

富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 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	53

7.7 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	53
7.8 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	53
7.9 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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金	
基金简称	国富深化价值混合	
基金主代码	450004	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 7 月 3 日	
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,902,915,382.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国富深化价值混合 A	国富深化价值混合 C
下属分级基金的交易代码	450004	017426
报告期末下属分级基金的份额总额	2,874,927,172.11 份	27,988,209.94 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国海富兰克林基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 姓名	储丽莉	秦一楠

负责人	联系电话	021-3855 5555	010-6606 0069
	电子邮箱	service@ftsfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555	95599
传真		021-6888 3050	010-6812 1816
注册地址		广西南宁市西乡塘区总部路 1 号 中国-东盟科技企业孵化基地一期 A-13 栋三层 306 号房	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 9 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		吴显玲	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	国富深化价值混合 A	国富深化价值混合 C
本期已实现收益	-156,059,703.09	-1,086,391.27
本期利润	87,024,714.02	-1,638,970.31
加权平均基金份额本期利润	0.0273	-0.0932
本期加权平均净值利润率	1.53%	-5.24%
本期基金份额净值增长率	0.32%	0.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	2,043,748,235.92	19,799,014.63
期末可供分配基金份额利润	0.7109	0.7074
期末基金资产净值	5,016,859,712.39	48,742,798.85
期末基金份额净值	1.7450	1.7415
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	261.66%	-2.74%

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

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

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

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

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

国富深化价值混合 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
过去一个月	2.86%	0.97%	1.04%	0.74%	1.82%	0.23%
过去三个月	-1.83%	0.85%	-4.20%	0.70%	2.37%	0.15%
过去六个月	0.32%	0.83%	-0.40%	0.71%	0.72%	0.12%
过去一年	-15.58%	0.96%	-11.95%	0.84%	-3.63%	0.12%
过去三年	38.46%	1.21%	-5.57%	1.02%	44.03%	0.19%
自基金合同生效起至今	261.66%	1.64%	45.56%	1.31%	216.10%	0.33%

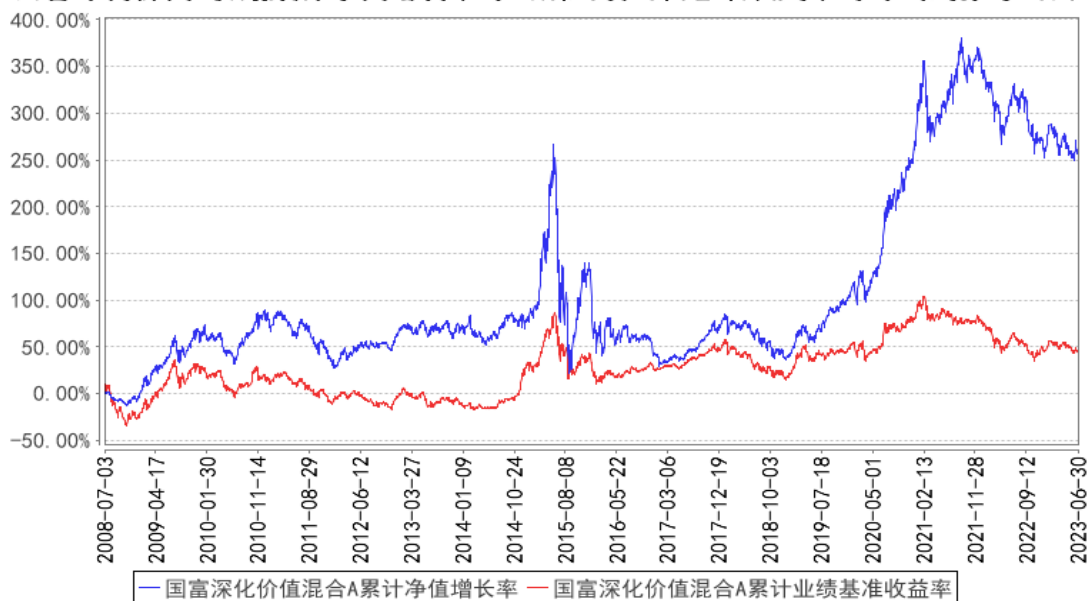
国富深化价值混合 C

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

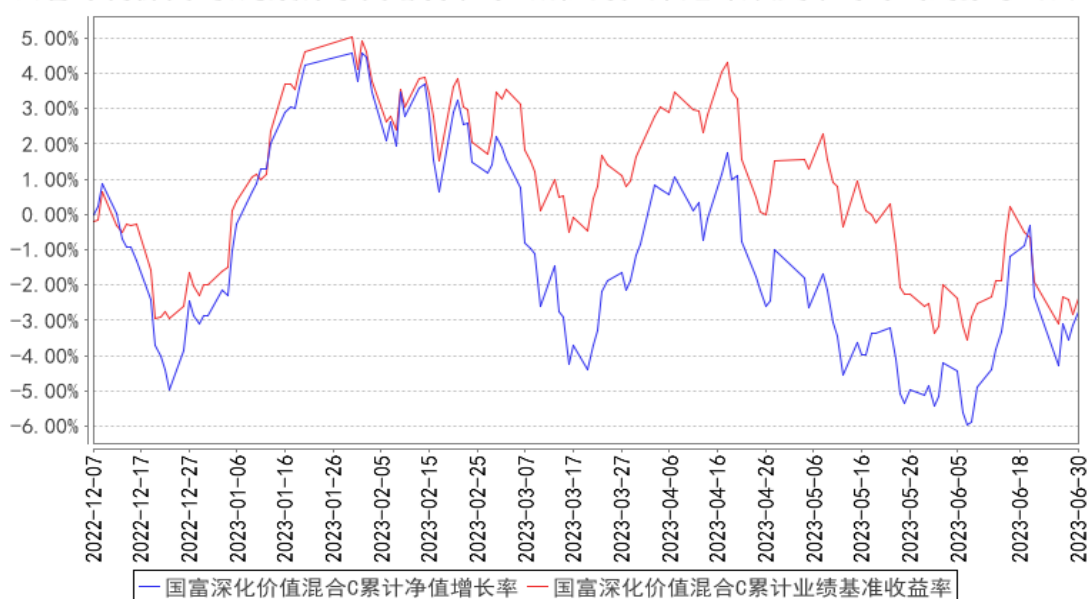
	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	2.83%	0.97%	1.04%	0.74%	1.79%	0.23%
过去三个月	-1.93%	0.85%	-4.20%	0.70%	2.27%	0.15%
过去六个月	0.12%	0.83%	-0.40%	0.71%	0.52%	0.12%
自增设 C 类份额至今	-2.74%	0.82%	-2.37%	0.70%	-0.37%	0.12%

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

国富深化价值混合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



国富深化价值混合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 2008 年 7 月 3 日，并于 2022 年 12 月 7 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投资集团全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建，国海证券股份有限公司持有 51% 的股份，邓普顿国际股份有限公司持有 49% 的股份。目前公司注册资本 2.2 亿元人民币。

国海证券股份有限公司是国内 A 股市场第 16 家上市券商，是拥有全业务牌照，营业网点遍布中国主要城市的全国性综合类证券公司。富兰克林邓普顿投资集团是世界知名基金管理公司，在全球市场具备超过 75 年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿投资集团享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系，借助国海证券股份有限公司的综合业务优势，力争成为国内一流的基金管理公司。

国海富兰克林基金管理有限公司具有丰富的基金管理经验，截至 2023 年 6 月 30 日，公司旗下合计管理 42 只公募基金产品。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘晓	国富深化价值混合基金、国富新机遇混合基金、国富天颐混合基金、国富焦点驱动混合基金、国富匠心精选混合基金、国富鑫享价值混合基金及国富均衡增长混	2017 年 2 月 18 日	-	16 年	刘晓女士，上海财经大学金融学硕士。历任国海富兰克林基金管理有限公司研究助理、研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理兼研究员。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富深化价值混合基金、国富新机遇混合基金、国富天颐混合基金、国富焦点驱动混合基金、国富匠心精选混合基金、国富鑫享价值混合基金及国富均衡增长混合基金的基金经理。

	合基金的 基金经理				
--	--------------	--	--	--	--

注：

1. 表中“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，其中，首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。
2. 表中“证券从业年限”的计算标准为该名员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

整个上半年市场波动较大，行业分化严重，A 股市场沪深 300 指数下跌 0.75%，而创业板指下跌 5.61%。行业方面，通信、传媒和计算机大幅上涨，而商贸、地产、食品饮料和建筑材料跌幅较大。

回顾上半年，一季度宏观经济逐步走出新冠疫情后经历了一轮相对陡峭的复苏过程。市场对于全年的经济增长抱有较高的预期，引发一轮经济复苏的抢跑行情。二季度国内经济整体进入温和复苏的进程中，环比增速比较平缓，与市场先前对经济复苏的速度和节奏预期有一定差异。市场经历了对于一季度过于乐观的预期的修正，出现调整。很多传统行业及公司从短期业绩层面来

看弹性不大，投资亮点较少，难有超预期的情况发生。市场关注点集中在增长确定性较强且估值偏低、股息率较高的板块以及受益 AI 技术进步影响较大的板块。尤其是 AI 相关板块备受关注，市场表现出了极高的研究热情和参与度。中远期看，AI 技术的应用对于大部分生产领域的效率提升都可能产生深远的影响，而短期 AI 产业的机会或主要体现在大模型的研发训练和由此带动的算力方面的投入以及部分行业出现的相关应用的落地。海外方面，美国通胀率持续高企，地产、就业数据好于预期使得加息周期结束的预期时间推迟，另外，市场对于汇率波动、外资流动等比较担忧。

报告期内，本基金一直维持中性偏乐观的权益仓位。目前组合中，电子、电气设备新能源、家电、机械、通讯、银行等配置相对较多，总体在行业和风格配置上保持均衡，继续自下而上的深入研究挖掘个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.7450 元，本报告期份额净值上涨 0.32%，同期业绩比较基准下跌 0.40%，跑赢业绩比较基准 0.72%。本基金 C 类份额净值为 1.7415 元，本报告期份额净值上涨 0.12%，同期业绩比较基准下跌 0.40%，跑赢业绩比较基准 0.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济增长预期仍然是影响 A 股市场最重要的变量之一。国内流动性处于较为宽松状态，国内居民资产配置力量渐显。从全球流动性角度看，美联储加息有望接近尾声。海外流动性、国内微观资金面边际改善可期。

中长期看全球经济复苏趋势确定性仍强，中国经济韧性较强，且有望在稳定增长的努力下实现经济结构的优化，并在科技发展中保持较为领先的态势。流动性上看，流动性适度或宽松的状态或将长期持续。而从市场参与者结构看，我国居民资产配置中长期有望持续向权益转移，机构化和外资比例的继续提升，对 A 股市场也形成实质性的长期利好。继续看好中国制造业的竞争力优势和产业升级之路。中国制造业通过过去几十年的不断积累，国内产业结构调整和技术进步非常显著，制造业受益工程师红利和产业链配套的完整，在国际市场上的产品竞争力大幅提升。虽然短期受宏观经济影响，利润增长和估值仍然徘徊在历史相对底部位置，但相信未来随着宏观经济的企稳回升，自身阿尔法属性会更好的显露出来，将重新获得市场认可。中国制造业在国际市场上的份额仍有望稳步提升，或将会有一大批优质企业从中国龙头公司成长为世界龙头公司。另外，高度重视数字经济、人工智能对中国制造业的影响。

从投资策略的角度看，研究的重心更多放在自下而上的角度，重视公司业绩增长和估值的匹配，长期重点关注金融、高端制造和消费升级。本基金会在行业和风格配置上保持均衡，继续自

下而上的深入研究挖掘个股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——国海富兰克林基金管理有限公司 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，国海富兰克林基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国海富兰克林基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告

中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,129,366,711.22	971,876,563.63
结算备付金		5,326,348.17	12,378,140.84
存出保证金		1,417,764.46	1,827,771.66
交易性金融资产	6.4.7.2	4,133,692,174.67	5,693,208,906.85
其中：股票投资		4,133,692,174.67	5,693,208,906.85
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		24,943,993.65	2,517,855.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		5,294,746,992.17	6,681,809,238.11
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		190,396,772.30	41,239,502.56
应付赎回款		25,092,180.39	23,098,923.10
应付管理人报酬		6,159,625.12	8,847,025.49
应付托管费		1,026,604.20	1,474,504.26
应付销售服务费		8,586.93	749.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		54,000.00	54,000.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	6,406,711.99	7,546,086.30
负债合计		229,144,480.93	82,260,790.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,902,915,382.05	3,794,065,295.82
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,162,687,129.19	2,805,483,151.33
净资产合计		5,065,602,511.24	6,599,548,447.15
负债和净资产总计		5,294,746,992.17	6,681,809,238.11

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,902,915,382.05 份，其中国富深化价值混合 A 基金份额净值 1.7450 元，基金份额总额 2,874,927,172.11 份；国富深化价值混合 C 基金份额净值 1.7415 元，基金份额总额 27,988,209.94 份。

6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		135,440,139.37	616,313,120.07
1. 利息收入		3,223,161.42	4,730,939.05
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,223,161.42	4,730,939.05
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-113,773,745.05	-76,106,310.09

其中：股票投资收益	6.4.7.14	-136,073,097.40	-153,489,454.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	452,792.82
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	22,299,352.35	76,930,351.42
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	242,531,838.07	686,303,390.12
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	3,458,884.93	1,385,100.99
减：二、营业总支出		50,054,395.66	43,366,591.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	42,726,075.69	37,062,246.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,121,012.67	6,177,041.15
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	61,756.99	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	1.38
8. 其他费用	6.4.7.23	145,550.31	127,302.37
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		85,385,743.71	572,946,528.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		85,385,743.71	572,946,528.39
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		85,385,743.71	572,946,528.39

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	3,794,065,295.82	-	2,805,483,151.33	6,599,548,447.15
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	3,794,065,295.82	-	2,805,483,151.33	6,599,548,447.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-891,149,913.77	-	-642,796,022.14	-1,533,945,935.91
（一）、综合收益总额	-	-	85,385,743.71	85,385,743.71
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-891,149,913.77	-	-728,181,765.85	-1,619,331,679.62
其中：1. 基金申购款	554,931,009.92	-	421,081,603.43	976,012,613.35
2. 基金赎回款	-1,446,080,923.69	-	-1,149,263,369.28	-2,595,344,292.97
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2,902,915,382.05	-	2,162,687,129.19	5,065,602,511.24
项目	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	708,612,336.77	-	1,561,467,374.74	2,270,079,711.51
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	708,612,336.77	-	1,561,467,374.74	2,270,079,711.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,990,210,520.30	-	3,450,098,611.10	7,440,309,131.40
（一）、综合收益总额	-	-	572,946,528.39	572,946,528.39
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,990,210,520.30	-	6,575,458,920.80	10,565,669,441.10
其中：1. 基金申购款	4,324,205,806.51	-	7,178,089,183.17	11,502,294,989.68
2. 基金赎回款	-333,995,286.21	-	-602,630,262.37	-936,625,548.58
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-3,698,306,838.09	-3,698,306,838.09
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	4,698,822,857.07	-	5,011,565,985.84	9,710,388,842.91

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

富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金(原富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第

406 号《关于核准富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金募集的批复》核准，由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 758,977,333.76 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 101 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 7 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 759,210,671.71 份基金份额，其中认购资金利息折合 233,337.95 份基金份额。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

根据本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于 2022 年 12 月 7 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深化价值混合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》以及更新后的《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，自 2022 年 12 月 7 日起，本基金增设 C 类基金份额。本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及中国证券监督管理委员会允许基金投资的其他金融工具，其中，股票投资范围包括所有在国内依法公开发行上市的股票(含存托凭证)；债券投资范围主要包括国内国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券和短期融资券等。本基金投资组合的范围为：股票投资(含存托凭证)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到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为： $85\% \times \text{沪深 300 指数} + 15\% \times \text{中债国债总指}$

数(全价)。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	1,129,366,711.22
等于：本金	1,129,183,346.39
加：应计利息	183,364.83

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	1,129,366,711.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,075,319,732.78	-	4,133,692,174.67	58,372,441.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,075,319,732.78	-	4,133,692,174.67	58,372,441.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	72,571.06
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,215,585.59
其中：交易所市场	6,215,585.59

银行间市场	-
应付利息	-
审计费用	54,547.97
信息披露费	59,507.37
债券账户维护费	4,500.00
合计	6,406,711.99

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国富深化价值混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,789,004,104.09	3,789,004,104.09
本期申购	512,295,213.53	512,295,213.53
本期赎回（以“-”号填列）	-1,426,372,145.51	-1,426,372,145.51
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	2,874,927,172.11	2,874,927,172.11

国富深化价值混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,061,191.73	5,061,191.73
本期申购	42,635,796.39	42,635,796.39
本期赎回（以“-”号填列）	-19,708,778.18	-19,708,778.18
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	27,988,209.94	27,988,209.94

注：申购含转换入份额；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

国富深化价值混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,887,100,118.25	-85,358,751.18	2,801,741,367.07
本期利润	-156,059,703.09	243,084,417.11	87,024,714.02

本期基金份额交易产生的变动数	-687,292,179.24	-59,541,361.57	-746,833,540.81
其中：基金申购款	377,580,404.45	9,854,451.15	387,434,855.60
基金赎回款	-1,064,872,583.69	-69,395,812.72	-1,134,268,396.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,043,748,235.92	98,184,304.36	2,141,932,540.28

国富深化价值混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,855,881.42	-114,097.16	3,741,784.26
本期利润	-1,086,391.27	-552,579.04	-1,638,970.31
本期基金份额交易产生的变动数	17,029,524.48	1,622,250.48	18,651,774.96
其中：基金申购款	31,477,855.09	2,168,892.74	33,646,747.83
基金赎回款	-14,448,330.61	-546,642.26	-14,994,972.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,799,014.63	955,574.28	20,754,588.91

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	3,143,802.62
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	66,941.44
其他	12,417.36
合计	3,223,161.42

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-136,073,097.40
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	-136,073,097.40

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

卖出股票成交总额	8,314,687,485.52
减：卖出股票成本总额	8,428,345,402.65
减：交易费用	22,415,180.27
买卖股票差价收入	-136,073,097.40

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	22,299,352.35
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	22,299,352.35

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	242,531,838.07
股票投资	242,531,838.07
债券投资	-
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	242,531,838.07

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,442,289.04
基金转换费收入	16,595.89
合计	3,458,884.93

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

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

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券账户维护费	9,000.00
银行汇划费用	22,494.97
合计	145,550.31

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
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
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
国海证券	60,439,630.25	0.40	31,045,008.56	0.28

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国海证券	56,288.14	0.44	56,288.14	0.91

关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国海证券	28,912.77	0.29	-	-

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	42,726,075.69	37,062,246.78
其中：支付销售机构的客户维护费	7,191,364.55	4,309,088.73

注：支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,121,012.67	6,177,041.15

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 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 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富深化价值混合 A	国富深化价值混合 C	合计

国海富兰克林基金管理有 限公司	-	6,325.66	6,325.66
合计	-	6,325.66	6,325.66
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富深化价值混合 A	国富深化价值混合 C	合计
合计	-	-	-

注：1. 新增 C 类份额日为 2022 年 12 月 7 日。

2. 支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.4% 的费率计提，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：

日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金份额对应的资产净值 × 0.4% / 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

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
		国富深化价值混合 A
基金合同生效日（2008 年 7 月 3 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	11,721,566.09	-
报告期间申购/买入总份额	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	11,721,566.09	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.41%	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间
	国富深化价值混合 A	国富深化价值混合 C
基金合同生效日（2008年7月3日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	8,195,901.64	-
报告期间申购/买入总份额	3,525,664.45	-
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	11,721,566.09	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.25%	-

注：1. 新增 C 类份额日为 2022 年 12 月 7 日。

2. 基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

国富深化价值混合 A

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
国海富兰克林资产管理（上海）有限公司	11,721,566.09	0.41	11,721,566.09	0.31
国海证券股份有限公司	-	-	-	-
邓普顿国际股份有限公司 (Templeton International, Inc.)	-	-	-	-

中国农业银行股份有限公司	-	-	-	-
--------------	---	---	---	---

注：1. 新增 C 类份额日为 2022 年 12 月 7 日，本报告期末和上年度末（2022 年 12 月 31 日）除基金管理人之外的其他关联方未投资国富深化价值混合 C 基金。

2. 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。

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		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	1,129,366,711.22	3,143,802.62	1,477,933,495.94	4,642,157.20

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-

		日								
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
002487	大金重工	2022年12月30日	6个月	非公开发行流通受限	37.35	30.52	1,338,688	49,999,996.80	40,856,757.76	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股锁定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年6月	1个月内(含)	新股未上	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-

		月 28 日		市						
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁定	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301225	恒勃股份	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁定	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁定	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股锁定	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	其中 97 股为锁定期送股的股份
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股锁定	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股锁定	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月	6 个月	新股锁定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-

		月 19 日								
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	新股锁定	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股锁定	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁定	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股锁定	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁定	131.11	53.24	392	34,219.71	20,870.08	其中 131 股为锁定期送股的股份
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁定	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月	6 个月	新股锁定	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-

		月9日								
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股锁定	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股锁定	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301399	英特科技	2023年5月	6个月	新股锁定	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-

		月 16 日								
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股锁定	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023 年 3 月	6 个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-

		月 30 日								
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁定	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁定	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	顾中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁定	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁定	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月	6 个月	新股锁定	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-

		月 15 日									
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00		-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74		-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁定	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68		-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68		-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	其中 72 股为锁定期送股的股份	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36		-
688522	纳睿雷达	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股锁定	46.68	51.50	4,299	200,677.32	221,398.50		-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股锁定	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20		-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62		-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03		-
688543	国科军工	2023 年 6 月	6 个月	新股锁定	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50		-

		月 14 日								
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁定	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁定	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月	6 个月	新股锁定	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

		月 19 日							
--	--	-----------	--	--	--	--	--	--	--

注：1、根据《上海证券交易所首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的股票设置不低于 6 个月的限售期。

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

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。

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险控制部负责投资风险管理与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的分析报告，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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,129,366,711.22	-	-	-	1,129,366,711.22
结算备付金	5,326,348.17	-	-	-	5,326,348.17
存出保证金	1,417,764.46	-	-	-	1,417,764.46
交易性金融资产	-	-	-4,133,692,174.67	4,133,692,174.67	4,133,692,174.67
应收申购款	-	-	-	24,943,993.65	24,943,993.65
资产总计	1,136,110,823.85	-	-4,158,636,168.32	4,158,636,168.32	5,294,746,992.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	25,092,180.39	25,092,180.39
应付管理人报酬	-	-	-	6,159,625.12	6,159,625.12
应付托管费	-	-	-	1,026,604.20	1,026,604.20
应付清算款	-	-	-	190,396,772.30	190,396,772.30
应付销售服务费	-	-	-	8,586.93	8,586.93
应交税费	-	-	-	54,000.00	54,000.00
其他负债	-	-	-	6,406,711.99	6,406,711.99
负债总计	-	-	-	229,144,480.93	229,144,480.93
利率敏感度缺口	1,136,110,823.85	-	-3,929,491,687.39	3,929,491,687.39	5,065,602,511.24
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	971,876,563.63	-	-	-	971,876,563.63
结算备付金	12,378,140.84	-	-	-	12,378,140.84
存出保证金	1,827,771.66	-	-	-	1,827,771.66
交易性金融资产	-	-	-5,693,208,906.85	-	5,693,208,906.85
应收申购款	-	-	2,517,855.13	-	2,517,855.13
资产总计	986,082,476.13	-	-5,695,726,761.98	-	6,681,809,238.11
负债					
应付赎回款	-	-	23,098,923.10	-	23,098,923.10
应付管理人报酬	-	-	8,847,025.49	-	8,847,025.49
应付托管费	-	-	1,474,504.26	-	1,474,504.26
应付清算款	-	-	41,239,502.56	-	41,239,502.56
应付销售服务费	-	-	749.25	-	749.25
应交税费	-	-	54,000.00	-	54,000.00
其他负债	-	-	7,546,086.30	-	7,546,086.30
负债总计	-	-	82,260,790.96	-	82,260,790.96
利率敏感度缺口	986,082,476.13	-	-5,613,465,971.02	-	6,599,548,447.15

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无固定收益品种投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票(含存托凭证)投资比例为基金资产的 60%-95%，债券、现金及其它短期金融工具为 5%-40%，其中每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,133,692,174.67	81.60	5,693,208,906.85	86.27
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	4,133,692,174.67	81.60	5,693,208,906.85	86.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）		
	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）	
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 26,230	增加约 29,884
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 26,230	减少约 29,884

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	4,090,498,388.45	5,641,366,977.51
第二层次	622,660.86	-
第三层次	42,571,125.36	51,841,929.34
合计	4,133,692,174.67	5,693,208,906.85

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,133,692,174.67	78.07
	其中：股票	4,133,692,174.67	78.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,134,693,059.39	21.43
8	其他各项资产	26,361,758.11	0.50
9	合计	5,294,746,992.17	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	356,489,505.63	7.04
C	制造业	2,516,469,970.81	49.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65,154,008.51	1.29
E	建筑业	136,041,333.85	2.69
F	批发和零售业	34,608,774.25	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	145,912,168.32	2.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	443,148,553.38	8.75
J	金融业	265,427,619.93	5.24
K	房地产业	102,142,169.02	2.02
L	租赁和商务服务业	68,245,067.06	1.35
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00

N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,133,692,174.67	81.60

7.2.2 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。

7.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002475	立讯精密	5,007,390	162,489,805.50	3.21
2	002920	德赛西威	836,190	130,286,763.90	2.57
3	002050	三花智控	4,041,992	122,310,677.92	2.41
4	600519	贵州茅台	71,909	121,598,119.00	2.40
5	601899	紫金矿业	8,812,701	100,200,410.37	1.98
6	002271	东方雨虹	3,573,233	97,406,331.58	1.92
7	000651	格力电器	2,466,100	90,037,311.00	1.78
8	600938	中国海油	4,929,773	89,327,486.76	1.76
9	300274	阳光电源	723,615	84,395,217.45	1.67
10	600398	海澜之家	12,221,640	84,084,883.20	1.66
11	300308	中际旭创	566,565	83,540,009.25	1.65
12	688111	金山办公	164,807	77,825,161.54	1.54
13	603338	浙江鼎力	1,387,040	77,688,110.40	1.53
14	603565	中谷物流	7,187,396	77,623,876.80	1.53
15	688777	中控技术	1,213,707	76,196,525.46	1.50
16	603039	泛微网络	926,784	75,653,377.92	1.49
17	300573	兴齐眼药	350,096	74,850,524.80	1.48
18	601138	工业富联	2,960,200	74,597,040.00	1.47
19	603979	金诚信	2,383,700	74,133,070.00	1.46
20	601100	恒立液压	1,147,023	73,787,989.59	1.46
21	603444	吉比特	144,500	70,965,395.00	1.40
22	000928	中钢国际	7,220,178	69,674,717.70	1.38
23	000063	中兴通讯	1,529,300	69,644,322.00	1.37
24	601577	长沙银行	8,750,055	67,900,426.80	1.34
25	002508	老板电器	2,681,791	67,822,494.39	1.34
26	002541	鸿路钢构	2,311,964	66,607,682.84	1.31
27	600970	中材国际	5,204,400	66,356,100.00	1.31
28	000425	徐工机械	9,725,066	65,838,696.82	1.30

29	300750	宁德时代	286,080	65,452,243.20	1.29
30	600900	长江电力	2,951,884	65,118,561.04	1.29
31	601998	中信银行	10,666,885	63,787,972.30	1.26
32	002841	视源股份	950,916	63,559,225.44	1.25
33	601728	中国电信	10,744,960	60,494,124.80	1.19
34	300558	贝达药业	1,258,510	60,446,235.30	1.19
35	601658	邮储银行	11,983,205	58,597,872.45	1.16
36	601088	中国神华	1,879,006	57,779,434.50	1.14
37	601012	隆基绿能	1,995,600	57,213,852.00	1.13
38	002747	埃斯顿	1,976,914	55,353,592.00	1.09
39	600933	爱柯迪	2,354,053	54,825,894.37	1.08
40	603833	欧派家居	555,754	53,241,233.20	1.05
41	603300	华铁应急	9,209,020	50,189,159.00	0.99
42	300408	三环集团	1,701,355	49,934,769.25	0.99
43	002487	大金重工	1,631,488	49,886,709.76	0.98
44	600406	国电南瑞	2,157,641	49,841,507.10	0.98
45	001979	招商蛇口	3,676,564	47,905,628.92	0.95
46	601688	华泰证券	3,459,000	47,630,430.00	0.94
47	600702	舍得酒业	362,746	44,962,366.70	0.89
48	688008	澜起科技	759,666	43,620,021.72	0.86
49	600026	中远海能	3,179,668	40,191,003.52	0.79
50	002180	纳思达	1,106,700	37,904,475.00	0.75
51	300298	三诺生物	1,364,892	36,906,679.68	0.73
52	300124	汇川技术	555,888	35,693,568.48	0.70
53	002472	双环传动	967,156	35,107,762.80	0.69
54	601607	上海医药	1,540,600	34,524,846.00	0.68
55	301207	华兰疫苗	1,013,844	33,720,451.44	0.67
56	000786	北新建材	1,361,643	33,373,869.93	0.66
57	600325	华发股份	3,269,418	32,203,767.30	0.64
58	002230	科大讯飞	471,900	32,070,324.00	0.63
59	002317	众生药业	1,660,900	28,218,691.00	0.56
60	601006	大秦铁路	3,781,600	28,097,288.00	0.55
61	601128	常熟银行	4,033,859	27,510,918.38	0.54
62	003031	中瓷电子	205,612	27,371,069.44	0.54
63	002444	巨星科技	1,158,995	25,358,810.60	0.50
64	600309	万华化学	285,600	25,087,104.00	0.50
65	002531	天顺风能	1,554,386	23,673,298.78	0.47
66	600266	城建发展	4,337,160	22,032,772.80	0.43
67	601225	陕西煤业	1,092,800	19,878,032.00	0.39
68	603195	公牛集团	196,649	18,890,102.94	0.37
69	605168	三人行	210,099	18,055,908.06	0.36
70	601699	潞安环能	929,600	15,171,072.00	0.30
71	300751	迈为股份	40,700	6,893,766.00	0.14

72	688469	中芯集成	137,994	778,837.98	0.02
73	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
74	688522	纳睿雷达	4,299	221,398.50	0.00
75	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
76	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
77	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
78	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
79	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
80	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
81	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
82	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
83	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
84	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
85	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
86	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
87	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
88	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
89	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
90	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
91	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
92	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
93	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
94	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
95	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
96	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
97	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
98	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
99	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
100	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
101	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
102	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
103	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
104	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
105	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
106	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
107	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
108	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
109	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
110	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
111	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
112	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
113	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
114	688334	西高院	888	14,394.48	0.00

115	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
116	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
117	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
118	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
119	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
120	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
121	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
122	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
123	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
124	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
125	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
126	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
127	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
128	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
129	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
130	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
131	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
132	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
133	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
134	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
135	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
136	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
137	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
138	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
139	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
140	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
141	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
142	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
143	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
144	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
145	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
146	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
147	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
148	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
149	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
150	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
151	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
152	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
153	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
154	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
155	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
156	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
157	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000063	中兴通讯	173,935,440.18	2.64
2	600702	舍得酒业	144,573,042.24	2.19
3	000425	徐工机械	139,674,455.54	2.12
4	002920	德赛西威	135,765,773.02	2.06
5	601577	长沙银行	117,072,778.43	1.77
6	002230	科大讯飞	114,960,673.88	1.74
7	601728	中国电信	112,075,458.80	1.70
8	600941	中国移动	103,403,745.79	1.57
9	300308	中际旭创	94,998,255.87	1.44
10	601998	中信银行	91,017,503.92	1.38
11	600481	双良节能	88,223,126.08	1.34
12	000651	格力电器	87,083,047.94	1.32
13	600801	华新水泥	87,072,300.09	1.32
14	603039	泛微网络	86,914,561.40	1.32
15	688777	中控技术	85,561,434.30	1.30
16	601899	紫金矿业	85,209,606.71	1.29
17	688008	澜起科技	84,793,452.05	1.28
18	002463	沪电股份	83,336,809.65	1.26
19	300558	贝达药业	82,514,979.13	1.25
20	600398	海澜之家	81,260,422.32	1.23

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。

7.4.2 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	300308	中际旭创	200,956,003.95	3.04
2	600256	广汇能源	195,867,957.94	2.97
3	600309	万华化学	185,428,689.96	2.81
4	002142	宁波银行	182,344,061.59	2.76
5	002050	三花智控	176,233,816.79	2.67
6	601318	中国平安	169,752,535.82	2.57
7	601658	邮储银行	167,546,519.00	2.54
8	300274	阳光电源	167,053,935.69	2.53
9	002648	卫星化学	162,931,032.94	2.47
10	300059	东方财富	144,947,204.90	2.20
11	601100	恒立液压	141,274,697.41	2.14
12	300750	宁德时代	121,822,981.30	1.85

13	600690	海尔智家	120,931,081.74	1.83
14	002472	双环传动	118,670,099.52	1.80
15	600941	中国移动	116,068,243.02	1.76
16	002960	青鸟消防	114,950,322.44	1.74
17	000063	中兴通讯	114,539,506.00	1.74
18	688111	金山办公	113,341,226.51	1.72
19	600406	国电南瑞	109,590,023.09	1.66
20	002966	苏州银行	103,590,303.44	1.57

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。

7.4.3 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	6,626,296,832.40
卖出股票收入（成交）总额	8,314,687,485.52

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本期投资的前十名证券中，无报告期内发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

7.12.2 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。

7.12.3 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	1,417,764.46
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	24,943,993.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,361,758.11

7.12.4 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换债券。

7.12.5 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。

§ 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（%）

国富深化价值混合 A	1,069,892	2,687.12	1,993,744,623.15	69.35	881,182,548.96	30.65
国富深化价值混合 C	6,436	4,348.70	12,938,120.15	46.23	15,050,089.79	53.77
合计	1,076,328	2,697.05	2,006,682,743.30	69.13	896,232,638.75	30.87

8.2 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	国富深化价值混合 A	815,050.81	0.028350
	国富深化价值混合 C	558.47	0.001995
	合计	815,609.28	0.028096

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	国富深化价值混合 A	10~50
	国富深化价值混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国富深化价值混合 A	0~10
	国富深化价值混合 C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富深化价值混合 A	国富深化价值混合 C
基金合同生效日 (2008 年 7 月 3 日) 基金份额总额	759,210,671.71	-
本报告期期初基金份额总额	3,789,004,104.09	5,061,191.73
本报告期基金总申购份额	512,295,213.53	42,635,796.39
减：本报告期基金总赎回份额	1,426,372,145.51	19,708,778.18
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,874,927,172.11	27,988,209.94

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(一) 基金管理人重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人无重大人事变动。

(二) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券	2	2,501,302,977.27	16.76	2,195,058.29	16.99	-
天风证券	1	1,651,909,946.66	11.07	1,208,042.04	9.35	-

西藏东财 证券	2	1,610,956,62 6.67	10.79	1,178,102.13	9.12	-
华安证券	1	1,554,435,65 3.83	10.42	1,447,647.24	11.20	-
海通证券	1	1,093,299,31 9.00	7.33	1,018,190.44	7.88	-
中金公司	2	1,079,802,00 3.66	7.23	1,005,615.38	7.78	-
国盛证券	1	886,952,644. 99	5.94	648,611.53	5.02	-
中信证券	3	778,324,538. 58	5.21	724,854.04	5.61	-
国泰君安	1	640,700,791. 36	4.29	596,685.46	4.62	-
方正证券	1	559,286,328. 21	3.75	520,866.67	4.03	-
国信证券	1	502,215,917. 71	3.36	467,710.93	3.62	-
申万宏源	1	479,462,462. 47	3.21	446,526.44	3.46	-
中信建投	1	372,663,588. 62	2.50	347,052.36	2.69	-
兴业证券	1	311,863,021. 66	2.09	290,437.00	2.25	-
东兴证券	1	282,378,902. 46	1.89	262,974.65	2.04	-
高盛中国	1	276,633,574. 15	1.85	257,630.03	1.99	-
招商证券	1	204,045,498. 72	1.37	190,028.45	1.47	-
首创证券	1	72,857,519.4 4	0.49	53,283.09	0.41	-
国海证券	2	60,439,630.2 5	0.40	56,288.14	0.44	-
安信证券	2	5,227,211.25	0.04	4,868.22	0.04	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	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，本基金新增申港证券上海及深圳交易单元各 1 个。因北京高华相关业务并入高盛高华，本基金原租用的北京高华交易单元变更为高盛高华。截至报告期末，高盛高华已更名为高盛中国。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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(%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行的股票的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 1 月 19 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	2023 年 1 月 20 日
3	富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金 2022 年第四季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 1 月 20 日
4	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加长江证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 2 月 1 日
5	关于增加万家财富基金销售（天津）有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 2 月 8 日
6	关于增加上海万得基金销售有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 2 月 14 日
7	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、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 3 月 2 日
8	关于增加和信证券投资咨询股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 3 月 3 日
9	关于增加中国中金财富证券有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 3 月 8 日
10	关于增加方正证券股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 3 月 14 日
11	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金在湘财证券股份有限公司	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 3 月 15 日

	司开通转换、定期定额投资业务及费率优惠活动的公告		
12	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加兴业证券股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 3 月 31 日
13	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 3 月 31 日
14	富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 3 月 31 日
15	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加南京证券股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 4 月 12 日
16	富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金 2023 年第一季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 4 月 22 日
17	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 4 月 22 日
18	关于增加嘉实财富管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转换业务、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	2023 年 6 月 15 日
19	富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金（国富深化价值混合 A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 6 月 27 日
20	富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金（国富深化价值混合 C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 6 月 27 日
21	关于增加腾安基金销售（深圳）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	2023 年 6 月 30 日
22	富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金更新招募说明书(2023 年 1 号)	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金资产可投资于科创板股票和北京证券交易所股票，会面临科创板和北京证券交易所机

制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于公司治理风险、流动性风险、退市风险、股价波动风险、中小企业经营风险、投资集中风险、系统性风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票、北京证券交易所股票或选择不将基金资产投资于科创板股票、北京证券交易所股票，基金资产并非必然投资于科创板股票、北京证券交易所股票。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金设立的文件（2015 年 8 月 8 日起，基金名称变更为“富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金”）
- 2、《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金托管协议》
- 5、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

- 1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件。
- 2、登陆基金管理人网站 www.ftsfund.com 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日