

富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金  
2023 年年度报告

2023 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 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 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 10        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12        |
| 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             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| 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       | 15        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15        |
| 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 | 15        |
| 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      | 15        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>16</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 16        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 16        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>17</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 17        |
| 7.2 利润表                                 | 19        |
| 7.3 净资产变动表                              | 20        |
| 7.4 报表附注                                | 22        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>57</b> |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                        | 57        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                  | 58        |
| 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 .....     | 58        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 63        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 64        |
| 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 .....    | 64        |
| 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 ..... | 64        |
| 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 ..... | 64        |
| 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 .....    | 64        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 64        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 65        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 65        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>65</b> |
| 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 .....              | 66        |
| 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情况 .....      | 66        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>66</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>67</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 67        |
| 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 .....      | 67        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 67        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 67        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 67        |
| 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 .....         | 67        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 67        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 70        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>74</b> |
| 12.1 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 .....    | 74        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 74        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                    | <b>74</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 74        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 75        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 75        |

## § 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      | 2,469,443,101.25 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 | 2,432,407,340.64 份  | 37,035,760.61 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金以富兰克林邓普顿基金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）。<br>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            | 任航           |

|        |      |                                       |                              |
|--------|------|---------------------------------------|------------------------------|
| 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   |      | 南宁高新区中国-东盟企业总部基地三期综合楼 A 座 17 层 1707 室 | 北京市东城区建国门内大街 69 号            |
| 办公地址   |      | 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 9 层           | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码   |      | 200120                                | 100031                       |
| 法定代表人  |      | 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） | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 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 | 2023 年          |               | 2022 年          | 2022 年 12 月 7 日（增设 C 类份额日）-2022 年 12 月 31 日 | 2021 年         |            |
|---------------|-----------------|---------------|-----------------|---|----------------|------------|
|               | 国富深化价值混合 A      | 国富深化价值混合 C    | 国富深化价值混合 A      | 国富深化价值混合 C                                  | 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       | -526,848,091.96 | -6,108,440.75 | -678,947,144.44 | -43,689.95                                  | 125,249,331.80 | -          |
| 本期利润          | -350,295,289.10 | -6,848,840.50 | -999,137,920.70 | 82,282.55                                   | 157,712,512.68 | -          |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1184         | -0.2648       | -0.3008         | 0.0500                                      | 0.4681         | -          |
| 本期加权平均净值利润率   | -6.87%          | -15.65%       | -14.10%         | 2.89%                                       | 15.49%         | -          |
| 本期基金份额净       | -8.57%          | -8.93%        | -22.03%         | -2.86%                                      | 22.01%         | -          |

| 值增长率          |                  |               |                  |              |                  |   |
|---------------|------------------|---------------|------------------|--------------|------------------|---|
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2023 年末          |               | 2022 年末          |              | 2021 年末          |   |
| 期末可供分配利润      | 1,393,554,588.46 | 20,983,019.14 | 2,801,741,367.07 | 3,741,784.26 | 1,307,528,010.61 | - |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.5729           | 0.5666        | 0.7394           | 0.7393       | 1.8452           | - |
| 期末基金资产净值      | 3,868,155,653.40 | 58,660,530.66 | 6,590,745,471.16 | 8,802,975.99 | 2,270,079,711.51 | - |
| 期末基金份额净值      | 1.5903           | 1.5839        | 1.7394           | 1.7393       | 3.2040           | - |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2023 年末          |               | 2022 年末          |              | 2021 年末          |   |
| 基金份额累计净值增长率   | 229.60%          | -11.54%       | 260.50%          | -2.86%       | 362.36%          | - |

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

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

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

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

5、本基金自 2022 年 12 月 7 日起增设 C 类份额。

6、根据 2022 年 12 月 7 日发布的相关公告，本基金于 2022 年 12 月 7 日起将基金份额净值计算保留位数从小数点后三位变更为小数点后四位，小数点后第五位四舍五入。

## 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    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -5.15%   | 0.64%       | -5.85%     | 0.67%         | 0.70% | -0.03% |
| 过去六个月 | -8.87%   | 0.70%       | -8.99%     | 0.72%         | 0.12% | -0.02% |
| 过去一年  | -8.57%   | 0.76%       | -9.35%     | 0.72%         | 0.78% | 0.04%  |

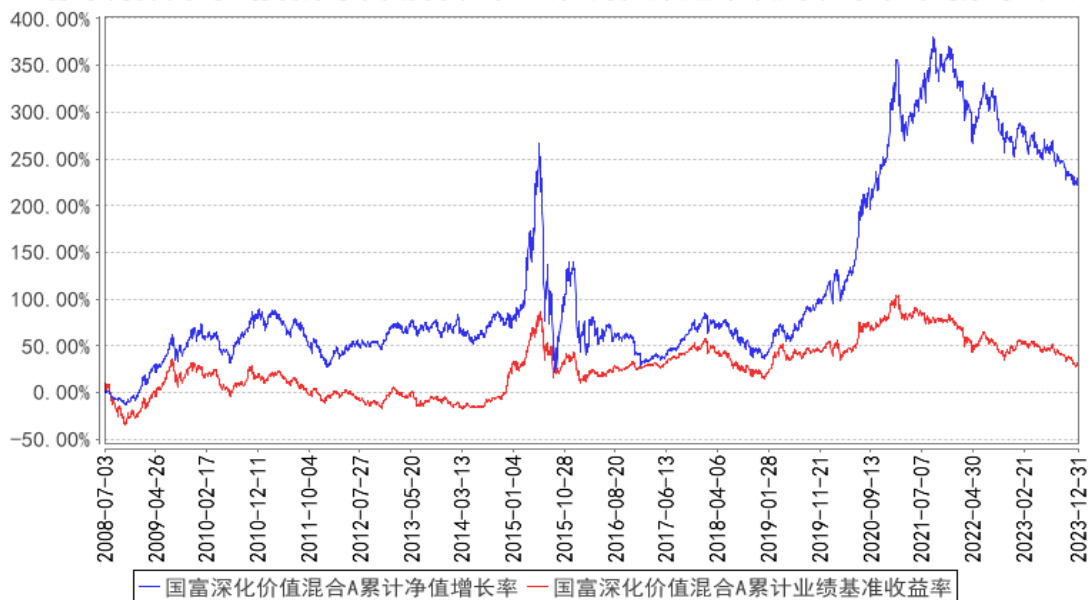
|            |         |       |         |       |         |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去三年       | -13.02% | 1.09% | -28.93% | 0.95% | 15.91%  | 0.14% |
| 过去五年       | 139.41% | 1.21% | 14.02%  | 1.03% | 125.39% | 0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | 229.60% | 1.61% | 32.47%  | 1.29% | 197.13% | 0.32% |

国富深化价值混合 C

| 阶段        | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|-----------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月     | -5.25%   | 0.64%       | -5.85%     | 0.67%         | 0.60%  | -0.03% |
| 过去六个月     | -9.05%   | 0.70%       | -8.99%     | 0.72%         | -0.06% | -0.02% |
| 过去一年      | -8.93%   | 0.76%       | -9.35%     | 0.72%         | 0.42%  | 0.04%  |
| 自增设C类份额至今 | -11.54%  | 0.76%       | -11.15%    | 0.71%         | -0.39% | 0.05%  |

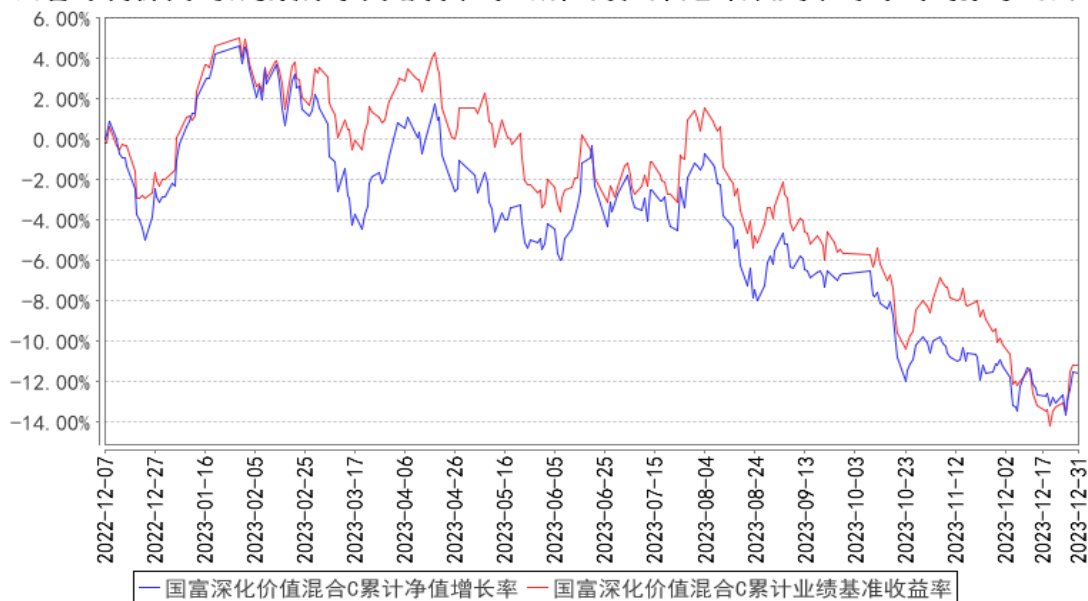
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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





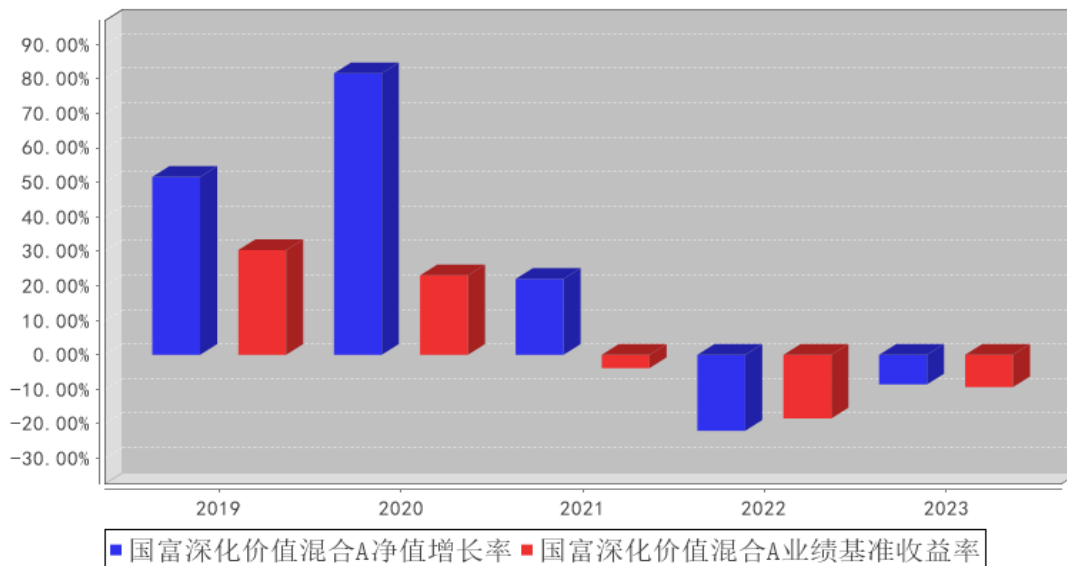
国富深化价值混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

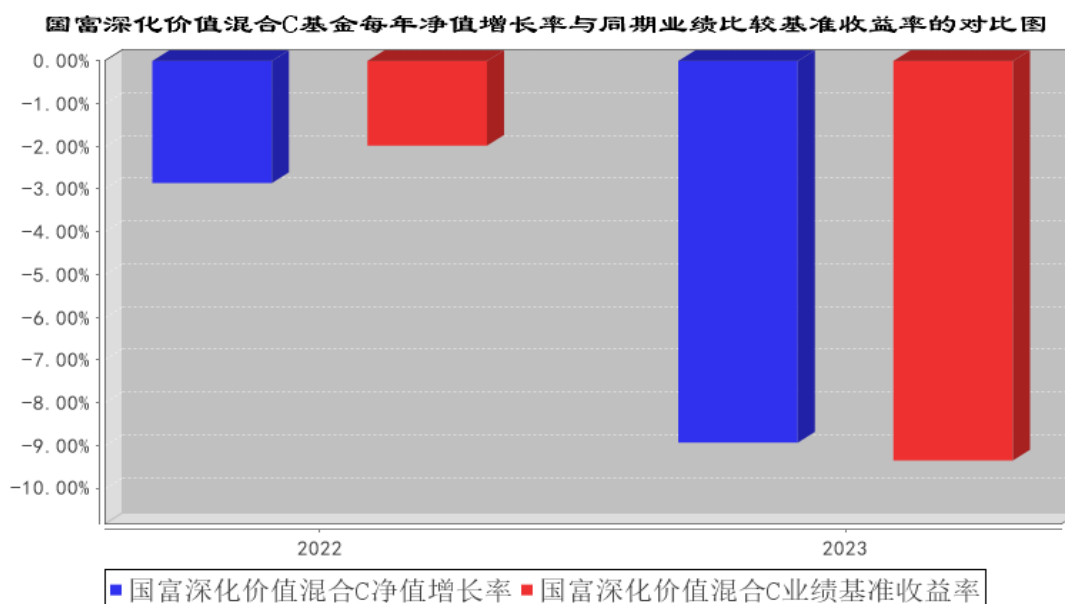


注：本基金的基金合同生效日为 2008 年 7 月 3 日，并于 2022 年 12 月 7 日增设 C 类份额。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

### 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

国富深化价值混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图





注：本基金C类份额成立于2022年12月7日，故2022年业绩为成立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

#### 国富深化价值混合 A

| 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 |
|--------|---------------|------------------|------------------|------------------|----|
| 2023 年 | -             | -                | -                | -                | -  |
| 2022 年 | 8.896         | 2,609,179,697.71 | 1,089,127,140.38 | 3,698,306,838.09 | -  |
| 2021 年 | -             | -                | -                | -                | -  |
| 合计     | 8.896         | 2,609,179,697.71 | 1,089,127,140.38 | 3,698,306,838.09 | -  |

#### 国富深化价值混合 C

| 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 |
|--------|---------------|----------|-----------|----------|----|
| 2023 年 | -             | -        | -         | -        | -  |
| 2022 年 | -             | -        | -         | -        | -  |
| 合计     | -             | -        | -         | -        | -  |

注：本基金自2022年12月7日起增设C类份额。

## § 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 年末，公司旗下合计管理 44 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合基金的基金经理 | 2017 年 2 月 18 日 | -    | 17 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。 |

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，公司共管理了四十四只公募基金及四只专户产品。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

回顾 2023 年，一季度宏观经济在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 技术进步影响最大的板块。尤其是 AI 相关板块及个股备受关注，市场表现出了极高的研究热情和参与度，虽然在进入三季度后，因为短期涨幅过大而显著回调，但四季度随着 AI 领域应用的进一步发展，相关公司及板块又有所表现。另外，全年来看，业绩确定性较强且估值偏低、股息率较高的板块继续获得市场青睐。

海外方面，美国通胀率持续高企，经济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、外资流动等问题比较担忧。

全年来看，通信、传媒、计算机和电子等板块表现较好，而商贸零售、地产、建材和电气设备新能源等板块跌幅较大。

2023 年全年，本基金全年总体维持中性偏乐观的权益仓位，重点配置景气度持续性较强的行业中，估值相对合理，有核心竞争力的优质公司。具体行业方面，采掘、电子、电气设备、通信等配置相对较多，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 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.5903 元，本报告期份额净值下跌 8.57%，同期业绩比较基准下跌 9.35%，跑赢业绩比较基准 0.78%。本基金 C 类份额净值为 1.5839 元，本报告期份额净值下跌 8.93%，同期业绩比较基准下跌 9.35%，跑赢业绩比较基准 0.42%。

## 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 2024 年，随着国内宏观经济持续复苏，市场在经历过去一年估值的进一步下探后进入较

好的价值投资区间，同时，结构性机会也不乏亮点。自下而上的研究和投资，更侧重于从各条产业把握整体的经济脉搏。在市场情绪波动较大，以及对个别行业的判断过于悲观或狂热的时候，更应该保持足够的定力，才能在风浪中保持清醒和稳健，看到更多更长远的机会。

中长期看中国经济韧性较强，未来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。继续看好中国制造业升级的大趋势和其中涌现出的众多优质公司。中国制造业经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，受益国内工程师红利和产业链配套的完整，国际竞争力大幅提升，相信未来随着国内经济活力的恢复以及海外份额的逐步提升，将重新获得市场认可。另外，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，需要高度重视。过去的历次能源革命、技术革新对很多产业以及整个社会的生产生活组织方式都产生重大且深远的影响，当前，电气化方兴未艾，AI 的进步又到了关键爆发的节点。面对科技发展的日新月异，一定要保持足够的重视、敬畏和乐观开放的心态，摆脱线性的思维方式，从更多维度和更长周期里思考问题，才不会错过科技时代的重大变化。

从投资策略的角度看，研究的重心始终应该更多地放在自下而上的角度，重视公司业绩增长和估值匹配的逻辑，长期重点关注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。

本基金将继续按照基金合同及相关法律法规要求，努力做好基金投资工作，争取未来取得更好的长期投资收益。

#### 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项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投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——国海富兰克林基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 6 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(2024)第 25109 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         | 富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金全体基金份额持有人   |
| 审计意见            | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金(以下简称“国富深化价值混合基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>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,公允反映了国富深化价值混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国富深化价值混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>   |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>国富深化价值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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估国富深化价值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深化价值混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督国富深化价值混合基金的财务报告过程。</p>                           |
| 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   |



|           |  |
|-----------|--|
| 任         | <p>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。</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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，就可能对国富深化价值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深化价值混合基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p> |
| 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  | 赵钰 俞伟敏   |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼  |
| 审计报告日期    | 2024 年 3 月 28 日  |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 | 上年度末 |
|----|-----|-----|------|
|----|-----|-----|------|

|               |            | 2023 年 12 月 31 日                | 2022 年 12 月 31 日                 |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                 |                                  |
| 货币资金          | 7.4.7.1    | 663,328,248.06                  | 971,876,563.63                   |
| 结算备付金         |            | 8,224,400.62                    | 12,378,140.84                    |
| 存出保证金         |            | 1,290,537.15                    | 1,827,771.66                     |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | 3,335,178,052.23                | 5,693,208,906.85                 |
| 其中：股票投资       |            | 3,335,178,052.23                | 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        | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | -                               | -                                |
| 债权投资          | 7.4.7.5    | -                               | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                               | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                               | -                                |
| 其他投资          |            | -                               | -                                |
| 其他债权投资        | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 其他权益工具投资      | 7.4.7.7    | -                               | -                                |
| 应收清算款         |            | 3,973,925.39                    | -                                |
| 应收股利          |            | -                               | -                                |
| 应收申购款         |            | 1,094,781.54                    | 2,517,855.13                     |
| 递延所得税资产       |            | -                               | -                                |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | -                               | -                                |
| 资产总计          |            | 4,013,089,944.99                | 6,681,809,238.11                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2022 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                 |                                  |
| 短期借款          |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债       |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债        | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                               | -                                |
| 应付清算款         |            | 10,597,968.43                   | 41,239,502.56                    |
| 应付赎回款         |            | 64,369,927.72                   | 23,098,923.10                    |
| 应付管理人报酬       |            | 4,237,886.82                    | 8,847,025.49                     |
| 应付托管费         |            | 706,314.49                      | 1,474,504.26                     |
| 应付销售服务费       |            | 19,584.60                       | 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          | 7.4.7.9    | 6,288,078.87                    | 7,546,086.30                     |

|             |          |                  |                  |
|-------------|----------|------------------|------------------|
| 负债合计        |          | 86,273,760.93    | 82,260,790.96    |
| <b>净资产：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金        | 7.4.7.10 | 2,469,443,101.25 | 3,794,065,295.82 |
| 其他综合收益      | 7.4.7.11 | -                | -                |
| 未分配利润       | 7.4.7.12 | 1,457,373,082.81 | 2,805,483,151.33 |
| 净资产合计       |          | 3,926,816,184.06 | 6,599,548,447.15 |
| 负债和净资产总计    |          | 4,013,089,944.99 | 6,681,809,238.11 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,469,443,101.25 份，其中中国富深化价值混合 A 基金份额净值 1.5903 元，基金份额总额 2,432,407,340.64 份；国富深化价值混合 C 基金份额净值 1.5839 元，基金份额总额 37,035,760.61 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 12 月 31 日 |
|------------------------|----------|---|--|
| <b>一、营业总收入</b>         |          | -271,813,172.84                           | -876,501,532.11                                |
| 1. 利息收入                |          | 6,812,132.38                              | 9,656,544.17                                   |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.13 | 6,812,132.38                              | 9,656,544.17                                   |
| 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             |          | -   | -  |
| 其他利息收入                 |          | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |          | -459,080,888.88                           | -573,161,792.71                                |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.14 | -517,663,340.71                           | -716,555,589.85                                |
| 基金投资收益                 |          | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.15 | -   | 2,521,161.39                                   |
| 资产支持证券投资               | 7.4.7.16 | -   | -  |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.17 | -   | -  |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.18 | -   | -  |
| 股利收益                   | 7.4.7.19 | 58,582,451.83                             | 140,872,635.75                                 |
| 其他投资收益                 |          | -   | -  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.20 | 175,812,403.11                            | -320,064,803.76                                |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -   | -  |

|                            |            |                 |                 |
|----------------------------|------------|-----------------|-----------------|
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7.4.7.21   | 4,643,180.55    | 7,068,520.19    |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 85,330,956.76   | 122,554,106.04  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 72,745,575.32   | 104,790,882.68  |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 12,124,262.64   | 17,465,147.18   |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 173,492.55      | 749.25          |
| 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                  | 7.4.7.22   | -               | -               |
| 7. 税金及附加                   |            | -               | 1.90            |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.23   | 287,626.25      | 297,325.03      |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -357,144,129.60 | -999,055,638.15 |
| 减：所得税费用                    |            | -               | -               |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -357,144,129.60 | -999,055,638.15 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -               | -               |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -357,144,129.60 | -999,055,638.15 |

### 7.3 净资产变动表

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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                    | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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             | 3,794,065,295.<br>82                   | -      | 2,805,483,151.<br>33  | 6,599,548,447.1<br>5  |
| 二、本期期初净资产             | 3,794,065,295.<br>82                   | -      | 2,805,483,151.<br>33  | 6,599,548,447.1<br>5  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）  | -1,324,622,194<br>.57                  | -      | -1,348,110,068<br>.52 | -2,672,732,263.<br>09 |
| （一）、综合收益总额            | -                                      | -      | -357,144,129.6<br>0   | -357,144,129.60       |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 | -1,324,622,194<br>.57                  | -      | -990,965,938.9<br>2   | -2,315,588,133.<br>49 |

|  |                                  |        |                   |                   |
|--|----------------------------------|--------|-------------------|-------------------|
| (净资产减少以“-”号填列)                           |                                  |        |                   |                   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 904,524,096.16                   | -      | 652,848,900.06    | 1,557,372,996.22  |
| 2. 基金赎回款                                 | -2,229,146,290.73                | -      | -1,643,814,838.98 | -3,872,961,129.71 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                                | -      | -                 | -                 |
| 四、本期期末净资产                                | 2,469,443,101.25                 | -      | 1,457,373,082.81  | 3,926,816,184.06  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31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                                | 708,612,336.77                   | -      | 1,561,467,374.74  | 2,270,079,711.51  |
| 二、本期期初净资产                                | 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)                     | 3,085,452,959.05                 | -      | 1,244,015,776.59  | 4,329,468,735.64  |
| (一)、综合收益总额                               | -                                | -      | -999,055,638.15   | -999,055,638.15   |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 3,085,452,959.05                 | -      | 5,941,378,252.83  | 9,026,831,211.88  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 5,481,543,302.12                 | -      | 8,278,323,186.79  | 13,759,866,488.91 |
| 2. 基金赎回款                                 | -2,396,090,343.07                | -      | -2,336,944,933.96 | -4,733,035,277.03 |
| (三)、本期向基                                 | -                                | -      | -3,698,306,838    | -3,698,306,838.   |

|                                  |                  |   |                  |                  |
|----------------------------------|------------------|---|------------------|------------------|
| 金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） |                  |   | .09              | 09               |
| 四、本期期末净资产                        | 3,794,065,295.82 | - | 2,805,483,151.33 | 6,599,548,447.15 |

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：

|            |           |           |
|------------|-----------|-----------|
| <u>徐荔蓉</u> | <u>于意</u> | <u>肖燕</u> |
| 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 2024 年 3 月 28 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、《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 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 2023 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债



金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利

率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额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扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,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、托管费和销售服务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。

以摊余成本计量的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净资产转出。

#### 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、债券投资和资产支持证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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于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[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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|----|--------------------|---------------------|
|    |                    |                     |

|                    |                |                |
|--------------------|----------------|----------------|
| 活期存款               | 663,328,248.06 | 971,876,563.63 |
| 等于：本金              | 663,181,663.90 | 971,698,151.99 |
| 加：应计利息             | 146,584.16     | 178,411.64     |
| 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<br>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                 | 663,328,248.06 | 971,876,563.63 |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日  |      |                  |                 |
|---------------|--------------------------|------|------------------|-----------------|
|               | 成本                       | 应计利息 | 公允价值             | 公允价值变动          |
| 股票            | 3,343,525,045.30         | -    | 3,335,178,052.23 | -8,346,993.07   |
| 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            | 3,343,525,045.30         | -    | 3,335,178,052.23 | -8,346,993.07   |
| 项目            | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |      |                  |                 |
|               | 成本                       | 应计利息 | 公允价值             | 公允价值变动          |
| 股票            | 5,877,368,303.03         | -    | 5,693,208,906.85 | -184,159,396.18 |
| 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     |    | 5,877,368,303.03 | - | 5,693,208,906.85 | -184,159,396.18 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末及上年度末未持有期货合约。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末及上年度末未持有黄金衍生品。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。



## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 203,680.36         | 90,909.22           |
| 应付证券出借违约金   | -                  | -                   |
| 应付交易费用      | 5,849,898.51       | 7,210,677.08        |
| 其中：交易所市场    | 5,849,898.51       | 7,210,677.08        |
| 银行间市场       | -                  | -                   |
| 应付利息        | -                  | -                   |
| 审计费用        | 110,000.00         | 120,000.00          |
| 信息披露费       | 120,000.00         | 120,000.00          |
| 债券账户维护费     | 4,500.00           | 4,500.00            |
| 合计          | 6,288,078.87       | 7,546,086.30        |

## 7.4.7.10 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<br>2023年1月1日至2023年12月31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          | 846,865,732.45              | 846,865,732.45    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,203,462,495.90           | -2,203,462,495.90 |
| 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           | 2,432,407,340.64            | 2,432,407,340.64  |

## 国富深化价值混合 C

| 项目 | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31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          | 57,658,363.71  | 57,658,363.71  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -25,683,794.83 | -25,683,794.83 |
| 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           | 37,035,760.61  | 37,035,760.61  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 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  |
| 本期期初           | 2,887,100,118.25  | -85,358,751.18 | 2,801,741,367.07  |
| 本期利润           | -526,848,091.96   | 176,552,802.86 | -350,295,289.10   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -966,697,437.83   | -49,000,327.38 | -1,015,697,765.21 |
| 其中：基金申购款       | 600,450,257.31    | 8,770,830.82   | 609,221,088.13    |
| 基金赎回款          | -1,567,147,695.14 | -57,771,158.20 | -1,624,918,853.34 |
| 本期已分配利润        | -                 | -              | -                 |
| 本期末            | 1,393,554,588.46  | 42,193,724.30  | 1,435,748,312.76  |

##### 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   |
| 本期期初           | 3,855,881.42   | -114,097.16  | 3,741,784.26   |
| 本期利润           | -6,108,440.75  | -740,399.75  | -6,848,840.50  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 23,235,578.47  | 1,496,247.82 | 24,731,826.29  |
| 其中：基金申购款       | 41,583,674.61  | 2,044,137.32 | 43,627,811.93  |
| 基金赎回款          | -18,348,096.14 | -547,889.50  | -18,895,985.64 |
| 本期已分配利润        | -              | -            | -              |
| 本期末            | 20,983,019.14  | 641,750.91   | 21,624,770.05  |

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |
|----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 6,661,198.98                | 9,466,804.93                     |

|           |              |              |
|-----------|--------------|--------------|
| 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 | 127,320.29   | 166,611.54   |
| 其他        | 23,613.11    | 23,127.70    |
| 合计        | 6,812,132.38 | 9,656,544.17 |

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -517,663,340.71             | -716,555,589.85                  |
| 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               | -517,663,340.71             | -716,555,589.85                  |

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 14,034,321,672.37           | 10,095,549,290.30                |
| 减：卖出股票成本总额 | 14,515,241,760.33           | 10,778,440,394.27                |
| 减：交易费用     | 36,743,252.75               | 33,664,485.88                    |
| 买卖股票差价收入   | -517,663,340.71             | -716,555,589.85                  |

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 债券投资收益——利息 | -                           | 4,919.26                         |

|                              |   |              |
|------------------------------|---|--------------|
| 收入                           |   |              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | - | 2,516,242.13 |
| 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                           | - | 2,521,161.39 |

#### 7.4.7.15.2 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>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | -                           | 21,075,925.36                    |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | -                           | 18,554,000.00                    |
| 减：应计利息总额               | -                           | 4,978.47                         |
| 减：交易费用                 | -                           | 704.76                           |
| 买卖债券差价收入               | -                           | 2,516,242.13                     |

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月<br>31日 |
|---------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 58,582,451.83                   | 140,872,635.75                       |
| 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            | 58,582,451.83                   | 140,872,635.75                       |

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2023年1月1日至2023年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022<br>年12月31日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 175,812,403.11                  | -320,064,803.76                      |
| 股票投资                   | 175,812,403.11                  | -320,064,803.76                      |
| 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                     | 175,812,403.11                  | -320,064,803.76                      |

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022<br>年12月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 4,581,539.78                    | 6,988,993.93                         |
| 基金转换费收入 | 61,640.77                       | 79,526.26                            |
| 合计      | 4,643,180.55                    | 7,068,520.19                         |

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。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12<br>月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31<br>日 |
|---------|---|--|
| 审计费用    | 110,000.00                                | 120,000.00                                     |
| 信息披露费   | 120,000.00                                | 120,000.00                                     |
| 证券出借违约金 | -   | -  |
| 债券账户维护费 | 18,000.00                                 | 18,000.00                                      |
| 银行汇划费用  | 39,626.25                                 | 36,825.03                                      |
| 律师费     | -   | 2,500.00                                       |
| 合计      | 287,626.25                                | 297,325.03                                     |

#### 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       |
| 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |                  | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31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  | 807,755,797.17              | 3.11             | 314,478,715.03                   | 1.26             |

#### 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。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31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  | 763,179.60                       | 3.35           | 706,891.46 | 12.08            |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31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  | 292,874.04                       | 1.36           | -          | -                |

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等。

#### 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>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------------|-----------------------------|----------------------------------|
|                  | 当期发生的基金应支付的管理费              | 72,745,575.32                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 12,226,632.40               | 13,348,700.02                    |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 60,518,942.92               | 91,442,182.66                    |

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

根据与基金托管人协商一致的《国海富兰克林基金管理有限公司关于调整旗下部分基金费率

并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 8 月 21 日起，支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 12,124,262.64                    | 17,465,147.18                    |

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

根据与基金托管人协商一致的《国海富兰克林基金管理有限公司关于调整旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 8 月 21 日起，支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 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 | -                                | 6,330.66   | 6,330.66 |
| 合计             | -                                | 6,330.66   | 6,330.66 |
| 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 12 月 31 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 | -                                | 0.46       | 0.46     |
| 合计             | -                                | 0.46       | 0.46     |



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% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国海富兰克林基金管理有限公司，再由国海富兰克林基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金份额对应的资产净值 × 0.4% / 当年天数。

#### 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 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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                               | 本期   |
|--------------------------------|----------------------------------|--|
|                                | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日             |
|                                | 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                    | 11,721,566.09                    | -  |
| 报告期间申购/买入总份额                   | 11,590,572.48                    | -  |
| 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                    | 23,312,138.57                    | -  |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例            | 0.96%                            | -  |
| 项目                             | 上年度可比期间                          | 上年度可比期间                                      |
|                                | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 2022 年 12 月 7 日（增设 C 类份额日）至 2022 年 12 月 31 日 |

|                                | 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            | 0.31%         | -          |

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。

#### 7.4.10.5.2 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<br>2023 年 12 月 31 日 |                             | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |                             |
|--|-------------------------|-----------------------------|--------------------------|-----------------------------|
|  | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例（%） | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例（%） |
| 国海富兰克林资产管理（上海）有限公司                             | -                       | -                           | 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<br>(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。

## 7.4.10.6 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<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |              | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022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       |
| 中国农业银行 | 663,328,248.06              | 6,661,198.98 | 971,876,563.63                   | 9,466,804.93 |

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。

## 7.4.10.7 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。

## 7.4.10.8 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。

## 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2023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       | 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 |
| 001239               | 永达股份 | 2023年12月4日  | 6个月 | 新股锁定   | 12.05 | 19.92  | 189      | 2,277.45  | 3,764.88  | -  |
| 001306               | 夏厦精密 | 2023年11月9日  | 6个月 | 新股锁定   | 53.63 | 75.36  | 64       | 3,432.32  | 4,823.04  | -  |
| 001326               | 联域股份 | 2023年11月1日  | 6个月 | 新股锁定   | 41.18 | 48.64  | 99       | 4,076.82  | 4,815.36  | -  |
| 001358               | 兴欣新材 | 2023年12月14日 | 6个月 | 新股锁定   | 41.00 | 44.16  | 87       | 3,567.00  | 3,841.92  | -  |
| 001378               | 德冠新材 | 2023年10月23日 | 6个月 | 新股锁定   | 31.68 | 31.27  | 205      | 6,494.40  | 6,410.35  | -  |
| 300904               | 威力传动 | 2023年8月2日   | 6个月 | 新股锁定   | 35.41 | 61.53  | 304      | 10,764.64 | 18,705.12 | -  |
| 301172               | 君逸   | 2023年       | 6个月 | 新股锁    | 31.33 | 38.16  | 438      | 13,722.54 | 16,714.08 | -  |

|        |      |             |     |      |       |       |       |           |           |  |   |
|--------|------|-------------|-----|------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|---|
|        | 数码   | 7月19日       |     | 定    |       |       |       |           |           |  |   |
| 301202 | 朗威股份 | 2023年6月28日  | 6个月 | 新股锁定 | 25.82 | 31.80 | 306   | 7,900.92  | 9,730.80  |  | - |
| 301251 | 威尔高  | 2023年8月30日  | 6个月 | 新股锁定 | 28.88 | 34.59 | 321   | 9,270.48  | 11,103.39 |  | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023年6月29日  | 6个月 | 新股锁定 | 36.90 | 50.85 | 198   | 7,306.20  | 10,068.30 |  | - |
| 301272 | 英华特  | 2023年7月6日   | 6个月 | 新股锁定 | 51.39 | 53.38 | 173   | 8,890.47  | 9,234.74  |  | - |
| 301291 | 明阳电气 | 2023年6月21日  | 6个月 | 新股锁定 | 38.13 | 28.36 | 1,206 | 45,984.78 | 34,202.16 |  | - |
| 301292 | 海科新源 | 2023年6月29日  | 6个月 | 新股锁定 | 19.99 | 19.35 | 583   | 11,654.17 | 11,281.05 |  | - |
| 301329 | 信音电子 | 2023年7月5日   | 6个月 | 新股锁定 | 21.00 | 22.23 | 458   | 9,618.00  | 10,181.34 |  | - |
| 301348 | 蓝箭电子 | 2023年8月1日   | 6个月 | 新股锁定 | 18.08 | 44.57 | 613   | 11,083.04 | 27,321.41 |  | - |
| 301362 | 民爆光电 | 2023年7月27日  | 6个月 | 新股锁定 | 51.05 | 38.52 | 420   | 21,441.00 | 16,178.40 |  | - |
| 301370 | 国科恒泰 | 2023年7月3日   | 6个月 | 新股锁定 | 13.39 | 16.01 | 1,240 | 16,603.60 | 19,852.40 |  | - |
| 301371 | 敷尔佳  | 2023年7月24日  | 6个月 | 新股锁定 | 55.68 | 37.58 | 564   | 31,403.52 | 21,195.12 |  | - |
| 301372 | 科净源  | 2023年8月3日   | 6个月 | 新股锁定 | 45.00 | 43.59 | 231   | 10,395.00 | 10,069.29 |  | - |
| 301393 | 昊帆生物 | 2023年7月5日   | 6个月 | 新股锁定 | 67.68 | 59.37 | 260   | 17,596.80 | 15,436.20 |  | - |
| 301413 | 安培龙  | 2023年12月11日 | 6个月 | 新股锁定 | 33.25 | 58.19 | 164   | 5,453.00  | 9,543.16  |  | - |
| 301418 | 协昌科技 | 2023年8月10日  | 6个月 | 新股锁定 | 51.88 | 50.20 | 189   | 9,805.32  | 9,487.80  |  | - |
| 301421 | 波长光电 | 2023年8月16日  | 6个月 | 新股锁定 | 29.38 | 59.37 | 332   | 9,754.16  | 19,710.84 |  | - |

|        |      |             |     |      |       |       |     |           |           |   |
|--------|------|-------------|-----|------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 301456 | 盘古智能 | 2023年7月6日   | 6个月 | 新股锁定 | 37.96 | 30.39 | 407 | 15,449.72 | 12,368.73 | - |
| 301459 | 丰茂股份 | 2023年12月6日  | 6个月 | 新股锁定 | 31.90 | 39.84 | 208 | 6,635.20  | 8,286.72  | - |
| 301469 | 恒达新材 | 2023年8月10日  | 6个月 | 新股锁定 | 36.58 | 33.09 | 275 | 10,059.50 | 9,099.75  | - |
| 301486 | 致尚科技 | 2023年6月30日  | 6个月 | 新股锁定 | 57.66 | 47.25 | 482 | 27,792.12 | 22,774.50 | - |
| 301487 | 盟固利  | 2023年8月1日   | 6个月 | 新股锁定 | 5.32  | 40.96 | 867 | 4,612.44  | 35,512.32 | - |
| 301489 | 思泉新材 | 2023年10月16日 | 6个月 | 新股锁定 | 41.66 | 64.11 | 128 | 5,332.48  | 8,206.08  | - |
| 301498 | 乖宝宠物 | 2023年8月9日   | 6个月 | 新股锁定 | 39.99 | 38.81 | 554 | 22,154.46 | 21,500.74 | - |
| 301499 | 维科精密 | 2023年7月13日  | 6个月 | 新股锁定 | 19.50 | 28.93 | 371 | 7,234.50  | 10,733.03 | - |
| 301500 | 飞南资源 | 2023年9月13日  | 6个月 | 新股锁定 | 23.97 | 20.89 | 455 | 10,906.35 | 9,504.95  | - |
| 301505 | 苏州规划 | 2023年7月12日  | 6个月 | 新股锁定 | 26.35 | 35.81 | 194 | 5,111.90  | 6,947.14  | - |
| 301507 | 民生健康 | 2023年8月24日  | 6个月 | 新股锁定 | 10.00 | 15.85 | 851 | 8,510.00  | 13,488.35 | - |
| 301508 | 中机认检 | 2023年11月23日 | 6个月 | 新股锁定 | 16.82 | 26.68 | 419 | 7,047.58  | 11,178.92 | - |
| 301509 | 金凯生科 | 2023年7月26日  | 6个月 | 新股锁定 | 56.56 | 62.23 | 266 | 15,044.96 | 16,553.18 | - |
| 301510 | 固高科技 | 2023年8月4日   | 6个月 | 新股锁定 | 12.00 | 35.01 | 396 | 4,752.00  | 13,863.96 | - |
| 301511 | 德福科技 | 2023年8月8日   | 6个月 | 新股锁定 | 28.00 | 22.67 | 982 | 27,496.00 | 22,261.94 | - |
| 301515 | 港通医疗 | 2023年7月13日  | 6个月 | 新股锁定 | 31.16 | 28.27 | 230 | 7,166.80  | 6,502.10  | - |
| 301516 | 中远   | 2023年       | 6个月 | 新股锁  | 6.87  | 15.51 | 604 | 4,149.48  | 9,368.04  | - |

|        |      |             |     |      |       |       |       |           |           |  |   |
|--------|------|-------------|-----|------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|---|
|        | 通    | 12月1日       |     | 定    |       |       |       |           |           |  |   |
| 301517 | 陕西华达 | 2023年10月9日  | 6个月 | 新股锁定 | 26.87 | 43.69 | 185   | 4,970.95  | 8,082.65  |  | - |
| 301518 | 长华化学 | 2023年7月26日  | 6个月 | 新股锁定 | 25.75 | 23.01 | 385   | 9,913.75  | 8,858.85  |  | - |
| 301519 | 舜禹股份 | 2023年7月19日  | 6个月 | 新股锁定 | 20.93 | 20.21 | 442   | 9,251.06  | 8,932.82  |  | - |
| 301520 | 万邦医药 | 2023年9月18日  | 6个月 | 新股锁定 | 67.88 | 52.74 | 160   | 10,860.80 | 8,438.40  |  | - |
| 301525 | 儒竞科技 | 2023年8月23日  | 6个月 | 新股锁定 | 99.57 | 81.46 | 266   | 26,485.62 | 21,668.36 |  | - |
| 301526 | 国际复材 | 2023年12月19日 | 6个月 | 新股锁定 | 2.66  | 4.45  | 9,723 | 25,863.18 | 43,267.35 |  | - |
| 301528 | 多浦乐  | 2023年8月17日  | 6个月 | 新股锁定 | 71.80 | 68.91 | 148   | 10,626.40 | 10,198.68 |  | - |
| 301529 | 福赛科技 | 2023年8月31日  | 6个月 | 新股锁定 | 36.60 | 37.88 | 182   | 6,661.20  | 6,894.16  |  | - |
| 301548 | 崇德科技 | 2023年9月11日  | 6个月 | 新股锁定 | 66.80 | 58.99 | 136   | 9,084.80  | 8,022.64  |  | - |
| 301550 | 斯菱股份 | 2023年9月6日   | 6个月 | 新股锁定 | 37.56 | 43.57 | 260   | 9,765.60  | 11,328.20 |  | - |
| 301555 | 惠柏新材 | 2023年10月24日 | 6个月 | 新股锁定 | 22.88 | 32.44 | 224   | 5,125.12  | 7,266.56  |  | - |
| 301558 | 三态股份 | 2023年9月21日  | 6个月 | 新股锁定 | 7.33  | 13.40 | 1,458 | 10,687.14 | 19,537.20 |  | - |
| 301559 | 中集环科 | 2023年9月26日  | 6个月 | 新股锁定 | 24.22 | 18.24 | 1,315 | 31,849.30 | 23,985.60 |  | - |
| 301566 | 达利凯普 | 2023年12月22日 | 6个月 | 新股锁定 | 8.90  | 22.14 | 576   | 5,126.40  | 12,752.64 |  | - |
| 301568 | 思泰   | 2023年       | 6个月 | 新股锁  | 23.23 | 35.58 | 246   | 5,714.58  | 8,752.68  |  | - |

|        |      |             |     |      |       |       |       |           |           |  |   |
|--------|------|-------------|-----|------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|---|
|        | 克    | 11月21日      |     | 定    |       |       |       |           |           |  |   |
| 301578 | 辰奕智能 | 2023年12月21日 | 6个月 | 新股锁定 | 48.94 | 68.32 | 118   | 5,774.92  | 8,061.76  |  | - |
| 601083 | 锦江航运 | 2023年11月28日 | 6个月 | 新股锁定 | 11.25 | 11.07 | 1,263 | 14,208.75 | 13,981.41 |  | - |
| 601096 | 宏盛华源 | 2023年12月15日 | 6个月 | 新股锁定 | 1.70  | 4.06  | 3,918 | 6,660.60  | 15,907.08 |  | - |
| 603004 | 鼎龙科技 | 2023年12月20日 | 6个月 | 新股锁定 | 16.80 | 31.19 | 195   | 3,276.00  | 6,082.05  |  | - |
| 603062 | 麦加芯彩 | 2023年10月31日 | 6个月 | 新股锁定 | 58.08 | 57.81 | 126   | 7,318.08  | 7,284.06  |  | - |
| 603075 | 热威股份 | 2023年9月1日   | 6个月 | 新股锁定 | 23.10 | 23.31 | 182   | 4,204.20  | 4,242.42  |  | - |
| 603107 | 上海汽配 | 2023年10月25日 | 6个月 | 新股锁定 | 14.23 | 18.19 | 292   | 4,155.16  | 5,311.48  |  | - |
| 603119 | 浙江荣泰 | 2023年7月21日  | 6个月 | 新股锁定 | 15.32 | 23.87 | 226   | 3,462.32  | 5,394.62  |  | - |
| 603193 | 润本股份 | 2023年10月9日  | 6个月 | 新股锁定 | 17.38 | 16.66 | 303   | 5,266.14  | 5,047.98  |  | - |
| 603231 | 索宝蛋白 | 2023年12月6日  | 6个月 | 新股锁定 | 21.29 | 21.53 | 161   | 3,427.69  | 3,466.33  |  | - |
| 603270 | 金帝股份 | 2023年8月25日  | 6个月 | 新股锁定 | 21.77 | 29.58 | 195   | 4,245.15  | 5,768.10  |  | - |
| 603273 | 天元智能 | 2023年10月16日 | 6个月 | 新股锁定 | 9.50  | 18.97 | 178   | 1,691.00  | 3,376.66  |  | - |
| 603275 | 众辰科技 | 2023年8月16日  | 6个月 | 新股锁定 | 49.97 | 39.70 | 193   | 9,644.21  | 7,662.10  |  | - |
| 603276 | 恒兴新材 | 2023年9月18日  | 6个月 | 新股锁定 | 25.73 | 24.88 | 134   | 3,447.82  | 3,333.92  |  | - |
| 603373 | 安邦   | 2023年       | 6个月 | 新股锁  | 19.10 | 34.75 | 88    | 1,680.80  | 3,058.00  |  | - |

|        |      |            |     |      |       |       |       |            |           |  |   |
|--------|------|------------|-----|------|-------|-------|-------|------------|-----------|--|---|
|        | 护卫   | 12月13日     |     | 定    |       |       |       |            |           |  |   |
| 688450 | 光格科技 | 2023年7月17日 | 6个月 | 新股锁定 | 53.09 | 36.42 | 167   | 8,866.03   | 6,082.14  |  | - |
| 688548 | 广钢气体 | 2023年8月8日  | 6个月 | 新股锁定 | 9.87  | 12.75 | 4,048 | 39,953.76  | 51,612.00 |  | - |
| 688549 | 中巨芯  | 2023年8月30日 | 6个月 | 新股锁定 | 5.18  | 8.09  | 4,294 | 22,242.92  | 34,738.46 |  | - |
| 688563 | 航材股份 | 2023年7月12日 | 6个月 | 新股锁定 | 78.99 | 60.49 | 1,501 | 118,563.99 | 90,795.49 |  | - |
| 688573 | 信宇人  | 2023年8月9日  | 6个月 | 新股锁定 | 23.68 | 28.80 | 285   | 6,748.80   | 8,208.00  |  | - |
| 688582 | 芯动联科 | 2023年6月21日 | 6个月 | 新股锁定 | 26.74 | 38.67 | 648   | 17,327.52  | 25,058.16 |  | - |
| 688591 | 泰凌微  | 2023年8月18日 | 6个月 | 新股锁定 | 24.98 | 28.02 | 681   | 17,011.38  | 19,081.62 |  | - |
| 688592 | 司南导航 | 2023年8月7日  | 6个月 | 新股锁定 | 50.50 | 50.53 | 216   | 10,908.00  | 10,914.48 |  | - |
| 688602 | 康鹏科技 | 2023年7月13日 | 6个月 | 新股锁定 | 8.66  | 11.06 | 1,066 | 9,231.56   | 11,789.96 |  | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023年6月30日 | 6个月 | 新股锁定 | 55.00 | 74.14 | 140   | 7,700.00   | 10,379.60 |  | - |
| 688610 | 埃科光电 | 2023年7月10日 | 6个月 | 新股锁定 | 73.33 | 51.00 | 275   | 20,165.75  | 14,025.00 |  | - |
| 688612 | 威迈斯  | 2023年7月19日 | 6个月 | 新股锁定 | 47.29 | 37.97 | 422   | 19,956.38  | 16,023.34 |  | - |
| 688627 | 精智达  | 2023年7月11日 | 6个月 | 新股锁定 | 46.77 | 87.72 | 222   | 10,382.94  | 19,473.84 |  | - |
| 688646 | 逸飞激光 | 2023年7月21日 | 6个月 | 新股锁定 | 46.80 | 36.07 | 219   | 10,249.20  | 7,899.33  |  | - |
| 688648 | 中邮科技 | 2023年11月6日 | 6个月 | 新股锁定 | 15.18 | 21.43 | 303   | 4,599.54   | 6,493.29  |  | - |



|        |      |             |     |      |        |       |     |           |           |   |
|--------|------|-------------|-----|------|--------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 688651 | 盛邦安全 | 2023年7月19日  | 6个月 | 新股锁定 | 39.90  | 46.05 | 178 | 7,102.20  | 8,196.90  | - |
| 688652 | 京仪装备 | 2023年11月22日 | 6个月 | 新股锁定 | 31.95  | 52.25 | 416 | 13,291.20 | 21,736.00 | - |
| 688653 | 康希通信 | 2023年11月10日 | 6个月 | 新股锁定 | 10.50  | 15.99 | 648 | 6,804.00  | 10,361.52 | - |
| 688657 | 浩辰软件 | 2023年9月25日  | 6个月 | 新股锁定 | 103.40 | 78.23 | 101 | 10,443.40 | 7,901.23  | - |
| 688671 | 碧兴物联 | 2023年8月2日   | 6个月 | 新股锁定 | 36.12  | 34.30 | 226 | 8,163.12  | 7,751.80  | - |
| 688693 | 锆威特  | 2023年8月10日  | 6个月 | 新股锁定 | 40.83  | 43.41 | 178 | 7,267.74  | 7,726.98  | - |
| 688702 | 盛科通信 | 2023年9月6日   | 6个月 | 新股锁定 | 42.66  | 48.18 | 549 | 23,420.34 | 26,450.82 | - |
| 688716 | 中研股份 | 2023年9月13日  | 6个月 | 新股锁定 | 29.66  | 36.39 | 267 | 7,919.22  | 9,716.13  | - |
| 688719 | 爱科赛博 | 2023年9月20日  | 6个月 | 新股锁定 | 69.98  | 60.10 | 194 | 13,576.12 | 11,659.40 | - |
| 688720 | 艾森股份 | 2023年11月29日 | 6个月 | 新股锁定 | 28.03  | 49.84 | 165 | 4,624.95  | 8,223.60  | - |

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

#### 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

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格、合格境外机构投资者托管人资格或其他经管理人评估资质良好的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在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。

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策银行债以外的固定收益品种投资(上期末：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于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于本期末，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。

##### 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限

资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023 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                    | 663,328,248.06 | -     | -     | -                | 663,328,248.06   |
| 结算备付金                   | 8,224,400.62   | -     | -     | -                | 8,224,400.62     |
| 存出保证金                   | 1,290,537.15   | -     | -     | -                | 1,290,537.15     |
| 交易性金融资产                 | -              | -     | -     | 3,335,178,052.23 | 3,335,178,052.23 |
| 应收申购款                   | -              | -     | -     | 1,094,781.54     | 1,094,781.54     |
| 应收清算款                   | -              | -     | -     | 3,973,925.39     | 3,973,925.39     |
| 资产总计                    | 672,843,185.83 | -     | -     | 3,340,246,759.16 | 4,013,089,944.99 |
| 负债                      |                |       |       |                  |                  |

|                          |                |       |       |                   |                  |
|--------------------------|----------------|-------|-------|-------------------|------------------|
| 应付赎回款                    | -              | -     | -     | 64,369,927.72     | 64,369,927.72    |
| 应付管理人报酬                  | -              | -     | -     | 4,237,886.82      | 4,237,886.82     |
| 应付托管费                    | -              | -     | -     | 706,314.49        | 706,314.49       |
| 应付清算款                    | -              | -     | -     | 10,597,968.43     | 10,597,968.43    |
| 应付销售服务费                  | -              | -     | -     | 19,584.60         | 19,584.60        |
| 应交税费                     | -              | -     | -     | 54,000.00         | 54,000.00        |
| 其他负债                     | -              | -     | -     | 6,288,078.87      | 6,288,078.87     |
| 负债总计                     | -              | -     | -     | 86,273,760.93     | 86,273,760.93    |
| 利率敏感度缺口                  | 672,843,185.83 | -     | -     | -3,253,972,998.23 | 3,926,816,184.06 |
| 上年度末<br>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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金无固定收益品种投资（上期末：0.09%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期末：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。本基金持有的证券所面临的其他价格风险来源于单个

证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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<br>2023年12月31日 |                  | 上年度末<br>2022年12月31日 |                  |
|---------------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值               | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 3,335,178,052.23   | 84.93            | 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            | 3,335,178,052.23   | 84.93            | 5,693,208,906.85    | 86.27            |

#### 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：人民币元） |                   |
|               |                      | 本期末（2023年12月31日）            | 上年度末（2022年12月31日） |
|               | 1. 业绩比较基准上升5%        | 184,062,848.06              | 298,843,637.97    |
| 2. 业绩比较基准下降5% | -184,062,848.06      | -298,843,637.97             |                   |

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 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。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 3,333,877,966.78        | 5,641,366,977.51         |
| 第二层次          | -                       | -                        |
| 第三层次          | 1,300,085.45            | 51,841,929.34            |
| 合计            | 3,335,178,052.23        | 5,693,208,906.85         |

#### 7.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |               |               |
|------|--|---------------|---------------|
|      | 交易性金融资产                                |               | 合计            |
|      | 债券投资                                   | 股票投资          |               |
| 期初余额 | -                                      | 51,841,929.34 | 51,841,929.34 |

|  |                                  |               |               |
|--|----------------------------------|---------------|---------------|
| 当期购买                                       | -                                | -             | -             |
| 当期出售/结算                                    | -                                | -             | -             |
| 转入第三层次                                     | -                                | 2,698,578.63  | 2,698,578.63  |
| 转出第三层次                                     | -                                | 49,120,756.55 | 49,120,756.55 |
| 当期利得或损失总额                                  | -                                | -4,119,665.97 | -4,119,665.97 |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -                                | -4,119,665.97 | -4,119,665.97 |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -                                | -             | -             |
| 期末余额                                       | -                                | 1,300,085.45  | 1,300,085.45  |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -                                | 145,165.53    | 145,165.53    |
| 项目   | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |               |               |
|  | 交易性金融资产                          |               | 合计            |
|  | 债券投资                             | 股票投资          |               |
| 期初余额                                       | -                                | 3,135,829.90  | 3,135,829.90  |
| 当期购买                                       | -                                | 49,999,996.80 | 49,999,996.80 |
| 当期出售/结算                                    | -                                | -             | -             |
| 转入第三层次                                     | -                                | 3,434,409.63  | 3,434,409.63  |
| 转出第三层次                                     | -                                | 4,858,388.73  | 4,858,388.73  |
| 当期利得或损失总额                                  | -                                | 130,081.74    | 130,081.74    |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -                                | 130,081.74    | 130,081.74    |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -                                | -             | -             |
| 期末余额                                       | -                                | 51,841,929.34 | 51,841,929.34 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -                                | 103,526.44    | 103,526.44    |

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。



## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

| 项目  | 本期末公允价值       | 采用的估值技术            | 不可观察输入值 |               |            |
|-----|---------------|--------------------|---------|---------------|------------|
|     |               |                    | 名称      | 范围/加权平均值      | 与公允价值之间的关系 |
| 受限股 | 1,300,085.45  | 平均价格<br>亚式期权<br>模型 | 预期波动率   | 0.1962-2.1988 | 负相关        |
| 项目  | 上年度末公允价值      | 采用的估值技术            | 不可观察输入值 |               |            |
|     |               |                    | 名称      | 范围/加权平均值      | 与公允价值之间的关系 |
| 受限股 | 51,841,929.34 | 平均价格<br>亚式期权<br>模型 | 预期波动率   | 0.2063-2.4756 | 负相关        |

## 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 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（2022 年 12 月 31 日：同）。

## 7.4.14.4 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。

## 7.4.15 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。

## § 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     | 3,335,178,052.23 | 83.11         |
|    | 其中：股票    | 3,335,178,052.23 | 83.11         |
| 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      | 671,552,648.68   | 16.73  |
| 8 | 其他各项资产            | 6,359,244.08     | 0.16   |
| 9 | 合计                | 4,013,089,944.99 | 100.00 |

## 8.2 报告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（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -                | -            |
| B  | 采矿业              | 539,690,993.32   | 13.74        |
| C  | 制造业              | 2,398,766,243.67 | 61.09        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 53,217,160.56    | 1.36         |
| E  | 建筑业              | 48,224,499.20    | 1.23         |
| F  | 批发和零售业           | 39,389.60        | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 52,286,125.41    | 1.33         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 96,493,123.75    | 2.46         |
| J  | 金融业              | 115,938,987.65   | 2.95         |
| K  | 房地产业             | -                | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,058.00         | 0.00         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 18,151,938.96    | 0.46         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 19,002.11        | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | 12,347,530.00    | 0.31         |
| Q  | 卫生和社会工作          | -                | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -                | -            |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 3,335,178,052.23 | 84.93        |

### 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（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 002475 | 立讯精密 | 5,418,562 | 186,669,460.90 | 4.75         |
| 2  | 002050 | 三花智控 | 3,651,592 | 107,356,804.80 | 2.73         |

|    |        |      |            |                |      |
|----|--------|------|------------|----------------|------|
| 3  | 601899 | 紫金矿业 | 8,570,101  | 106,783,458.46 | 2.72 |
| 4  | 603979 | 金诚信  | 2,705,400  | 102,155,904.00 | 2.60 |
| 5  | 300308 | 中际旭创 | 842,700    | 95,149,257.00  | 2.42 |
| 6  | 600276 | 恒瑞医药 | 1,998,890  | 90,409,794.70  | 2.30 |
| 7  | 600938 | 中国海油 | 3,896,392  | 81,707,340.24  | 2.08 |
| 8  | 002463 | 沪电股份 | 3,453,337  | 76,387,814.44  | 1.95 |
| 9  | 601699 | 潞安环能 | 3,273,310  | 71,718,222.10  | 1.83 |
| 10 | 688008 | 澜起科技 | 1,200,818  | 70,560,065.68  | 1.80 |
| 11 | 002432 | 九安医疗 | 1,779,634  | 67,038,812.78  | 1.71 |
| 12 | 300408 | 三环集团 | 2,275,455  | 67,012,149.75  | 1.71 |
| 13 | 601225 | 陕西煤业 | 3,155,476  | 65,917,893.64  | 1.68 |
| 14 | 002353 | 杰瑞股份 | 2,222,600  | 62,477,286.00  | 1.59 |
| 15 | 003031 | 中瓷电子 | 700,529    | 61,807,673.67  | 1.57 |
| 16 | 300258 | 精锻科技 | 4,652,600  | 60,111,592.00  | 1.53 |
| 17 | 600519 | 贵州茅台 | 34,509     | 59,562,534.00  | 1.52 |
| 18 | 300750 | 宁德时代 | 355,500    | 58,038,930.00  | 1.48 |
| 19 | 603606 | 东方电缆 | 1,349,876  | 57,707,199.00  | 1.47 |
| 20 | 300274 | 阳光电源 | 647,800    | 56,740,802.00  | 1.44 |
| 21 | 600900 | 长江电力 | 2,280,084  | 53,217,160.56  | 1.36 |
| 22 | 002230 | 科大讯飞 | 1,142,200  | 52,975,236.00  | 1.35 |
| 23 | 600026 | 中远海能 | 4,270,600  | 52,272,144.00  | 1.33 |
| 24 | 600809 | 山西汾酒 | 220,726    | 50,928,109.98  | 1.30 |
| 25 | 002318 | 久立特材 | 2,537,077  | 50,437,090.76  | 1.28 |
| 26 | 601138 | 工业富联 | 3,209,100  | 48,521,592.00  | 1.24 |
| 27 | 000338 | 潍柴动力 | 3,537,932  | 48,292,771.80  | 1.23 |
| 28 | 002270 | 华明装备 | 3,398,894  | 47,992,383.28  | 1.22 |
| 29 | 600282 | 南钢股份 | 12,812,200 | 47,405,140.00  | 1.21 |
| 30 | 601088 | 中国神华 | 1,467,806  | 46,015,718.10  | 1.17 |
| 31 | 600566 | 济川药业 | 1,441,819  | 45,316,371.17  | 1.15 |
| 32 | 601688 | 华泰证券 | 3,226,475  | 45,009,326.25  | 1.15 |
| 33 | 601233 | 桐昆股份 | 2,914,131  | 44,090,802.03  | 1.12 |
| 34 | 300037 | 新宙邦  | 865,952    | 40,959,529.60  | 1.04 |
| 35 | 002271 | 东方雨虹 | 2,122,570  | 40,753,344.00  | 1.04 |
| 36 | 601998 | 中信银行 | 7,666,085  | 40,553,589.65  | 1.03 |
| 37 | 000708 | 中信特钢 | 2,841,428  | 39,893,649.12  | 1.02 |
| 38 | 300433 | 蓝思科技 | 2,877,700  | 37,985,640.00  | 0.97 |
| 39 | 601799 | 星宇股份 | 275,500    | 36,120,805.00  | 0.92 |
| 40 | 600522 | 中天科技 | 2,815,100  | 35,160,599.00  | 0.90 |
| 41 | 600583 | 海油工程 | 5,848,900  | 34,742,466.00  | 0.88 |
| 42 | 688169 | 石头科技 | 121,731    | 34,443,786.45  | 0.88 |
| 43 | 002738 | 中矿资源 | 915,060    | 34,140,888.60  | 0.87 |
| 44 | 300982 | 苏文电能 | 974,080    | 31,988,787.20  | 0.81 |
| 45 | 300661 | 圣邦股份 | 353,380    | 31,454,353.80  | 0.80 |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 46 | 003006 | 百亚股份 | 2,016,950 | 30,576,962.00 | 0.78 |
| 47 | 601658 | 邮储银行 | 6,983,005 | 30,376,071.75 | 0.77 |
| 48 | 688617 | 惠泰医疗 | 75,842    | 29,464,617.00 | 0.75 |
| 49 | 688012 | 中微公司 | 189,682   | 29,135,155.20 | 0.74 |
| 50 | 688041 | 海光信息 | 402,176   | 28,546,452.48 | 0.73 |
| 51 | 688378 | 奥来德  | 599,020   | 28,357,606.80 | 0.72 |
| 52 | 002252 | 上海莱士 | 3,536,400 | 28,291,200.00 | 0.72 |
| 53 | 300502 | 新易盛  | 541,476   | 26,705,596.32 | 0.68 |
| 54 | 600406 | 国电南瑞 | 1,182,733 | 26,398,600.56 | 0.67 |
| 55 | 603605 | 珀莱雅  | 265,308   | 26,371,615.20 | 0.67 |
| 56 | 600761 | 安徽合力 | 1,441,200 | 26,244,252.00 | 0.67 |
| 57 | 603296 | 华勤技术 | 320,500   | 25,604,745.00 | 0.65 |
| 58 | 300394 | 天孚通信 | 271,300   | 24,829,376.00 | 0.63 |
| 59 | 688236 | 春立医疗 | 879,589   | 23,133,190.70 | 0.59 |
| 60 | 600129 | 太极集团 | 497,605   | 23,118,728.30 | 0.59 |
| 61 | 600150 | 中国船舶 | 679,400   | 20,001,536.00 | 0.51 |
| 62 | 603786 | 科博达  | 279,400   | 19,937,984.00 | 0.51 |
| 63 | 300760 | 迈瑞医疗 | 63,000    | 18,307,800.00 | 0.47 |
| 64 | 688475 | 萤石网络 | 407,722   | 18,306,717.80 | 0.47 |
| 65 | 688621 | 阳光诺和 | 259,862   | 18,125,374.50 | 0.46 |
| 66 | 603556 | 海兴电力 | 611,000   | 17,737,330.00 | 0.45 |
| 67 | 600348 | 华阳股份 | 1,762,000 | 17,197,120.00 | 0.44 |
| 68 | 600941 | 中国移动 | 171,492   | 17,060,024.16 | 0.43 |
| 69 | 600820 | 隧道股份 | 2,818,700 | 16,235,712.00 | 0.41 |
| 70 | 601808 | 中海油服 | 920,169   | 13,452,870.78 | 0.34 |
| 71 | 300782 | 卓胜微  | 93,700    | 13,211,700.00 | 0.34 |
| 72 | 002821 | 凯莱英  | 112,240   | 13,031,064.00 | 0.33 |
| 73 | 603305 | 旭升集团 | 642,400   | 12,674,552.00 | 0.32 |
| 74 | 000526 | 学大教育 | 247,000   | 12,347,530.00 | 0.31 |
| 75 | 605117 | 德业股份 | 135,073   | 11,332,624.70 | 0.29 |
| 76 | 300482 | 万孚生物 | 366,747   | 11,064,756.99 | 0.28 |
| 77 | 688548 | 广钢气体 | 40,476    | 527,361.68    | 0.01 |
| 78 | 301566 | 达利凯普 | 5,755     | 162,891.85    | 0.00 |
| 79 | 688563 | 航材股份 | 1,501     | 90,795.49     | 0.00 |
| 80 | 301578 | 辰奕智能 | 1,175     | 89,662.16     | 0.00 |
| 81 | 301526 | 国际复材 | 9,723     | 43,267.35     | 0.00 |
| 82 | 301487 | 盟固利  | 867       | 35,512.32     | 0.00 |
| 83 | 688549 | 中巨芯  | 4,294     | 34,738.46     | 0.00 |
| 84 | 301291 | 明阳电气 | 1,206     | 34,202.16     | 0.00 |
| 85 | 301348 | 蓝箭电子 | 613       | 27,321.41     | 0.00 |
| 86 | 688702 | 盛科通信 | 549       | 26,450.82     | 0.00 |
| 87 | 688582 | 芯动联科 | 648       | 25,058.16     | 0.00 |
| 88 | 301559 | 中集环科 | 1,315     | 23,985.60     | 0.00 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 89  | 301486 | 致尚科技 | 482   | 22,774.50 | 0.00 |
| 90  | 301511 | 德福科技 | 982   | 22,261.94 | 0.00 |
| 91  | 688652 | 京仪装备 | 416   | 21,736.00 | 0.00 |
| 92  | 301525 | 儒竞科技 | 266   | 21,668.36 | 0.00 |
| 93  | 301498 | 乖宝宠物 | 554   | 21,500.74 | 0.00 |
| 94  | 301371 | 敷尔佳  | 564   | 21,195.12 | 0.00 |
| 95  | 301370 | 国科恒泰 | 1,240 | 19,852.40 | 0.00 |
| 96  | 301421 | 波长光电 | 332   | 19,710.84 | 0.00 |
| 97  | 301558 | 三态股份 | 1,458 | 19,537.20 | 0.00 |
| 98  | 688627 | 精智达  | 222   | 19,473.84 | 0.00 |
| 99  | 688591 | 泰凌微  | 681   | 19,081.62 | 0.00 |
| 100 | 300904 | 威力传动 | 304   | 18,705.12 | 0.00 |
| 101 | 301172 | 君逸数码 | 438   | 16,714.08 | 0.00 |
| 102 | 301509 | 金凯生科 | 266   | 16,553.18 | 0.00 |
| 103 | 301362 | 民爆光电 | 420   | 16,178.40 | 0.00 |
| 104 | 688612 | 威迈斯  | 422   | 16,023.34 | 0.00 |
| 105 | 601096 | 宏盛华源 | 3,918 | 15,907.08 | 0.00 |
| 106 | 301393 | 昊帆生物 | 260   | 15,436.20 | 0.00 |
| 107 | 688610 | 埃科光电 | 275   | 14,025.00 | 0.00 |
| 108 | 601083 | 锦江航运 | 1,263 | 13,981.41 | 0.00 |
| 109 | 301510 | 固高科技 | 396   | 13,863.96 | 0.00 |
| 110 | 301507 | 民生健康 | 851   | 13,488.35 | 0.00 |
| 111 | 301456 | 盘古智能 | 407   | 12,368.73 | 0.00 |
| 112 | 688602 | 康鹏科技 | 1,066 | 11,789.96 | 0.00 |
| 113 | 688719 | 爱科赛博 | 194   | 11,659.40 | 0.00 |
| 114 | 301550 | 斯菱股份 | 260   | 11,328.20 | 0.00 |
| 115 | 301292 | 海科新源 | 583   | 11,281.05 | 0.00 |
| 116 | 301508 | 中机认检 | 419   | 11,178.92 | 0.00 |
| 117 | 301251 | 威尔高  | 321   | 11,103.39 | 0.00 |
| 118 | 688592 | 司南导航 | 216   | 10,914.48 | 0.00 |
| 119 | 301499 | 维科精密 | 371   | 10,733.03 | 0.00 |
| 120 | 688603 | 天承科技 | 140   | 10,379.60 | 0.00 |
| 121 | 688653 | 康希通信 | 648   | 10,361.52 | 0.00 |
| 122 | 301528 | 多浦乐  | 148   | 10,198.68 | 0.00 |
| 123 | 301329 | 信音电子 | 458   | 10,181.34 | 0.00 |
| 124 | 301372 | 科净源  | 231   | 10,069.29 | 0.00 |
| 125 | 301261 | 恒工精密 | 198   | 10,068.30 | 0.00 |
| 126 | 301202 | 朗威股份 | 306   | 9,730.80  | 0.00 |
| 127 | 688716 | 中研股份 | 267   | 9,716.13  | 0.00 |
| 128 | 301413 | 安培龙  | 164   | 9,543.16  | 0.00 |
| 129 | 301500 | 飞南资源 | 455   | 9,504.95  | 0.00 |
| 130 | 301418 | 协昌科技 | 189   | 9,487.80  | 0.00 |
| 131 | 301516 | 中远通  | 604   | 9,368.04  | 0.00 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 132 | 301272 | 英华特  | 173 | 9,234.74 | 0.00 |
| 133 | 301469 | 恒达新材 | 275 | 9,099.75 | 0.00 |
| 134 | 301519 | 舜禹股份 | 442 | 8,932.82 | 0.00 |
| 135 | 301518 | 长华化学 | 385 | 8,858.85 | 0.00 |
| 136 | 301568 | 思泰克  | 246 | 8,752.68 | 0.00 |
| 137 | 301520 | 万邦医药 | 160 | 8,438.40 | 0.00 |
| 138 | 301459 | 丰茂股份 | 208 | 8,286.72 | 0.00 |
| 139 | 688720 | 艾森股份 | 165 | 8,223.60 | 0.00 |
| 140 | 688573 | 信宇人  | 285 | 8,208.00 | 0.00 |
| 141 | 301489 | 思泉新材 | 128 | 8,206.08 | 0.00 |
| 142 | 688651 | 盛邦安全 | 178 | 8,196.90 | 0.00 |
| 143 | 301517 | 陕西华达 | 185 | 8,082.65 | 0.00 |
| 144 | 301548 | 崇德科技 | 136 | 8,022.64 | 0.00 |
| 145 | 688657 | 浩辰软件 | 101 | 7,901.23 | 0.00 |
| 146 | 688646 | 逸飞激光 | 219 | 7,899.33 | 0.00 |
| 147 | 688671 | 碧兴物联 | 226 | 7,751.80 | 0.00 |
| 148 | 688693 | 锆威特  | 178 | 7,726.98 | 0.00 |
| 149 | 603275 | 众辰科技 | 193 | 7,662.10 | 0.00 |
| 150 | 688429 | 时创能源 | 346 | 7,331.74 | 0.00 |
| 151 | 603062 | 麦加芯彩 | 126 | 7,284.06 | 0.00 |
| 152 | 301555 | 惠柏新材 | 224 | 7,266.56 | 0.00 |
| 153 | 301505 | 苏州规划 | 194 | 6,947.14 | 0.00 |
| 154 | 301529 | 福赛科技 | 182 | 6,894.16 | 0.00 |
| 155 | 301515 | 港通医疗 | 230 | 6,502.10 | 0.00 |
| 156 | 688648 | 中邮科技 | 303 | 6,493.29 | 0.00 |
| 157 | 001378 | 德冠新材 | 205 | 6,410.35 | 0.00 |
| 158 | 688450 | 光格科技 | 167 | 6,082.14 | 0.00 |
| 159 | 603004 | 鼎龙科技 | 195 | 6,082.05 | 0.00 |
| 160 | 603270 | 金帝股份 | 195 | 5,768.10 | 0.00 |
| 161 | 603119 | 浙江荣泰 | 226 | 5,394.62 | 0.00 |
| 162 | 603107 | 上海汽配 | 292 | 5,311.48 | 0.00 |
| 163 | 603193 | 润本股份 | 303 | 5,047.98 | 0.00 |
| 164 | 001306 | 夏厦精密 | 64  | 4,823.04 | 0.00 |
| 165 | 001326 | 联域股份 | 99  | 4,815.36 | 0.00 |
| 166 | 603075 | 热威股份 | 182 | 4,242.42 | 0.00 |
| 167 | 001358 | 兴欣新材 | 87  | 3,841.92 | 0.00 |
| 168 | 001239 | 永达股份 | 189 | 3,764.88 | 0.00 |
| 169 | 603231 | 索宝蛋白 | 161 | 3,466.33 | 0.00 |
| 170 | 603273 | 天元智能 | 178 | 3,376.66 | 0.00 |
| 171 | 603276 | 恒兴新材 | 134 | 3,333.92 | 0.00 |
| 172 | 603373 | 安邦护卫 | 88  | 3,058.00 | 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  | 600276 | 恒瑞医药 | 197,845,215.79 | 3.00           |
| 2  | 300308 | 中际旭创 | 181,847,302.87 | 2.76           |
| 3  | 600941 | 中国移动 | 178,140,181.15 | 2.70           |
| 4  | 000063 | 中兴通讯 | 173,935,440.18 | 2.64           |
| 5  | 002230 | 科大讯飞 | 169,892,941.32 | 2.57           |
| 6  | 601699 | 潞安环能 | 165,311,239.03 | 2.50           |
| 7  | 300750 | 宁德时代 | 163,971,566.86 | 2.48           |
| 8  | 002463 | 沪电股份 | 157,639,558.80 | 2.39           |
| 9  | 002920 | 德赛西威 | 157,448,680.55 | 2.39           |
| 10 | 000425 | 徐工机械 | 154,692,407.54 | 2.34           |
| 11 | 601688 | 华泰证券 | 148,208,406.69 | 2.25           |
| 12 | 600702 | 舍得酒业 | 144,573,042.24 | 2.19           |
| 13 | 601899 | 紫金矿业 | 142,099,468.39 | 2.15           |
| 14 | 601998 | 中信银行 | 133,641,802.92 | 2.03           |
| 15 | 688008 | 澜起科技 | 130,508,513.51 | 1.98           |
| 16 | 003031 | 中瓷电子 | 127,068,299.35 | 1.93           |
| 17 | 600809 | 山西汾酒 | 126,798,282.72 | 1.92           |
| 18 | 601728 | 中国电信 | 126,143,666.80 | 1.91           |
| 19 | 688012 | 中微公司 | 122,597,851.18 | 1.86           |
| 20 | 601225 | 陕西煤业 | 120,761,122.57 | 1.83           |

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  | 300308 | 中际旭创 | 269,939,298.31 | 4.09           |
| 2  | 002050 | 三花智控 | 247,059,636.79 | 3.74           |
| 3  | 300750 | 宁德时代 | 243,551,322.42 | 3.69           |
| 4  | 600309 | 万华化学 | 240,544,631.96 | 3.64           |
| 5  | 300274 | 阳光电源 | 234,135,527.44 | 3.55           |
| 6  | 601100 | 恒立液压 | 226,936,069.17 | 3.44           |
| 7  | 601658 | 邮储银行 | 221,724,664.00 | 3.36           |
| 8  | 688111 | 金山办公 | 202,475,150.43 | 3.07           |
| 9  | 600256 | 广汇能源 | 195,867,957.94 | 2.97           |
| 10 | 002142 | 宁波银行 | 182,344,061.59 | 2.76           |
| 11 | 600941 | 中国移动 | 170,845,884.99 | 2.59           |
| 12 | 002508 | 老板电器 | 169,972,371.31 | 2.58           |

|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 13 | 601318 | 中国平安 | 169,752,535.82 | 2.57 |
| 14 | 002648 | 卫星化学 | 162,931,032.94 | 2.47 |
| 15 | 000063 | 中兴通讯 | 157,690,296.00 | 2.39 |
| 16 | 600519 | 贵州茅台 | 151,749,189.36 | 2.30 |
| 17 | 002472 | 双环传动 | 149,264,196.32 | 2.26 |
| 18 | 300059 | 东方财富 | 144,947,204.90 | 2.20 |
| 19 | 002920 | 德赛西威 | 144,803,155.38 | 2.19 |
| 20 | 300573 | 兴齐眼药 | 144,681,346.49 | 2.19 |
| 21 | 000425 | 徐工机械 | 143,980,288.93 | 2.18 |
| 22 | 600406 | 国电南瑞 | 143,567,741.58 | 2.18 |
| 23 | 002487 | 大金重工 | 142,828,549.24 | 2.16 |
| 24 | 601012 | 隆基绿能 | 142,664,729.56 | 2.16 |
| 25 | 002230 | 科大讯飞 | 133,991,057.41 | 2.03 |

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

#### 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 | 11,981,398,502.60 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 14,034,321,672.37 |

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

#### 8.5 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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

## 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，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。

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 | 1,290,537.15 |
| 2  | 应收清算款 | 3,973,925.39 |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 1,094,781.54 |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 6,359,244.08 |

### 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换债券。

### 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 | 户均持有的基 | 持有人结构 |
|------|------|--------|-------|
|------|------|--------|-------|

|            | 数（户）      | 金份额      | 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 | 1,003,016 | 2,425.09 | 1,527,661,396.13 | 62.80     | 904,745,944.51 | 37.20     |
| 国富深化价值混合 C | 6,229     | 5,945.70 | 20,695,496.37    | 55.88     | 16,340,264.24  | 44.12     |
| 合计         | 1,009,245 | 2,446.82 | 1,548,356,892.50 | 62.70     | 921,086,208.75 | 37.30     |

### 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 | 国富深化价值混合 A | 1,436,972.49 | 0.059076    |
|                  | 国富深化价值混合 C | 558.47       | 0.001508    |
|                  | 合计         | 1,437,530.96 | 0.058213    |

### 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 | 50~100            |
|                                | 国富深化价值混合 C | 0                 |
|                                | 合计         | 50~100            |

## § 10 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<br>（2008 年 7 月 3 日）<br>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   | 846,865,732.45   | 57,658,363.71 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,203,462,495.90 | 25,683,794.83 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                | -             |
| 本报告期期末基金份额总额  | 2,432,407,340.64 | 37,035,760.61 |

## § 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

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。

### 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 110,000.00 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

#### 11.6.1 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稽查或处罚的情况。

#### 11.6.2 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。

### 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 (%) |    |
| 中泰证券   | 2      | 3,035,669,54<br>3.76 | 11.68            | 2,697,201.52 | 11.85          | -  |
| 西藏东财证券 | 2      | 2,694,334,05<br>9.99 | 10.37            | 1,979,302.60 | 8.69           | -  |
| 天风证券   | 1      | 2,320,171,92<br>9.96 | 8.93             | 1,700,166.44 | 7.47           | -  |
| 中金公司   | 2      | 2,126,579,83<br>9.66 | 8.18             | 1,991,157.41 | 8.74           | -  |
| 华安证券   | 1      | 1,942,068,80<br>6.63 | 7.47             | 1,811,667.68 | 7.96           | -  |
| 海通证券   | 1      | 1,940,525,87<br>8.61 | 7.47             | 1,816,413.91 | 7.98           | -  |
| 中信证券   | 3      | 1,878,226,31<br>3.06 | 7.23             | 1,765,244.90 | 7.75           | -  |
| 国盛证券   | 1      | 1,776,970,96<br>3.08 | 6.84             | 1,309,335.16 | 5.75           | -  |
| 申万宏源   | 1      | 1,209,618,34<br>9.65 | 4.65             | 1,137,199.33 | 4.99           | -  |
| 国信证券   | 1      | 1,016,228,64<br>5.04 | 3.91             | 949,888.42   | 4.17           | -  |
| 国泰君安   | 1      | 977,448,223.<br>09   | 3.76             | 915,213.30   | 4.02           | -  |
| 方正证券   | 1      | 829,744,167.<br>31   | 3.19             | 776,695.89   | 3.41           | -  |
| 国海证券   | 2      | 807,755,797.<br>17   | 3.11             | 763,179.60   | 3.35           | -  |
| 兴业证券   | 1      | 781,953,323.<br>40   | 3.01             | 734,195.89   | 3.22           | -  |
| 国投证券   | 2      | 505,044,810.<br>98   | 1.94             | 473,023.56   | 2.08           | -  |
| 东兴证券   | 1      | 453,345,151.<br>52   | 1.74             | 423,599.43   | 1.86           | -  |
| 第一创业   | 1      | 381,893,284.<br>55   | 1.47             | 361,232.84   | 1.59           | -  |
| 中信建投   | 1      | 372,663,588.<br>62   | 1.43             | 347,052.36   | 1.52           | -  |
| 招商证券   | 1      | 353,689,916.<br>61   | 1.36             | 331,578.73   | 1.46           | -  |
| 高盛中国   | 1      | 276,633,574.<br>15   | 1.06             | 257,630.03   | 1.13           | -  |

|      |   |                |      |            |      |   |
|------|---|----------------|------|------------|------|---|
| 山西证券 | 2 | 235,785,840.88 | 0.91 | 175,872.45 | 0.77 | - |
| 首创证券 | 1 | 72,857,519.44  | 0.28 | 53,283.09  | 0.23 | - |
| 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，山西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，安信证券已更名为国投证券。

#### 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(%) |
| 中泰证券     | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 西藏东方财富证券 | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 天风证券     | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 中金公司     | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 华安证券     | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 海通证券     | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 中信证券     | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国盛证券     | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 申万宏源     | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国信证      | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 券    |   |   |   |   |   |   |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 高盛中国 | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 首创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - | - |

### 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  | 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业股票的 | 中国证监会规定报刊及规定网站 | 2023 年 01 月 04 日 |

|    |   |                |                  |
|----|---|----------------|------------------|
|    | 公告  |                |                  |
| 2  | 富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告  | 中国证监会规定报刊及规定网站 | 2023 年 01 月 20 日 |
| 3  | 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 01 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 02 月 01 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 02 月 08 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 02 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 03 月 02 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 03 月 03 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 03 月 08 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 03 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开通转换、定期定额投资业务及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 03 月 15 日 |
| 12 | 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 03 月 31 日 |
| 13 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下  | 中国证监会规定报刊及     | 2023 年 03 月 31 日 |

|    |   |                |                  |
|----|---|----------------|------------------|
|    | 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                                  | 规定网站           |                  |
| 14 | 国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告                                       | 中国证监会规定报刊及规定网站 | 2023 年 03 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 04 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 1 季度报告                                  | 中国证监会规定报刊及规定网站 | 2023 年 04 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 04 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 06 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 06 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 06 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 06 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 06 月 30 日 |
| 23 | 关于增加兴业银行股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换业务、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 07 月 11 日 |
| 24 | 关于增加开源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 07 月 15 日 |
| 25 | 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 07 月 21 日 |
| 26 | 富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告                                  | 中国证监会规定报刊及规定网站 | 2023 年 07 月 21 日 |



|    |   |                |                  |
|----|---|----------------|------------------|
| 27 | 关于增加鼎信汇金（北京）投资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 08 月 02 日 |
| 28 | 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 08 月 19 日 |
| 29 | 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 08 月 19 日 |
| 30 | 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 2 号)                                    | 中国证监会规定报刊及规定网站 | 2023 年 08 月 19 日 |
| 31 | 富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金基金合同   | 中国证监会规定报刊及规定网站 | 2023 年 08 月 19 日 |
| 32 | 国海富兰克林基金管理有限公司关于调整旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告                                 | 中国证监会规定报刊及规定网站 | 2023 年 08 月 19 日 |
| 33 | 富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金托管协议   | 中国证监会规定报刊及规定网站 | 2023 年 08 月 19 日 |
| 34 | 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   | 中国证监会规定报刊及规定网站 | 2023 年 08 月 31 日 |
| 35 | 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  | 中国证监会规定报刊及规定网站 | 2023 年 08 月 31 日 |
| 36 | 关于增加博时财富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 09 月 01 日 |
| 37 | 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 09 月 16 日 |
| 38 | 关于增加上海陆享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 10 月 17 日 |
| 39 | 关于增加华宝证券有限责任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 10 月 19 日 |
| 40 | 富兰克林国海深化价值混合型证券投资   | 中国证监会规定报刊及     | 2023 年 10 月 25 日 |

|    |   |                |                  |
|----|---|----------------|------------------|
|    | 资基金 2023 年第 3 季度报告  | 规定网站           |                  |
| 41 | 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 10 月 25 日 |
| 42 | 关于增加招商银行股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换、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 11 月 21 日 |
| 43 | 关于增加中证金牛（北京）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 11 月 22 日 |
| 44 | 关于增加上海中欧财富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 11 月 22 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 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。

## § 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。

### 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](http://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](http://www.ftsfund.com) 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

2024 年 3 月 30 日