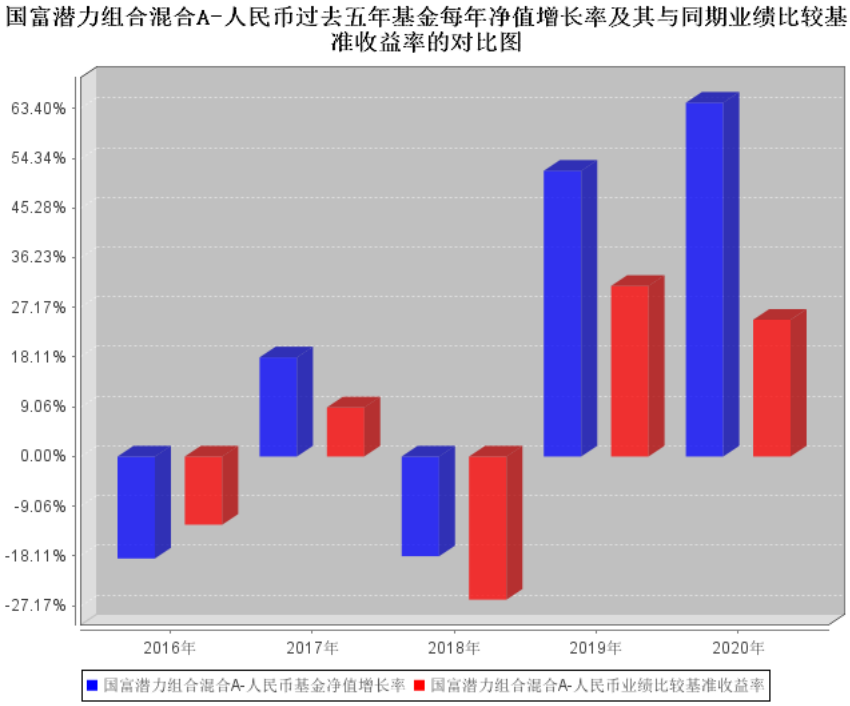
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

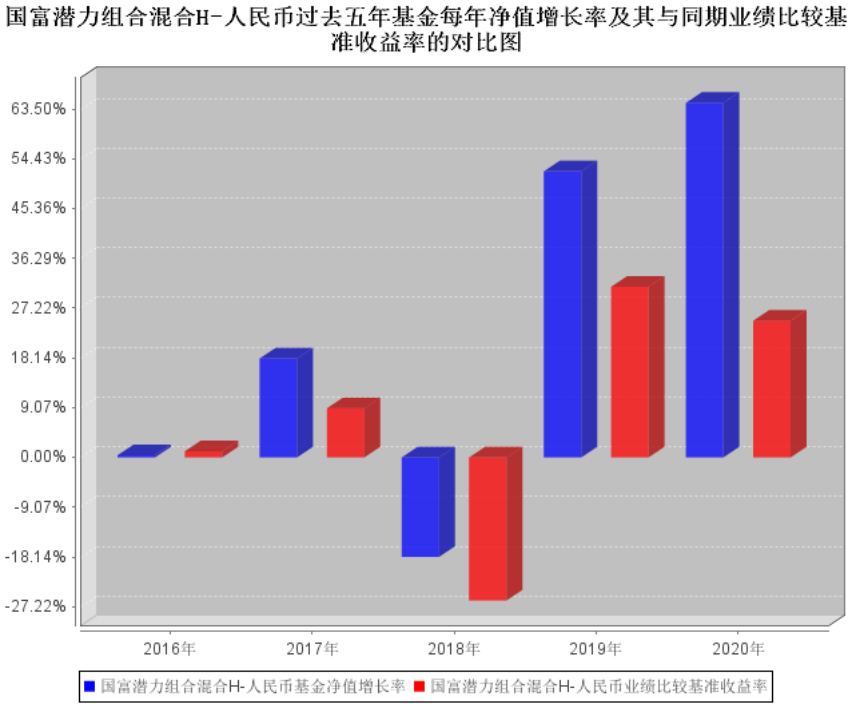



注：本基金的基金合同生效日为 2007 年 3 月 22 日，本基金 H 类份额的首个估值日为 2016 年 4 月 7 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较




注：本基金 H 类份额的首个估值日为 2016 年 4 月 7 日，故 2016 年业绩为首个估值日至年底而非全年的业绩。

## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 国富潜力组合混合 A-人民币 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 年度 | 每10份基金 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放 | 年度利润分配合计 | 备注 |

| | 份额分红数 | | 总额 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 2020 | 3.4510 | 396,530,288.89 | 209,304,529.44 | 605,834,818.33 | |
| 2019 | 2.6030 | 287,309,843.97 | 156,411,089.62 | 443,720,933.59 | |
| 2018 | - | - | - | - | |
| 合计 | 6.0540 | 683,840,132.86 | 365,715,619.06 | 1,049,555,751.92 | |

单位：人民币元

| 国富潜力组合混合 H-人民币 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
| 2020 | 2.6050 | 392,064.91 | 487,629.55 | 879,694.46 | |
| 2019 | 1.2680 | 50.05 | 243,678.60 | 243,728.65 | |
| 2018 | - | - | - | - | |
| 合计 | 3.8730 | 392,114.96 | 731,308.15 | 1,123,423.11 | |

# §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国海富兰克林基金管理有限公司成立于 2004 年 11 月，由国海证券股份有限公司和富兰克林邓普顿投资集团全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建，国海证券股份有限公司持有 51%的股份，邓普顿国际股份有限公司持有 49%的股份。目前公司注册资本 2.2 亿元人民币。

国海证券股份有限公司是国内 A 股市场第 16 家上市券商，是拥有全业务牌照，营业网点遍布中国主要城市的全国性综合类证券公司。富兰克林邓普顿投资集团是世界知名基金管理公司，在全球市场具备超过 70 年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿投资集团享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系，借助国海证券股份有限公司的综合业务优势，力争成为国内一流的基金管理公司。

国海富兰克林基金管理有限公司具有丰富的基金管理经验，截至 2020 年末，公司旗下合计管理 36 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 | | |
| 徐荔蓉 | 公司副总经理、投资总监、研究分析部总经理，国富中国收益混合基金、国富潜力组合混合基金、国富研究精选混合基金及国富价值成长一年持有期混合基金的基金经 | 2014 年 2 月 21 日 | - | 23 年 | 徐荔蓉先生，CFA，CPA（非执业），律师（非执业），中央财经大学经济学硕士。历任中国技术进出口总公司金融部副总经理、融通基金管理有限公司基金经理、申万巴黎基金管理有限公司（现“申万菱信基金管理有限公司”）基金经理、国海富兰克林基金管理有限公司高级顾问、资产管理部总经理兼投资经理、管理层董事。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 理 | | | | 限公司副总经理、投资总监、研究分析部总经理，国富中国收益混合基金、国富潜力组合混合基金、国富研究精选混合基金及国富价值成长一年持有期混合基金的基金经理。 |

注：

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

2. 表中“证券从业年限”的计算标准为该名员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

1.在研究信息共享方面，投资研究等部门通过定期的例会沟通机制，就相关议题进行讨论；公司建立了统一的研究平台，研究报告信息通过研究平台进行发布。

2.建立投资对象备选库，股票及债券的入库需要由研究报告支持作为依据，并经过相关领导审批；建立研究报告的定期更新机制。

3.在投资决策方面，公司在各类资产管理业务之间建立防火墙，确保业务隔离及人员隔离，同时各投资组合经理投资决策保持独立。

4.公司对所有投资组合的交易指令实行集中交易，公司在交易系统中设置公平交易功能，按照时间优先、价格优先的原则执行各账户所有指令；公司建立和完善了对债券一级市场申购、非

公开发行股票申购等交易分配制度，以确保相关投资组合能够得到公平对待。

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

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

报告期末，公司共管理了三十六只公募基金及六只专户产品。统计所有投资组合分投资类别（股票、债券）过去连续 4 个季度内在不同时间窗口（T=1、T=3 和 T=5）存在同向交易价差的样本，并对差价率均值、交易价格占优比率、t 值、贡献率等指标进行分析，报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司按照《异常交易监控与报告制度》，系统划分了异常交易的类型、异常交易的界定标准、异常交易的识别程序，制订了异常交易的监控办法，并规范了异常交易的分析、报告制度。

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

报告期内，公司不同投资组合之间未发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况，经公司检查和分析未发现异常情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年股票市场继续保持震荡上扬的格局，虽然新冠病毒对经济和市场带来了较大的负面冲击，但迅速恢复的经济和充足的流动性使得股票市场表现良好。在各个行业中的优质公司逐步脱颖而出，表现了强大的韧性和战略能力，继续保持或扩大了在各自行业的市场占有率及净资产回报率，在股票市场上这类公司也表现良好，市场结构性行情的特征十分明显。

本基金在 2020 年仍然保持了相对均衡的投资组合，长期持有的大部分优质公司也表现良好，我们全年仍然保持了相对较低的组合换手率，对部分估值过高的公司进行了坚持，同时充分利用

新冠疫情冲击市场恐慌性下跌的时机对部分优质公司进行了增持，总体看基本实现了投资预期。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.635 元，本报告期内份额净值上涨 64.49%，业绩比较基准上涨 24.93%，跑赢业绩比较基准 39.56%；本基金 H 类份额净值为 1.938 元，本报告期内份额净值上涨 64.64%，业绩比较基准上涨 24.93%，跑赢业绩比较基准 39.71%。基金大幅度战胜了业绩基准，主要的业绩贡献来自于长期持有核心公司。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来我们仍然对中国股票市场的长期向好持乐观的看法，中国经济展现的韧性和优质公司的不断涌现为市场的长期向好提供了保证，国内居民的资产转移和全球对中国资产的重估提供了充足的流动性，相对友好和包容的政策环境结合长期走低的利率非常有利于股票市场。对 2021 年我们认为市场仍然将保持向上的格局，市场结构可能出现一定的变化，随着过去三年结构性行情的发展，均值回归很可能成为 2021 年的投资主线，优质公司的估值提升很可能放缓或收敛以等待基本面的跟上，低估值类的公司在宏观整体向上并很可能超预期的情况下很可能出现一定的估值回升，战胜以沪深 300 为代表的指数对主动投资者可能会更具挑战性。我们将继续保持均衡布局的组合结构，继续坚定持有优质公司，同时继续挖掘估值合理的周期成长公司来使组合更加平衡。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的基金管理人于 2020 年 12 月 15 日宣告本报告期第一次分红，向截至 2020 年 12 月 17 日止在本基金注册登记人国海富兰克林基金管理有限公司登记在册的 A 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 3.451 元，H 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 2.605 元。

本基金本报告期所实现的利润分配情况符合基金合同要求。

## 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，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在对富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

# §6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

| | |
|---|---|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2021)第 21571 号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题 | 审计报告 |
|---|---|
| 审计报告收件人 | 富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | （一）我们审计的内容<br>我们审计了富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金(以下简称“国富潜力组合混合基金”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。<br><br>（二）我们的意见<br>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了国富潜力组合混合基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。<br><br>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国富潜力组合混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 国富潜力组合混合基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 |

| | |
|---|---|
| | 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估国富潜力组合混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算国富潜力组合混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。<br><br>基金管理人治理层负责监督国富潜力组合混合基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。<br><br>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：<br><br>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。<br><br>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。<br><br>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。<br><br>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。 |

| | |
|---|---|
| | 同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国富潜力组合混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国富潜力组合混合基金不能持续经营。<br><br>（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。<br><br>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 注册会计师的姓名 | 薛竞　　俞伟敏 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼 |
| 审计报告日期 | 2021 年 3 月 25 日 |

# §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金

报告截止日： 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 15,846,973.01 | 33,149,660.94 |
| 结算备付金 | | 7,496,742.23 | 1,635,218.93 |
| 存出保证金 | | 428,426.15 | 403,237.57 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 3,073,215,550.35 | 2,032,697,518.04 |
| 其中：股票投资 | | 2,896,983,150.35 | 1,952,633,518.04 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 176,232,400.00 | 80,064,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 4,166,661.07 | 2,066,711.32 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 2,768,348.93 | 831,452.75 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 3,103,922,701.74 | 2,070,783,799.55 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末<br>2020 年 12 月 31 日** | **上年度末<br>2019 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 5,809,786.48 | 10,764.87 |
| 应付赎回款 | | 5,575,853.26 | 2,945,551.38 |
| 应付管理人报酬 | | 4,035,548.31 | 2,846,416.99 |
| 应付托管费 | | 672,591.35 | 474,402.82 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 2,468,798.74 | 1,233,581.78 |
| 应交税费 | | 546,660.00 | 546,660.00 |
| 应付利息 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 260,469.44 | 243,066.12 |
| 负债合计 | | 19,369,707.58 | 8,300,443.96 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 1,885,609,946.27 | 1,698,555,629.48 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 1,198,943,047.89 | 363,927,726.11 |
| 所有者权益合计 | | 3,084,552,994.16 | 2,062,483,355.59 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,103,922,701.74 | 2,070,783,799.55 |

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,885,609,946.27 份，其中富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金 A 类-人民币基金份额 1,881,759,271.52 份，基金份额净值 1.635 元；富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金 H 类-人民币基金份额 3,850,674.75 份，基金份额净值 1.938 元。

## 7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **一、收入** | | 1,128,979,625.90 | 686,775,303.07 |
| 1.利息收入 | | 3,324,922.56 | 2,956,302.20 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 238,563.93 | 379,256.59 |
| 债券利息收入 | | 3,086,358.63 | 2,573,556.85 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 3,488.76 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 784,995,024.99 | 215,513,840.29 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 760,590,273.20 | 195,461,530.40 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 3,289,578.71 | -291,380.50 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 21,115,173.08 | 20,343,690.39 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | 339,324,668.07 | 467,514,051.54 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 列） | | | |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 1,335,010.28 | 791,109.04 |
| **减：二、费用** | | 49,368,055.93 | 37,840,820.33 |
| 1．管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 33,668,220.92 | 25,823,130.11 |
| 2．托管费 | 7.4.10.2.2 | 5,611,370.04 | 4,303,855.03 |
| 3．销售服务费 | | - | - |
| 4．交易费用 | 7.4.7.18 | 9,798,549.34 | 7,434,799.62 |
| 5．利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6．税金及附加 | | 7.71 | - |
| 7．其他费用 | 7.4.7.19 | 289,907.92 | 279,035.57 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 1,079,611,569.97 | 648,934,482.74 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 1,079,611,569.97 | 648,934,482.74 |

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,698,555,629.48 | 363,927,726.11 | 2,062,483,355.59 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,079,611,569.97 | 1,079,611,569.97 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 187,054,316.79 | 362,118,264.60 | 549,172,581.39 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,033,046,864.51 | 750,388,579.33 | 1,783,435,443.84 |
| 2.基金赎回款 | -845,992,547.72 | -388,270,314.73 | -1,234,262,862.45 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以 | - | -606,714,512.79 | -606,714,512.79 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| “-”号填列） | | | |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,885,609,946.27 | 1,198,943,047.89 | 3,084,552,994.16 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,140,200,830.36 | -25,527,305.80 | 1,114,673,524.56 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 648,934,482.74 | 648,934,482.74 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 558,354,799.12 | 184,485,211.41 | 742,840,010.53 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,086,648,079.57 | 339,457,995.99 | 1,426,106,075.56 |
| 2.基金赎回款 | -528,293,280.45 | -154,972,784.58 | -683,266,065.03 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -443,964,662.24 | -443,964,662.24 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,698,555,629.48 | 363,927,726.11 | 2,062,483,355.59 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

林勇　　于意　　肖燕

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金(原富兰克林国海潜力组合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”)证监基金字[2007]第 56 号《关于同意富兰克林国海潜力组合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《富兰克林国海潜力组合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 8,756,545,930.64 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(2007)第 26 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金基金合同》于 2007 年 3 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 8,756,866,710.48 份基金份额，其中认购资金利息折合 320,779.84 份基金份额。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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

根据《关于富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金修改基金合同的公告》以及更新的《富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，自 2016 年 2 月 29 日起，本基金根据销售对象的不同，将基金份额分为不同的类别。在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的份额，称为 A 类基金份额；在中国香港地区销售的、为中国香港投资者设立的份额，称为 H 类基金份额。新设的份额类别为 H 类-人民币基金份额、H 类-美元基金份额和 H 类-港币基金份额，原人民币基金份额更名为 A 类-人民币基金份额。本基金 A 类基金份额、H 类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行的股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其中，股票投资范围包括所有在国内依法公开发行上市的 A 股；债券投资范围包括国内国债、金融债、企业债和可转换债券等。本基金投资组合的范围为：股票资产占基金资产的 60%-95%，债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中，基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的股票投资主要集中价格下跌风险较低、上涨空间较大的上市公司股票，该部分的投资比例将不低于本基金股票资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：85%×MSCI 中国 A 股指数＋10%×中债国债总指数(全价)＋5%×同业存款利率。

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 2021 年 3 月 25 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投

资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流

通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融

机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向该内地基金分配利息时按照 7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10%的税率代扣代缴所得税。

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款 | 15,846,973.01 | 33,149,660.94 |
| 定期存款 | - | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合计： | 15,846,973.01 | 33,149,660.94 |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 2,196,821,522.67 | 2,896,983,150.35 | 700,161,627.68 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 125,936,563.40 | 125,987,400.00 | 50,836.60 |
| | 银行间市场 | 51,164,600.00 | 50,245,000.00 | -919,600.00 |
| | 合计 | 177,101,163.40 | 176,232,400.00 | -868,763.40 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 2,373,922,686.07 | 3,073,215,550.35 | 699,292,864.28 |
| 项目 | | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 | | |
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 1,592,341,928.23 | 1,952,633,518.04 | 360,291,589.81 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 债券 | 交易所市场 | 40,044,033.60 | 40,048,000.00 | 3,966.40 |
| | 银行间市场 | 40,343,360.00 | 40,016,000.00 | -327,360.00 |
| | 合计 | 80,387,393.60 | 80,064,000.00 | -323,393.60 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 1,672,729,321.83 | 2,032,697,518.04 | 359,968,196.21 |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应收活期存款利息 | 1,971.39 | 21,574.18 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | 3,373.60 | 735.80 |
| 应收债券利息 | 4,161,123.28 | 2,044,219.18 |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | - | - |
| 应收申购款利息 | - | 0.66 |
| 其他 | 192.80 | 181.50 |
| 合计 | 4,166,661.07 | 2,066,711.32 |

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 交易所市场应付交易费用 | 2,468,798.74 | 1,233,581.78 |

| | | |
|---|---|---|
| 银行间市场应付交易费用 | - | - |
| 合计 | 2,468,798.74 | 1,233,581.78 |

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 11,469.44 | 4,066.12 |
| 审计费用 | 120,000.00 | 110,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 债券账户维护费 | 9,000.00 | 9,000.00 |
| 合计 | 260,469.44 | 243,066.12 |

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 国富潜力组合混合 A-人民币 | | |
|---|---|---|
| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,696,492,365.01 | 1,696,492,365.01 |
| 本期申购 | 1,029,068,408.79 | 1,029,068,408.79 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -843,801,502.28 | -843,801,502.28 |
| 本期末 | 1,881,759,271.52 | 1,881,759,271.52 |

金额单位：人民币元

| 国富潜力组合混合 H-人民币 | | |
|---|---|---|
| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,063,264.47 | 2,063,264.47 |
| 本期申购 | 3,978,455.72 | 3,978,455.72 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,191,045.44 | -2,191,045.44 |
| 本期末 | 3,850,674.75 | 3,850,674.75 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 国富潜力组合混合 A-人民币 | | | |
|---|---|---|---|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 570,998,139.79 | -207,777,642.82 | 363,220,496.97 |
| 本期利润 | 739,651,829.83 | 339,193,342.97 | 1,078,845,172.80 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 242,217,002.60 | 116,882,689.41 | 359,099,692.01 |
| 其中：基金申购款 | 645,668,266.60 | 100,681,828.65 | 746,350,095.25 |
| 基金赎回款 | -403,451,264.00 | 16,200,860.76 | -387,250,403.24 |
| 本期已分配利润 | -605,834,818.33 | - | -605,834,818.33 |
| 本期末 | 947,032,153.89 | 248,298,389.56 | 1,195,330,543.45 |

单位：人民币元

| 国富潜力组合混合 H-人民币 | | | |
|---|---|---|---|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 201,957.42 | 505,271.72 | 707,229.14 |
| 本期利润 | 635,072.07 | 131,325.10 | 766,397.17 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,612,168.05 | 1,406,404.54 | 3,018,572.59 |
| 其中：基金申购款 | 1,974,121.25 | 2,064,362.83 | 4,038,484.08 |
| 基金赎回款 | -361,953.20 | -657,958.29 | -1,019,911.49 |
| 本期已分配利润 | -879,694.46 | - | -879,694.46 |
| 本期末 | 1,569,503.08 | 2,043,001.36 | 3,612,504.44 |

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款利息收入 | 198,373.93 | 308,768.30 |
| 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 | 33,611.70 | 36,718.93 |
| 其他 | 6,578.30 | 33,769.36 |
| 合计 | 238,563.93 | 379,256.59 |

### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 3,263,892,278.88 | 2,429,663,154.42 |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,503,302,005.68 | 2,234,201,624.02 |
| 买卖股票差价收入 | 760,590,273.20 | 195,461,530.40 |

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|---|---|---|
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 3,289,578.71 | -291,380.50 |
| 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 | 3,289,578.71 | -291,380.50 |

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|---|---|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 139,082,314.91 | 148,134,351.18 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 132,278,533.60 | 144,145,552.70 |
| 减：应收利息总额 | 3,514,202.60 | 4,280,178.98 |
| 买卖债券差价收入 | 3,289,578.71 | -291,380.50 |

### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---|---|---|

| | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 21,115,173.08 | 20,343,690.39 |
| 合计 | 21,115,173.08 | 20,343,690.39 |

### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 339,324,668.07 | 467,514,051.54 |
| ——股票投资 | 339,870,037.87 | 467,926,975.14 |
| ——债券投资 | -545,369.80 | -412,923.60 |
| ——资产支持证券投资 | - | - |
| ——贵金属投资 | - | - |
| ——其他 | - | - |
| 2.衍生工具 | - | - |
| ——权证投资 | - | - |
| 3.其他 | - | - |
| 合计 | 339,324,668.07 | 467,514,051.54 |

### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 基金赎回费收入 | 1,217,787.52 | 775,848.12 |
| 转换费收入 | 117,222.76 | 15,260.92 |
| 合计 | 1,335,010.28 | 791,109.04 |

注：

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

2. H 类基金份额的赎回费率为 0.15%，赎回费总额 100%归入基金资产。H 类基金份额暂未开通转换业务。

### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 9,798,024.34 | 7,434,149.62 |
| 银行间市场交易费用 | 525.00 | 650.00 |
| 合计 | 9,798,549.34 | 7,434,799.62 |

### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 审计费用 | 120,000.00 | 110,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 债券账户维护费 | 36,000.00 | 36,000.00 |
| 银行汇划费用 | 10,207.92 | 11,835.57 |
| 其他手续费 | 1,200.00 | 1,200.00 |
| 律师费 | 2,500.00 | - |
| 合计 | 289,907.92 | 279,035.57 |

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 国海富兰克林基金管理有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司("中国银行") | 基金托管人、基金销售机构 |
| 国海证券股份有限公司("国海证券") | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 邓普顿国际股份有限公司(Templeton International, Inc.) | 基金管理人的股东 |

| | |
|---|---|
| 国海富兰克林资产管理(上海)有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 33,668,220.92 | 25,823,130.11 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 4,141,949.84 | 3,408,598.49 |

注：支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的基金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：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,611,370.04 | 4,303,855.03 |

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值 0.25% / 当年天数。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 国富潜力组合混合 A-人民币 | 国富潜力组合混合 H-人民币 |
| 基金合同生效日（ 2007 年 3 月 22 日 ）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 8,835,744.52 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 1,943,413.28 | - |
| 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 | 10,779,157.80 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.57% | - |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 国富潜力组合混合 A-人民币 | 国富潜力组合混合 H-人民币 |
| 基金合同生效日（ 2007 年 3 月 22 日 ）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 12,906,586.18 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 8,835,744.52 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 12,906,586.18 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 8,835,744.52 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.52% | - |

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

1.本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

2.本报告期末和上年度末（2019 年 12 月 31 日）除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行 | 15,846,973.01 | 198,373.93 | 33,149,660.94 | 308,768.30 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。于 2019 年度，本基金因投资中国银行的同业存单而取得的利息收入为人民币 70,757.85 元。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有 175,000 张中国银行的同业存单，成本总额为人民币 16,969,120.00 元，估值总额为人民币 16,989,000.00 元，占基金资产净值的比例为 3.06%。

### 7.4.11 利润分配情况

国富潜力组合混合A-人民币

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2020 年 12 月 17 日 | - | 2020 年 12 月 17 日 | 3.4510 | 396,530,288.89 | 209,304,529.44 | 605,834,818.33 | |
| 合计 | - | - | | 3.4510 | 396,530,288.89 | 209,304,529.44 | 605,834,818.33 | |

国富潜力组合混合 H-人民币

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2020 年 12 月 17 日 | - | 2020 年 12 月 17 日 | 2.6050 | 392,064.91 | 487,629.55 | 879,694.46 | |
| 合计 | - | - | | 2.6050 | 392,064.91 | 487,629.55 | 879,694.46 | |

## 7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 002254 | 泰和新材 | 2020 年 11 月 3 日 | 2021 年 5 月 6 日 | 新股锁定 | 14.56 | 14.59 | 112,637 | 1,639,994.72 | 1,643,373.83 | - |
| 688617 | 惠泰医疗 | 2020 年 12 月 30 日 | 2021 年 1 月 7 日 | 新股未上市 | 74.46 | 74.46 | 1,673 | 124,571.58 | 124,571.58 | - |
| 300926 | 博俊科技 | 2020 年 12 月 29 日 | 2021 年 1 月 7 日 | 新股未上市 | 10.76 | 10.76 | 3,225 | 34,701.00 | 34,701.00 | - |
| 605277 | 新亚电子 | 2020 年 12 月 25 日 | 2021 年 1 月 6 日 | 新股未上市 | 16.95 | 16.95 | 507 | 8,593.65 | 8,593.65 | - |
| 003030 | 祖名股份 | 2020 年 12 月 25 日 | 2021 年 1 月 6 日 | 新股未上市 | 15.18 | 15.18 | 480 | 7,286.40 | 7,286.40 | - |
| 003031 | 中瓷电子 | 2020 年 12 月 24 日 | 2021 年 1 月 4 | 新股未上市 | 15.27 | 15.27 | 387 | 5,909.49 | 5,909.49 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 日 | | | | | | | |
| 300999 | 金龙鱼 | 2020 年 9 月 29 日 | 2021 年 4 月 15 日 | 新股锁定 | 25.70 | 88.29 | 10,448 | 268,513.60 | 922,453.92 | - |
| 688339 | 亿华通 | 2020 年 7 月 31 日 | 2021 年 2 月 10 日 | 新股锁定 | 76.65 | 257.95 | 2,761 | 211,630.65 | 712,199.95 | - |
| 688301 | 奕瑞科技 | 2020 年 9 月 9 日 | 2021 年 3 月 18 日 | 新股锁定 | 119.60 | 162.72 | 2,427 | 290,269.20 | 394,921.44 | - |
| 300896 | 爱美客 | 2020 年 9 月 21 日 | 2021 年 3 月 29 日 | 新股锁定 | 118.27 | 603.36 | 473 | 55,941.71 | 285,389.28 | - |
| 300862 | 蓝盾光电 | 2020 年 8 月 7 日 | 2021 年 3 月 4 日 | 新股锁定 | 33.95 | 38.54 | 5,843 | 198,369.85 | 225,189.22 | - |
| 688060 | 云涌科技 | 2020 年 7 月 3 日 | 2021 年 1 月 11 日 | 新股锁定 | 44.47 | 81.69 | 2,400 | 106,728.00 | 196,056.00 | - |
| 688313 | 仕佳光子 | 2020 年 8 月 4 日 | 2021 年 2 月 18 日 | 新股锁定 | 10.82 | 22.92 | 7,151 | 77,373.82 | 163,900.92 | - |
| 300880 | 迦南智能 | 2020 年 8 月 25 日 | 2021 年 3 月 1 日 | 新股锁定 | 9.73 | 34.73 | 3,732 | 36,312.36 | 129,612.36 | - |
| 688577 | 浙海德曼 | 2020 年 9 月 8 日 | 2021 年 3 月 16 日 | 新股锁定 | 33.13 | 42.01 | 1,503 | 49,794.39 | 63,141.03 | - |
| 300860 | 锋尚文化 | 2020 年 8 月 6 日 | 2021 年 2 月 24 日 | 新股锁定 | 138.02 | 126.67 | 381 | 52,585.62 | 48,261.27 | - |
| 300861 | 美畅股份 | 2020 年 8 月 6 日 | 2021 年 2 月 24 | 新股锁定 | 43.76 | 51.10 | 895 | 39,165.20 | 45,734.50 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 日 | | | | | | | |
| 300919 | 中伟股份 | 2020 年 12 月 15 日 | 2021 年 6 月 23 日 | 新股锁定 | 24.60 | 61.51 | 610 | 15,006.00 | 37,521.10 | - |
| 300900 | 广联航空 | 2020 年 10 月 19 日 | 2021 年 4 月 29 日 | 新股锁定 | 17.87 | 33.16 | 879 | 15,707.73 | 29,147.64 | - |
| 300894 | 火星人 | 2020 年 12 月 24 日 | 2021 年 7 月 1 日 | 新股锁定 | 14.07 | 36.97 | 628 | 8,835.96 | 23,217.16 | - |
| 300910 | 瑞丰新材 | 2020 年 11 月 20 日 | 2021 年 5 月 27 日 | 新股锁定 | 30.26 | 47.87 | 474 | 14,343.24 | 22,690.38 | - |
| 300891 | 惠云钛业 | 2020 年 9 月 10 日 | 2021 年 3 月 17 日 | 新股锁定 | 3.64 | 16.40 | 1,143 | 4,160.52 | 18,745.20 | - |
| 300908 | 仲景食品 | 2020 年 11 月 13 日 | 2021 年 5 月 24 日 | 新股锁定 | 39.74 | 60.44 | 285 | 11,325.90 | 17,225.40 | - |
| 300898 | 熊猫乳品 | 2020 年 10 月 9 日 | 2021 年 4 月 16 日 | 新股锁定 | 10.78 | 33.03 | 496 | 5,346.88 | 16,382.88 | - |
| 300892 | 品渥食品 | 2020 年 9 月 11 日 | 2021 年 3 月 30 日 | 新股锁定 | 26.66 | 60.01 | 272 | 7,251.52 | 16,322.72 | - |
| 300909 | 汇创达 | 2020 年 11 月 11 日 | 2021 年 5 月 18 日 | 新股锁定 | 29.57 | 40.67 | 386 | 11,414.02 | 15,698.62 | - |
| 300887 | 谱尼测试 | 2020 年 9 月 9 日 | 2021 年 3 月 16 日 | 新股锁定 | 44.47 | 74.52 | 210 | 9,338.70 | 15,649.20 | - |
| 300913 | 兆龙互连 | 2020 年 11 月 27 日 | 2021 年 6 月 7 | 新股锁定 | 13.21 | 23.94 | 630 | 8,322.30 | 15,082.20 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 日 | | | | | | | |
| 300864 | 南大环境 | 2020 年 8 月 13 日 | 2021 年 2 月 25 日 | 新股锁定 | 71.71 | 90.85 | 166 | 11,903.86 | 15,081.10 | - |
| 300889 | 爱克股份 | 2020 年 9 月 9 日 | 2021 年 3 月 16 日 | 新股锁定 | 27.97 | 30.12 | 479 | 13,397.63 | 14,427.48 | - |
| 300890 | 翔丰华 | 2020 年 9 月 10 日 | 2021 年 3 月 18 日 | 新股锁定 | 14.69 | 48.85 | 286 | 4,201.34 | 13,971.10 | - |
| 300902 | 国安达 | 2020 年 10 月 22 日 | 2021 年 4 月 29 日 | 新股锁定 | 15.38 | 24.26 | 551 | 8,474.38 | 13,367.26 | - |
| 300925 | 法本信息 | 2020 年 12 月 21 日 | 2021 年 6 月 30 日 | 新股锁定 | 20.08 | 37.33 | 353 | 7,088.24 | 13,177.49 | - |
| 300895 | 铜牛信息 | 2020 年 9 月 17 日 | 2021 年 3 月 24 日 | 新股锁定 | 12.65 | 45.30 | 283 | 3,579.95 | 12,819.90 | - |
| 300876 | 蒙泰高新 | 2020 年 8 月 14 日 | 2021 年 2 月 25 日 | 新股锁定 | 20.09 | 36.62 | 350 | 7,031.50 | 12,817.00 | - |
| 300879 | 大叶股份 | 2020 年 8 月 25 日 | 2021 年 3 月 1 日 | 新股锁定 | 10.58 | 27.12 | 466 | 4,930.28 | 12,637.92 | - |
| 300882 | 万胜智能 | 2020 年 8 月 27 日 | 2021 年 3 月 10 日 | 新股锁定 | 10.33 | 25.79 | 440 | 4,545.20 | 11,347.60 | - |
| 300911 | 亿田智能 | 2020 年 11 月 24 日 | 2021 年 6 月 3 日 | 新股锁定 | 24.35 | 33.06 | 309 | 7,524.15 | 10,215.54 | - |
| 300893 | 松原股份 | 2020 年 9 月 17 日 | 2021 年 3 月 24 | 新股锁定 | 13.47 | 35.08 | 276 | 3,717.72 | 9,682.08 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 日 | | | | | | | |
| 300918 | 南山智尚 | 2020 年 12 月 15 日 | 2021 年 6 月 22 日 | 新股锁定 | 4.97 | 8.94 | 1,063 | 5,283.11 | 9,503.22 | - |
| 300881 | 盛德鑫泰 | 2020 年 8 月 25 日 | 2021 年 3 月 5 日 | 新股锁定 | 14.17 | 32.31 | 291 | 4,123.47 | 9,402.21 | - |
| 300922 | 天秦装备 | 2020 年 12 月 18 日 | 2021 年 6 月 25 日 | 新股锁定 | 16.05 | 31.58 | 287 | 4,606.35 | 9,063.46 | - |
| 300917 | 特发服务 | 2020 年 12 月 14 日 | 2021 年 6 月 21 日 | 新股锁定 | 18.78 | 31.94 | 281 | 5,277.18 | 8,975.14 | - |
| 300926 | 博俊科技 | 2020 年 12 月 29 日 | 2021 年 7 月 7 日 | 新股锁定 | 10.76 | 10.76 | 359 | 3,862.84 | 3,862.84 | - |
| 300886 | 华业香料 | 2020 年 9 月 8 日 | 2021 年 3 月 16 日 | 新股锁定 | 18.59 | 45.67 | 147 | 2,732.73 | 6,713.49 | - |

注：

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

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

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

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中风险收益特征的证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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，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。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2020 年 12 月 31 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(2019 年 12 月 31 日：同)。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允

价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 15,846,973.01 | - | - | - | 15,846,973.01 |
| 结算备付金 | 7,496,742.23 | - | - | - | 7,496,742.23 |
| 存出保证金 | 428,426.15 | - | - | - | 428,426.15 |
| 交易性金融资产 | 176,232,400.00 | - | - | 2,896,983,150.35 | 3,073,215,550.35 |
| 应收利息 | - | - | - | 4,166,661.07 | 4,166,661.07 |
| 应收申购款 | - | - | - | 2,768,348.93 | 2,768,348.93 |
| 资产总计 | 200,004,541.39 | - | - | 2,903,918,160.35 | 3,103,922,701.74 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 5,809,786.48 | 5,809,786.48 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 5,575,853.26 | 5,575,853.26 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 4,035,548.31 | 4,035,548.31 |
| 应付托管费 | - | - | - | 672,591.35 | 672,591.35 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 应付交易费用 | - | - | - | 2,468,798.74 | 2,468,798.74 |
| 应交税费 | - | - | - | 546,660.00 | 546,660.00 |
| 其他负债 | - | - | - | 260,469.44 | 260,469.44 |
| 负债总计 | - | - | - | 19,369,707.58 | 19,369,707.58 |
| 利率敏感度缺口 | 200,004,541.39 | - | - | 2,884,548,452.77 | 3,084,552,994.16 |
| 上年度末<br>2019 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 | 33,149,660.94 | - | - | - | 33,149,660.94 |
| 结算备付金 | 1,635,218.93 | - | - | - | 1,635,218.93 |
| 存出保证金 | 403,237.57 | - | - | - | 403,237.57 |
| 交易性金融资产 | 80,064,000.00 | - | - | 1,952,633,518.04 | 2,032,697,518.04 |
| 应收利息 | - | - | - | 2,066,711.32 | 2,066,711.32 |
| 应收申购款 | 1,982.16 | - | - | 829,470.59 | 831,452.75 |
| 资产总计 | 115,254,099.60 | - | - | 1,955,529,699.95 | 2,070,783,799.55 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 10,764.87 | 10,764.87 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 2,945,551.38 | 2,945,551.38 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 2,846,416.99 | 2,846,416.99 |
| 应付托管费 | - | - | - | 474,402.82 | 474,402.82 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,233,581.78 | 1,233,581.78 |
| 应交税费 | - | - | - | 546,660.00 | 546,660.00 |
| 其他负债 | - | - | - | 243,066.12 | 243,066.12 |
| 负债总计 | - | - | - | 8,300,443.96 | 8,300,443.96 |
| 利率敏感度缺口 | 115,254,099.60 | - | - | 1,947,229,255.99 | 2,062,483,355.59 |

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

### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.71%(2019 年 12 月 31 日：3.88%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种为基金资产的 5%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(ValueatRisk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2019 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 | 2,896,983,150.35 | 93.92 | 1,952,633,518.04 | 94.67 |
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－债券投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 2,896,983,150.35 | 93.92 | 1,952,633,518.04 | 94.67 |

### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元） | |
| | | 本期末（ 2020 年 12 月 31 日 ） | 上年度末（ 2019 年 12 月 31 日 ） |
| | 1. 业绩比较基准上升 5% | 增加约 16,965 | 增加约 11,137 |
| | 2. 业绩比较基准下降 5% | 减少约 16,965 | 减少约 11,137 |

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,891,557,107.18 元，属于第二层次的余额为 181,658,443.17 元，无属于第三层次的余额。(2019 年 12 月 31 日：第一层次 1,938,495,271.33 元，第二层次 94,202,246.71 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易

不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

# §8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 2,896,983,150.35 | 93.33 |
| | 其中：股票 | 2,896,983,150.35 | 93.33 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 176,232,400.00 | 5.68 |
| | 其中：债券 | 176,232,400.00 | 5.68 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 23,343,715.24 | 0.75 |
| 8 | 其他各项资产 | 7,363,436.15 | 0.24 |
| 9 | 合计 | 3,103,922,701.74 | 100.00 |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,099,373,118.02 | 68.06 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 16,322.72 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 124,168,676.10 | 4.03 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 45,076,346.80 | 1.46 |
| J | 金融业 | 556,361,000.00 | 18.04 |
| K | 房地产业 | 13,156,695.14 | 0.43 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 27,385,649.20 | 0.89 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 15,081.10 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 31,430,261.27 | 1.02 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,896,983,150.35 | 93.92 |

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

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未通过港股通交易机制投资港股。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601012 | 隆基股份 | 2,000,000 | 184,400,000.00 | 5.98 |
| 2 | 002648 | 卫星石化 | 5,992,400 | 156,521,488.00 | 5.07 |
| 3 | 002142 | 宁波银行 | 4,400,000 | 155,496,000.00 | 5.04 |
| 4 | 300059 | 东方财富 | 5,000,000 | 155,000,000.00 | 5.03 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 3,200,000 | 140,640,000.00 | 4.56 |
| 6 | 300760 | 迈瑞医疗 | 330,000 | 140,580,000.00 | 4.56 |
| 7 | 300003 | 乐普医疗 | 5,106,914 | 138,805,922.52 | 4.50 |
| 8 | 603899 | 晨光文具 | 1,500,000 | 132,840,000.00 | 4.31 |
| 9 | 300750 | 宁德时代 | 365,000 | 128,155,150.00 | 4.15 |
| 10 | 002271 | 东方雨虹 | 3,300,000 | 128,040,000.00 | 4.15 |
| 11 | 600298 | 安琪酵母 | 2,300,000 | 117,461,000.00 | 3.81 |
| 12 | 000338 | 潍柴动力 | 6,947,701 | 109,704,198.79 | 3.56 |
| 13 | 603868 | 飞科电器 | 2,318,612 | 108,464,669.36 | 3.52 |
| 14 | 002352 | 顺丰控股 | 1,150,070 | 101,470,676.10 | 3.29 |
| 15 | 600201 | 生物股份 | 4,800,000 | 100,272,000.00 | 3.25 |
| 16 | 601966 | 玲珑轮胎 | 2,600,097 | 91,445,411.49 | 2.96 |
| 17 | 600887 | 伊利股份 | 2,000,000 | 88,740,000.00 | 2.88 |
| 18 | 000403 | 双林生物 | 2,300,000 | 87,400,000.00 | 2.83 |
| 19 | 601166 | 兴业银行 | 4,000,000 | 83,480,000.00 | 2.71 |
| 20 | 603288 | 海天味业 | 400,000 | 80,216,000.00 | 2.60 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 21 | 002254 | 泰和新材 | 5,157,095 | 78,773,136.65 | 2.55 |
| 22 | 002043 | 兔 宝 宝 | 8,052,500 | 72,230,925.00 | 2.34 |
| 23 | 000333 | 美的集团 | 500,000 | 49,220,000.00 | 1.60 |
| 24 | 688018 | 乐鑫科技 | 301,659 | 44,835,577.17 | 1.45 |
| 25 | 600690 | 海尔智家 | 1,500,000 | 43,815,000.00 | 1.42 |
| 26 | 300251 | 光线传媒 | 2,600,000 | 31,382,000.00 | 1.02 |
| 27 | 300012 | 华测检测 | 1,000,000 | 27,370,000.00 | 0.89 |
| 28 | 603833 | 欧派家居 | 200,000 | 26,900,000.00 | 0.87 |
| 29 | 600009 | 上海机场 | 300,000 | 22,698,000.00 | 0.74 |
| 30 | 601318 | 中国平安 | 250,000 | 21,745,000.00 | 0.70 |
| 31 | 600823 | 世茂股份 | 2,852,000 | 13,147,720.00 | 0.43 |
| 32 | 600276 | 恒瑞医药 | 100,000 | 11,146,000.00 | 0.36 |
| 33 | 300529 | 健帆生物 | 150,000 | 10,173,000.00 | 0.33 |
| 34 | 600519 | 贵州茅台 | 5,000 | 9,990,000.00 | 0.32 |
| 35 | 300999 | 金龙鱼 | 10,448 | 922,453.92 | 0.03 |
| 36 | 688339 | 亿华通 | 2,761 | 712,199.95 | 0.02 |
| 37 | 688301 | 奕瑞科技 | 2,427 | 394,921.44 | 0.01 |
| 38 | 300894 | 火星人 | 6,279 | 300,116.16 | 0.01 |
| 39 | 300896 | 爱美客 | 473 | 285,389.28 | 0.01 |
| 40 | 603195 | 公牛集团 | 1,359 | 278,989.11 | 0.01 |
| 41 | 300862 | 蓝盾光电 | 5,843 | 225,189.22 | 0.01 |
| 42 | 688060 | 云涌科技 | 2,400 | 196,056.00 | 0.01 |
| 43 | 688313 | 仕佳光子 | 7,151 | 163,900.92 | 0.01 |
| 44 | 300880 | 迦南智能 | 3,732 | 129,612.36 | 0.00 |
| 45 | 688617 | 惠泰医疗 | 1,673 | 124,571.58 | 0.00 |
| 46 | 688577 | 浙海德曼 | 1,503 | 63,141.03 | 0.00 |
| 47 | 300860 | 锋尚文化 | 381 | 48,261.27 | 0.00 |
| 48 | 300861 | 美畅股份 | 895 | 45,734.50 | 0.00 |
| 49 | 300926 | 博俊科技 | 3,584 | 38,563.84 | 0.00 |
| 50 | 300919 | 中伟股份 | 610 | 37,521.10 | 0.00 |
| 51 | 300900 | 广联航空 | 879 | 29,147.64 | 0.00 |
| 52 | 300910 | 瑞丰新材 | 474 | 22,690.38 | 0.00 |
| 53 | 003026 | 中晶科技 | 461 | 21,740.76 | 0.00 |
| 54 | 300891 | 惠云钛业 | 1,143 | 18,745.20 | 0.00 |
| 55 | 003029 | 吉大正元 | 716 | 18,716.24 | 0.00 |
| 56 | 003028 | 振邦智能 | 432 | 18,010.08 | 0.00 |
| 57 | 300908 | 仲景食品 | 285 | 17,225.40 | 0.00 |
| 58 | 605179 | 一鸣食品 | 939 | 16,582.74 | 0.00 |
| 59 | 300898 | 熊猫乳品 | 496 | 16,382.88 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 60 | 300892 | 品渥食品 | 272 | 16,322.72 | 0.00 |
| 61 | 300909 | 汇创达 | 386 | 15,698.62 | 0.00 |
| 62 | 300887 | 谱尼测试 | 210 | 15,649.20 | 0.00 |
| 63 | 300913 | 兆龙互连 | 630 | 15,082.20 | 0.00 |
| 64 | 300864 | 南大环境 | 166 | 15,081.10 | 0.00 |
| 65 | 300889 | 爱克股份 | 479 | 14,427.48 | 0.00 |
| 66 | 300890 | 翔丰华 | 286 | 13,971.10 | 0.00 |
| 67 | 300902 | 国安达 | 551 | 13,367.26 | 0.00 |
| 68 | 300925 | 法本信息 | 353 | 13,177.49 | 0.00 |
| 69 | 300895 | 铜牛信息 | 283 | 12,819.90 | 0.00 |
| 70 | 300876 | 蒙泰高新 | 350 | 12,817.00 | 0.00 |
| 71 | 300879 | 大叶股份 | 466 | 12,637.92 | 0.00 |
| 72 | 300882 | 万胜智能 | 440 | 11,347.60 | 0.00 |
| 73 | 605155 | 西大门 | 350 | 10,668.00 | 0.00 |
| 74 | 300911 | 亿田智能 | 309 | 10,215.54 | 0.00 |
| 75 | 300893 | 松原股份 | 276 | 9,682.08 | 0.00 |
| 76 | 300918 | 南山智尚 | 1,063 | 9,503.22 | 0.00 |
| 77 | 300881 | 盛德鑫泰 | 291 | 9,402.21 | 0.00 |
| 78 | 300922 | 天秦装备 | 287 | 9,063.46 | 0.00 |
| 79 | 300917 | 特发服务 | 281 | 8,975.14 | 0.00 |
| 80 | 605277 | 新亚电子 | 507 | 8,593.65 | 0.00 |
| 81 | 003030 | 祖名股份 | 480 | 7,286.40 | 0.00 |
| 82 | 300886 | 华业香料 | 147 | 6,713.49 | 0.00 |
| 83 | 003031 | 中瓷电子 | 387 | 5,909.49 | 0.00 |

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

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 166,031,932.95 | 8.05 |
| 2 | 000338 | 潍柴动力 | 157,093,071.53 | 7.62 |
| 3 | 002648 | 卫星石化 | 155,842,491.38 | 7.56 |
| 4 | 300003 | 乐普医疗 | 135,157,517.70 | 6.55 |
| 5 | 600887 | 伊利股份 | 123,020,802.40 | 5.96 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 6 | 600298 | 安琪酵母 | 119,375,088.30 | 5.79 |
| 7 | 603868 | 飞科电器 | 114,186,772.11 | 5.54 |
| 8 | 600585 | 海螺水泥 | 109,806,961.60 | 5.32 |
| 9 | 300750 | 宁德时代 | 107,753,706.62 | 5.22 |
| 10 | 601012 | 隆基股份 | 104,583,991.29 | 5.07 |
| 11 | 002352 | 顺丰控股 | 103,112,807.74 | 5.00 |
| 12 | 601166 | 兴业银行 | 87,403,666.90 | 4.24 |
| 13 | 002254 | 泰和新材 | 86,948,447.69 | 4.22 |
| 14 | 000403 | 双林生物 | 86,434,073.01 | 4.19 |
| 15 | 600009 | 上海机场 | 84,849,878.68 | 4.11 |
| 16 | 300760 | 迈瑞医疗 | 84,390,062.24 | 4.09 |
| 17 | 600201 | 生物股份 | 82,418,031.16 | 4.00 |
| 18 | 600048 | 保利地产 | 81,820,441.45 | 3.97 |
| 19 | 600519 | 贵州茅台 | 80,066,522.14 | 3.88 |
| 20 | 300059 | 东方财富 | 78,329,002.35 | 3.80 |
| 21 | 002043 | 兔 宝 宝 | 78,283,679.00 | 3.80 |
| 22 | 002142 | 宁波银行 | 76,315,787.40 | 3.70 |
| 23 | 603288 | 海天味业 | 67,481,103.68 | 3.27 |
| 24 | 000333 | 美的集团 | 57,557,059.96 | 2.79 |
| 25 | 300012 | 华测检测 | 55,041,714.00 | 2.67 |
| 26 | 002271 | 东方雨虹 | 52,973,526.16 | 2.57 |
| 27 | 688018 | 乐鑫科技 | 52,280,634.19 | 2.53 |
| 28 | 600036 | 招商银行 | 50,412,254.01 | 2.44 |
| 29 | 600690 | 海尔智家 | 47,587,136.38 | 2.31 |
| 30 | 601966 | 玲珑轮胎 | 43,308,315.03 | 2.10 |
| 31 | 603899 | 晨光文具 | 42,461,745.00 | 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。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601012 | 隆基股份 | 219,695,098.50 | 10.65 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 170,632,435.05 | 8.27 |
| 3 | 600298 | 安琪酵母 | 142,385,512.76 | 6.90 |
| 4 | 300059 | 东方财富 | 139,695,786.31 | 6.77 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 5 | 600585 | 海螺水泥 | 125,776,999.90 | 6.10 |
| 6 | 002271 | 东方雨虹 | 125,311,946.12 | 6.08 |
| 7 | 600009 | 上海机场 | 118,238,923.82 | 5.73 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 111,579,032.36 | 5.41 |
| 9 | 300529 | 健帆生物 | 105,956,653.82 | 5.14 |
| 10 | 300750 | 宁德时代 | 101,079,043.10 | 4.90 |
| 11 | 603899 | 晨光文具 | 93,080,223.26 | 4.51 |
| 12 | 300003 | 乐普医疗 | 92,297,189.85 | 4.48 |
| 13 | 601966 | 玲珑轮胎 | 87,772,559.53 | 4.26 |
| 14 | 600887 | 伊利股份 | 83,982,027.58 | 4.07 |
| 15 | 600030 | 中信证券 | 83,649,746.51 | 4.06 |
| 16 | 000977 | 浪潮信息 | 81,427,194.16 | 3.95 |
| 17 | 300251 | 光线传媒 | 77,015,616.78 | 3.73 |
| 18 | 300760 | 迈瑞医疗 | 76,408,946.96 | 3.70 |
| 19 | 600048 | 保利地产 | 76,164,018.72 | 3.69 |
| 20 | 600201 | 生物股份 | 68,710,866.06 | 3.33 |
| 21 | 002142 | 宁波银行 | 65,324,017.57 | 3.17 |
| 22 | 002304 | 洋河股份 | 53,952,589.94 | 2.62 |
| 23 | 600036 | 招商银行 | 47,800,519.92 | 2.32 |
| 24 | 000338 | 潍柴动力 | 47,364,064.33 | 2.30 |
| 25 | 002044 | 美年健康 | 46,818,170.95 | 2.27 |
| 26 | 000651 | 格力电器 | 46,237,478.99 | 2.24 |
| 27 | 300012 | 华测检测 | 46,121,989.20 | 2.24 |

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

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 3,107,781,600.12 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,263,892,278.88 |

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

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|

| | | | |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 125,987,400.00 | 4.08 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 50,245,000.00 | 1.63 |
| | 其中：政策性金融债 | 50,245,000.00 | 1.63 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 176,232,400.00 | 5.71 |

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 019627 | 20 国债 01 | 1,260,000 | 125,987,400.00 | 4.08 |
| 2 | 180208 | 18 国开 08 | 500,000 | 50,245,000.00 | 1.63 |

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金本期投资的前十名证券中，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、处罚的证券如下：

浙江卫星石化股份有限公司（以下简称“卫星石化”）于 2020 年 11 月 26 日受到深圳证券交易所（以下简称“交易所”）通报批评处分，主要违规事实公告如下：一、船舶期租协议未履行审议程序且未及时对外披露；二、造船承接协议未履行审议程序且未及时对外披露；鉴于上述违规事实及情节，依据交易所《股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 17.2 条、第 17.3 条、第 17.4 条和交易所《上市公司纪律处分实施标准（试行）》第十六条的规定，经交易所纪律处分委员会审议通过，交易所作出如下处分决定：一、对浙江卫星石化股份有限公司给予通报批评的处分。二、对浙江卫星石化股份有限公司董事长兼总裁杨卫东、董事会秘书沈晓炜给予通报批评的处分。对于浙江卫星石化股份有限公司及相关当事人的上述违规行为及本所给予的处分，交易所将记入上市公司诚信档案，并向社会公开。

本基金对卫星石化投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件不改变长期投资价值。同时由于本基金看好卫星石化长期发展，因此买入。本基金管理人对该股的投资决策遵循公司的投资决策制度。

### 8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 428,426.15 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,166,661.07 |
| 5 | 应收申购款 | 2,768,348.93 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,363,436.15 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

# §9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 国富潜力组合混合A-人民币 | 45,816 | 41,072.10 | 851,369,092.97 | 45.24% | 1,030,390,178.55 | 54.76% |
| 国富潜力组合混合H-人民币 | 3 | 1,283,558.25 | 3,850,674.75 | 100.00% | - | - |
| 合计 | 45,819 | 41,153.45 | 855,219,767.72 | 45.36% | 1,030,390,178.55 | 54.64% |

## 9.2 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 | 国富潜力组合混合A-人民币 | 445,819.02 | 0.023692% |
| | 国富潜力组合混合H-人民币 | - | - |
| | 合计 | 445,819.02 | 0.023643% |

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 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 | 国富潜力组合混合A-人民币 | 10~50 |
| | 国富潜力组合混合H-人民币 | 0 |
| | 合计 | 10~50 |

| | | |
|---|---|---|
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 国富潜力组合混合 A-人民币 | 0 |
| | 国富潜力组合混合 H-人民币 | 0 |
| | 合计 | 0 |

# §10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 国富潜力组合混合 A-人民币 | 国富潜力组合混合 H-人民币 |
| --- | --- | --- |
| 基金合同生效日（2007 年 3 月 22 日）基金份额总额 | 8,756,866,710.48 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,696,492,365.01 | 2,063,264.47 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,029,068,408.79 | 3,978,455.72 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 843,801,502.28 | 2,191,045.44 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,881,759,271.52 | 3,850,674.75 |

# §11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（一）基金管理人重大人事变动

1、经国海富兰克林基金管理有限公司第五届董事会第二十二次会议审议通过，自 2020 年 6 月 19 日起，首席信息官丁磊先生担任公司高级管理人员。相关公告已于 2020 年 6 月 20 日在《证券时报》和公司网站披露。

2、经国海富兰克林基金管理有限公司第五届董事会第二十二次会议审议通过，自 2020 年 7 月 22 日起，财务总监李赛兰女士担任公司高级管理人员。相关公告已于 2020 年 7 月 23 日在《中国证券报》和公司网站披露。

（二）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人应支付给会计师事务所的审计费用是人民币 120,000.00 元，本基金自成立以来对其进行审计的均为普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

（一）基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

（二）基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东方证券 | 2 | 996,028,552.88 | 15.80% | 927,602.49 | 16.09% | - |
| 国信证券 | 1 | 793,050,103.18 | 12.58% | 738,565.34 | 12.81% | - |
| 华创证券 | 1 | 618,353,488.20 | 9.81% | 575,873.89 | 9.99% | - |
| 兴业证券 | 1 | 583,155,185.18 | 9.25% | 543,093.46 | 9.42% | - |
| 太平洋证券 | 1 | 455,790,436.08 | 7.23% | 333,319.51 | 5.78% | - |
| 海通证券 | 2 | 450,577,734.86 | 7.15% | 419,623.10 | 7.28% | - |
| 东吴证券 | 2 | 447,394,434.97 | 7.10% | 416,659.75 | 7.23% | - |
| 中信证券 | 1 | 415,231,014.71 | 6.59% | 386,704.03 | 6.71% | - |
| 长江证券 | 2 | 407,213,209.14 | 6.46% | 379,237.48 | 6.58% | - |
| 光大证券 | 2 | 336,336,842.98 | 5.33% | 313,230.21 | 5.43% | - |
| 瑞银证券 | 1 | 208,545,454.81 | 3.31% | 194,219.80 | 3.37% | - |
| 招商证券 | 1 | 160,223,102.60 | 2.54% | 149,216.41 | 2.59% | - |
| 银河证券 | 1 | 140,316,625.78 | 2.23% | 130,676.86 | 2.27% | - |
| 申万宏源 | 2 | 117,469,240.45 | 1.86% | 109,399.74 | 1.90% | - |
| 华泰证券 | 1 | 98,704,966.74 | 1.57% | 91,924.14 | 1.59% | - |
| 方正证券 | 2 | 77,226,425.75 | 1.22% | 56,476.03 | 0.98% | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |

注：管理人对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其他相关因素后决定的。报告期内，本基金退租东北证券上海及深圳交易单元各 1 个。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 23,884,104.40 | 16.88% | - | - | - | - |
| 华创证券 | 9,929,852.83 | 7.02% | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1,734,597.68 | 1.23% | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 42,977,500.00 | 30.37% | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 35,966,990.40 | 25.42% | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 27,013,833.00 | 19.09% | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |

## 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 国海富兰克林基金旗下部分基金参加农业银行开放式证券投资基金申购、定投费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 1 月 4 日 |
| 2 | 关于增加北京创金启富基金销售有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 1 月 17 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 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 | | |
| 3 | 富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 1 月 17 日 |
| 4 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 1 月 17 日 |
| 5 | 国海富兰克林基金管理有限公司关于做好新型冠状病毒感染的肺炎疫情防控工作的提示性公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 2 月 3 日 |
| 6 | 公司旗下基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订法律文件的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 2 月 28 日 |
| 7 | 国海富兰克林基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下 32 只公募基金法律文件的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 2 月 28 日 |
| 8 | 富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金基金合同 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 2 月 28 日 |
| 9 | 富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金托管协议 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 2 月 28 日 |
| 10 | 富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金更新招募说明书 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 2 月 28 日 |
| 11 | 富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金更新招募说明书摘要 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 2 月 28 日 |
| 12 | 富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金 2019 年年报及摘要 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 3 月 27 日 |
| 13 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 3 月 27 日 |
| 14 | 国海富兰克林基金管理有限公司关于中止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 4 月 7 日 |
| 15 | 富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2020 年 2 号） | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 4 月 20 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 16 | 富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金更新招募说明书（2020 年 2 号） | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 4 月 20 日 |
| 17 | 国海富兰克林基金管理有限公司关于提请投资者及时更新客户身份基本信息的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 4 月 20 日 |
| 18 | 公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 4 月 21 日 |
| 19 | 国海富兰克林基金管理有限公司 2020 年第一季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 4 月 21 日 |
| 20 | 国海富兰克林基金管理有限公司关于提醒直销个人投资者完善身份信息的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 4 月 30 日 |
| 21 | 国海富兰克林基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 6 月 4 日 |
| 22 | 国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 6 月 20 日 |
| 23 | 关于增加大连网金基金销售有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 6 月 22 日 |
| 24 | 关于增加华安证券股份有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 6 月 22 日 |
| 25 | 关于增加阳光人寿保险股份有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 6 月 22 日 |
| 26 | 国海富兰克林基金管理有限公司关于终止上海景谷基金销售有限公司办理相关销售业务的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 7 月 2 日 |
| 27 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加交通银行手机银行基金申购 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 7 月 3 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | | |
| 28 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加申万宏源西部证券有限公司申购费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 7 月 17 日 |
| 29 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加申万宏源证券有限公司申购费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 7 月 17 日 |
| 30 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 7 月 20 日 |
| 31 | 关于网上交易平台和微信服务号关闭非身份证开户端口的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 7 月 22 日 |
| 32 | 国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 7 月 23 日 |
| 33 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加渤海银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 7 月 28 日 |
| 34 | 关于增加喜鹊财富基金销售有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 8 月 19 日 |
| 35 | 关于增加中信证券华南股份有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 8 月 24 日 |
| 36 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金中期报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 8 月 28 日 |
| 37 | 国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下基金披露基金产品资料概要（更新）的提示性公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 8 月 31 日 |
| 38 | 关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为国海富兰克 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 9 月 17 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告 | | |
| 39 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中国银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 9 月 17 日 |
| 40 | 关于增加中国人寿保险股份有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 9 月 24 日 |
| 41 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加上海证券有限责任公司申购及定投费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 10 月 19 日 |
| 42 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加招商银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 10 月 27 日 |
| 43 | 关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 11 月 5 日 |
| 44 | 富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 11 月 13 日 |
| 45 | 关于增加玄元保险代理有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 11 月 20 日 |
| 46 | 关于增加腾安基金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 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 11 月 23 日 |
| 47 | 关于在招商银行招赢通平台开通公司旗下部分基金销售业务并参加其费率优惠活动 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 11 月 26 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 的公告 | | |
| 48 | 关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 12 月 9 日 |
| 49 | 富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金分红公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 12 月 15 日 |
| 50 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 12 月 15 日 |
| 51 | 富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金恢复大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 12 月 18 日 |
| 52 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加交通银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 12 月 31 日 |
| 53 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加苏州银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 12 月 31 日 |
| 54 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加中国工商银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及指定网站 | 2020 年 12 月 31 日 |

# §12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、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或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

# §13 备查文件目录

## 13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金设立的文件；

2、《富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金基金合同》；

3、《富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金托管协议》；

5、中国证监会要求的其他文件。

## 13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站 ：www.ftsfund.com。

## 13.3 查阅方式

1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件；

2、登陆基金管理人网站 www.ftsfund.com 查阅。

# §14 补充披露

补充披露 1：期末基金资产组合情况

| 名称 | 数量（股） | 公允价值（人民币元） |
|---|---|---|
| （1）股票投资 | | |
| 上市投资 | | |
| 中国（100%） | | |
| 隆基股份 | 2,000,000 | 184,400,000.00 |
| 卫星石化 | 5,992,400 | 156,521,488.00 |
| 宁波银行 | 4,400,000 | 155,496,000.00 |
| 东方财富 | 5,000,000 | 155,000,000.00 |
| 招商银行 | 3,200,000 | 140,640,000.00 |
| 迈瑞医疗 | 330,000 | 140,580,000.00 |
| 乐普医疗 | 5,106,914 | 138,805,922.52 |
| 晨光文具 | 1,500,000 | 132,840,000.00 |
| 宁德时代 | 365,000 | 128,155,150.00 |
| 东方雨虹 | 3,300,000 | 128,040,000.00 |
| 安琪酵母 | 2,300,000 | 117,461,000.00 |
| 潍柴动力 | 6,947,701 | 109,704,198.79 |
| 飞科电器 | 2,318,612 | 108,464,669.36 |
| 顺丰控股 | 1,150,070 | 101,470,676.10 |
| 生物股份 | 4,800,000 | 100,272,000.00 |
| 玲珑轮胎 | 2,600,097 | 91,445,411.49 |
| 伊利股份 | 2,000,000 | 88,740,000.00 |
| 双林生物 | 2,300,000 | 87,400,000.00 |
| 兴业银行 | 4,000,000 | 83,480,000.00 |
| 海天味业 | 400,000 | 80,216,000.00 |
| 泰和新材 | 5,044,458 | 77,129,762.82 |
| 兔 宝 宝 | 8,052,500 | 72,230,925.00 |
| 美的集团 | 500,000 | 49,220,000.00 |
| 乐鑫科技 | 301,659 | 44,835,577.17 |
| 海尔智家 | 1,500,000 | 43,815,000.00 |
| 光线传媒 | 2,600,000 | 31,382,000.00 |
| 华测检测 | 1,000,000 | 27,370,000.00 |
| 欧派家居 | 200,000 | 26,900,000.00 |
| 上海机场 | 300,000 | 22,698,000.00 |
| 中国平安 | 250,000 | 21,745,000.00 |
| 世茂股份 | 2,852,000 | 13,147,720.00 |
| 恒瑞医药 | 100,000 | 11,146,000.00 |
| 健帆生物 | 150,000 | 10,173,000.00 |
| 贵州茅台 | 5,000 | 9,990,000.00 |
| 泰和新材 | 112,637 | 1,643,373.83 |
| 金龙鱼 | 10,448 | 922,453.92 |

| | | |
|---|---|---|
| 亿华通 | 2,761 | 712,199.95 |
| 奕瑞科技 | 2,427 | 394,921.44 |
| 爱美客 | 473 | 285,389.28 |
| 公牛集团 | 1,359 | 278,989.11 |
| 火星人 | 5,651 | 276,899.00 |
| 蓝盾光电 | 5,843 | 225,189.22 |
| 云涌科技 | 2,400 | 196,056.00 |
| 仕佳光子 | 7,151 | 163,900.92 |
| 迦南智能 | 3,732 | 129,612.36 |
| 惠泰医疗 | 1,673 | 124,571.58 |
| 浙海德曼 | 1,503 | 63,141.03 |
| 锋尚文化 | 381 | 48,261.27 |
| 美畅股份 | 895 | 45,734.50 |
| 博俊科技 | 3,584 | 38,563.84 |
| 中伟股份 | 610 | 37,521.10 |
| 广联航空 | 879 | 29,147.64 |
| 火星人 | 628 | 23,217.16 |
| 瑞丰新材 | 474 | 22,690.38 |
| 中晶科技 | 461 | 21,740.76 |
| 惠云钛业 | 1,143 | 18,745.20 |
| 吉大正元 | 716 | 18,716.24 |
| 振邦智能 | 432 | 18,010.08 |
| 仲景食品 | 285 | 17,225.40 |
| 一鸣食品 | 939 | 16,582.74 |
| 熊猫乳品 | 496 | 16,382.88 |
| 品渥食品 | 272 | 16,322.72 |
| 汇创达 | 386 | 15,698.62 |
| 谱尼测试 | 210 | 15,649.20 |
| 兆龙互连 | 630 | 15,082.20 |
| 南大环境 | 166 | 15,081.10 |
| 爱克股份 | 479 | 14,427.48 |
| 翔丰华 | 286 | 13,971.10 |
| 国安达 | 551 | 13,367.26 |
| 法本信息 | 353 | 13,177.49 |
| 铜牛信息 | 283 | 12,819.90 |
| 蒙泰高新 | 350 | 12,817.00 |
| 大叶股份 | 466 | 12,637.92 |
| 万胜智能 | 440 | 11,347.60 |
| 西大门 | 350 | 10,668.00 |
| 亿田智能 | 309 | 10,215.54 |
| 松原股份 | 276 | 9,682.08 |
| 南山智尚 | 1,063 | 9,503.22 |
| 盛德鑫泰 | 291 | 9,402.21 |

| | | |
|---|---|---|
| 天秦装备 | 287 | 9,063.46 |
| 特发服务 | 281 | 8,975.14 |
| 新亚电子 | 507 | 8,593.65 |
| 祖名股份 | 480 | 7,286.40 |
| 华业香料 | 147 | 6,713.49 |
| 中瓷电子 | 387 | 5,909.49 |
| 合计 | - | 2,896,983,150.35 |
| （2）债券投资 | | |
| 上市投资 | | |
| 中国（100%） | | |
| 20 国债 01 | 1,260,000 | 125,987,400.00 |
| 18 国开 08 | 500,000 | 50,245,000.00 |
| 合计 | - | 176,232,400.00 |
| | | |
| 总投资资产 | | 3,073,215,550.35 |
| 银行存款和结算备付金合计 | | 23,343,715.24 |
| 其他各项资产 | | 7,363,436.15 |
| 合计 | | 3,103,922,701.74 |

补充披露 2：投资组合变动表

| 序号 | 证券类别 | 占基金总资产的比例（%）2020 年 12 月31 日 | 占基金总资产的比例（%）2019年 12月 31 日 |
|---|---|---|---|
| 1 | 股票 | 93.33 | 94.29 |
| 2 | 债券 | 5.68 | 3.87 |

**国海富兰克林基金管理有限公司**

**2021 年 3 月 31 日**