

富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基  
金  
2022 年年度报告

2022 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 5 月 31 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 .....	11
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真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	15
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（基金净值）变动表 .....	20
7.4 报表附注 .....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	48

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 .....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	54
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 .....	54
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 .....	54
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 .....	54
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 .....	54
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	54
8.11 投资组合报告附注 .....	55
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
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 .....	56
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
11.4 基金投资策略的改变 .....	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
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 .....	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
11.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
12.1 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
13.1 备查文件目录 .....	60
13.2 存放地点 .....	60
13.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金	
基金简称	国富鑫享价值一年封闭混合	
基金主代码	014151	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 5 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	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	304,361,478.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国富鑫享价值一年封闭混合 A	国富鑫享价值一年封闭混合 C
下属分级基金的交易代码	014151	014152
报告期末下属分级基金的份额总额	225,315,270.95 份	79,046,207.06 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金将通过宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度调整基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。在股票投资上，本基金遵循价值投资思路，通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质公司，臻选出基本面良好、盈利能力突出、增长稳定持续的个股构建股票投资组合。在债券投资上，本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用 风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。 本基金也可进行资产支持证券、金融衍生品及存托凭证投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×30%
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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	储丽莉	龚小武
	联系电话	021-3855 5555	021-52629999-212056
	电子邮箱	service@ftsfund.com	gongxiaowu@cib.com.cn

客户服务电话	400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555	95561
传真	021-6888 3050	021-6215 9217
注册地址	广西南宁市西乡塘区总部路 1 号 中国-东盟科技企业孵化基地一期 A-13 栋三层 306 号房	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
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	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	200120	200120
法定代表人	吴显玲	吕家进

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	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	2022 年 5 月 31 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日	
	国富鑫享价值一年封闭混合 A	国富鑫享价值一年封闭混合 C
本期已实现收益	-9,624,491.10	-3,639,007.67
本期利润	-15,816,617.49	-5,807,051.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0702	-0.0735
本期加权平均净值利润率	-7.16%	-7.50%
本期基金份额净值增长率	-7.02%	-7.35%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	
期末可供分配利润	-15,816,617.49	-5,807,051.08

期末可供分配基金份额利润	-0.0702	-0.0735
期末基金资产净值	209,498,653.46	73,239,155.98
期末基金份额净值	0.9298	0.9265
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-7.02%	-7.35%

注：

- 1、本基金合同生效日为 2022 年 5 月 31 日。本基金 2022 年度主要财务指标的计算期间为 2022 年 5 月 31 日至 2022 年 12 月 31 日。
- 2、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》。
- 3、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）扣除相关费用和预期信用损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 4、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）。
- 5、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国富鑫享价值一年封闭混合 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	-2.95%	0.67%	3.79%	1.06%	-6.74%	-0.39%
过去六个月	-8.34%	0.58%	-8.56%	0.89%	0.22%	-0.31%
自基金合同生效起至今	-7.02%	0.54%	-2.90%	0.88%	-4.12%	-0.34%

国富鑫享价值一年封闭混合 C

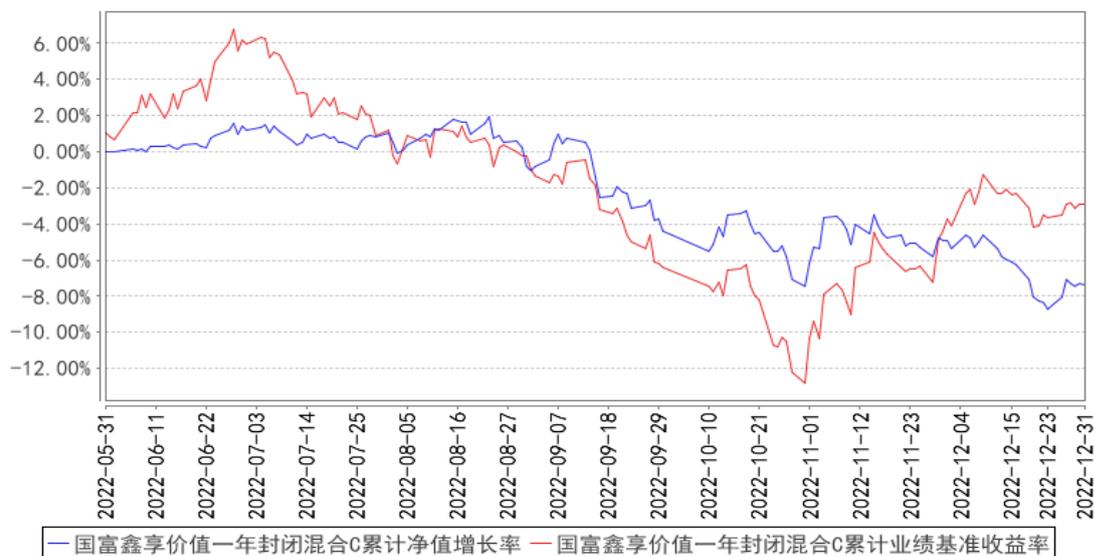
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-3.11%	0.67%	3.79%	1.06%	-6.90%	-0.39%
过去六个月	-8.62%	0.58%	-8.56%	0.89%	-0.06%	-0.31%
自基金合同生效 起至今	-7.35%	0.54%	-2.90%	0.88%	-4.45%	-0.34%

### 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

国富鑫享价值一年封闭混合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



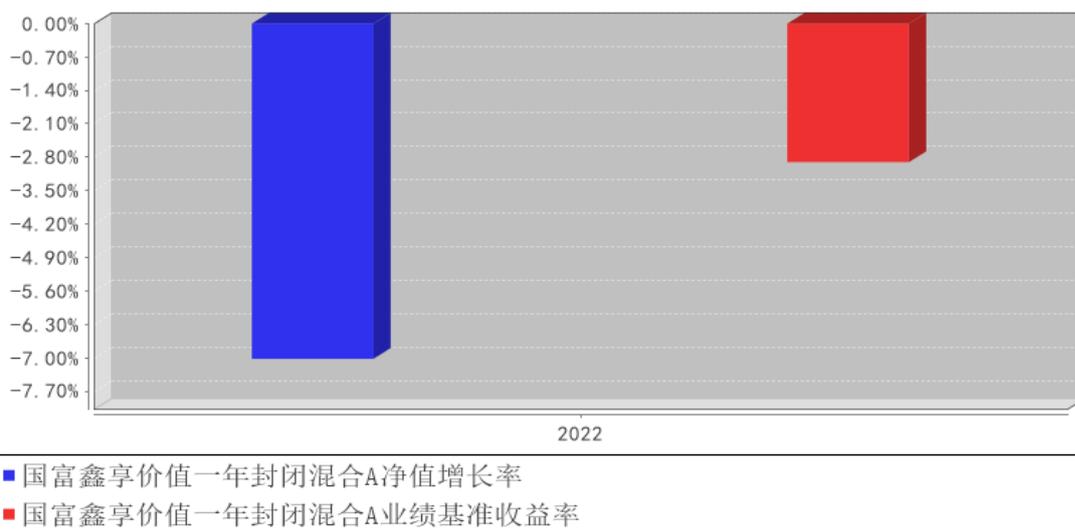
国富鑫享价值一年封闭混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



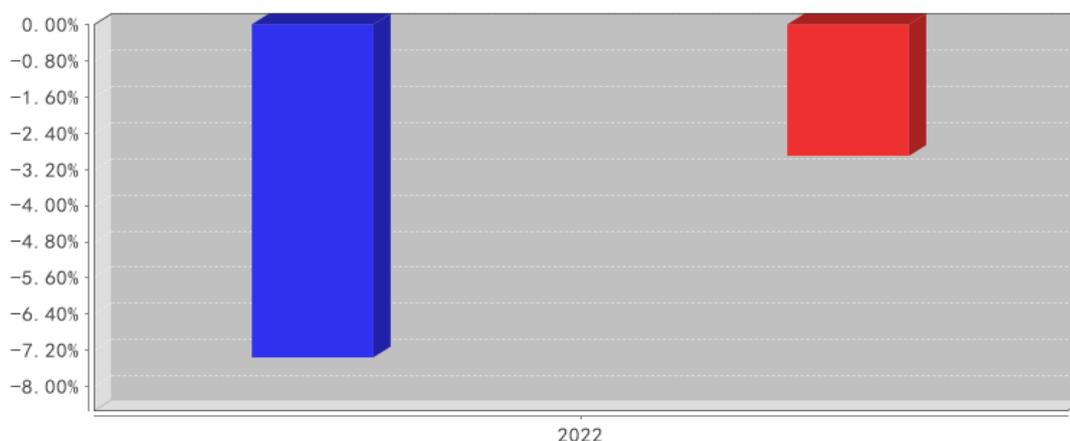
注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 5 月 31 日。本基金建仓期为 6 个月，截至本报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

国富鑫享价值一年封闭混合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



国富鑫享价值一年封闭混合C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



■ 国富鑫享价值一年封闭混合C净值增长率
■ 国富鑫享价值一年封闭混合C业绩基准收益率

注：本基金成立于 2022 年 5 月 31 日，故 2022 年业绩为成立日至年底而非全年业绩。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

国富鑫享价值一年封闭混合 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
2022 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

国富鑫享价值一年封闭混合 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
2022 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金合同生效日为2022年5月31日。

## § 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 2022 年末，公司旗下合计管理 41 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、国富鑫享价值一年封闭混合基金及国富均衡增长混合基金的基金经理	2022 年 5 月 31 日	-	16 年	刘晓女士，上海财经大学金融学硕士。历任国海富兰克林基金管理有限公司研究助理、研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理兼研究员。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富深化价值混合基金、国富新机遇混合基金、国富天颐混合基金、国富焦点驱动混合基金、国富匠心精选混合基金、国富鑫享价值一年封闭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”的计算标准为该员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作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，公司共管理了四十一只公募基金及六只专户产品。统计所有投资组合分投资类别（股票、债券）过去连续 4 个季度内在不同时间窗口（T=1、T=3 和 T=5）存在同向交易价差的样本，并对差价率均值、交易价格占优比率、t 值、贡献率等指标进行分析，报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

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

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

22 年全球经济在新冠疫情和地区冲突的阴霾下继续艰难前行，市场大幅震荡，行业轮动加剧。

前四个月受海外俄乌冲突影响，原油等部分大宗商品价格飙涨，Omicron 变异毒株在上海等部分城市爆发，影响了国内正常的经济生活，A 股市场大幅下挫。五月份之后，上述两大压制经济的短期因素阶段性解除：大宗商品价格显著下行，Omicron 疫情在上海等城市的影响阶段性告一段落，生产物流快速恢复，需求的修复也在发生，市场由此出现持续 2 个月的反弹。但是，支撑这轮反弹的逻辑是两大短期压制因素的消除，而中长期的矛盾仍然没有解决。进入三季度以来，Omicron 疫情又开始在国内多个城市和地区爆发，地产风险继续释放，相关数据进一步恶化。海外方面，美国通胀超预期持续高企，市场预期出口回落且海外流动性收缩。经济基本面进一步走弱，大部分行业的需求加速下行，需求端的疲弱代替供给格局成为当期关键的变量，由此，A 股市场 7 月到 10 月经历了新一轮快速下挫，并最终冲击到了前期表现较好供给格局偏紧的行业板块以及上半年凭借自身阿尔法较好地抵御了宏观贝塔下行的制造业里的成长型个股。这类板块和个股的超额收益明显收窄。11 月份至年底，地产链和消费出行等两大板块的反转逻辑成立，带动相关板块和市场整体出现大幅反弹。

全年来看，煤炭、休闲服务、交运和银行等板块跌幅较小，而 TMT、军工和电气设备新能源等板块跌幅较大。

2022 年全年，本基金在完成建仓后，总体维持中性略偏高的权益仓位，重点配置景气度持续性较强的行业里面，估值相对合理且有核心竞争力的优质公司。具体行业方面，新能源、化工、银行、机械和医药等配置相对较多，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 2022 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 0.9298 元，本报告期份额净值下跌 7.02%，同期业绩比较基准下跌 2.90%，跑输业绩比较基准 4.12%；本基金 C 类份额净值为 0.9265 元，本报告期份额净值下跌 7.35%，同期业绩比较基准下跌 2.90%，跑输业绩比较基准 4.45%。

#### 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 2023 年，国内经济正在走出疫情阴霾，生产生活逐步恢复，叠加稳增长利好政策不断出台，投资者对经济复苏的信心得以增强，推动市场回暖，预计国内经济基本面整体走势前低后高。

从资金维度看，23 年美联储加息有望放缓，国内居民资产配置力量渐显，因此海外流动性、国内微观资金面均有望边际改善。风险方面，未来仍需关注新冠病毒变异的情况及毒性对全球的影响，以及海外抗通胀和需求疲弱的幅度和节奏。

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。22 年受到国内经济周期下行以及疫情扰动的双重影响，制造业内众多质地优秀的成长型公司，业绩和估值经历大幅度双杀，处在历史相对底部位置，相信未来随着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，流动性上看，GDP 增速或将长期维持低速增长态势，流动性适度或宽松的状态或将长期持续。而从市场参与者结构看，我国居民资产配置有望中长期向权益转移，机构化和外资比例的继续提升，对 A 股市场也形成实质性的长期利好。

从投资策略的角度看，研究的重心始终应该更多的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。

#### 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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(2023)第 24423 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	富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作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鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金(以下简称“国富鑫享价值一年封闭运作混合基金”)的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年5月31日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的利润表和净资产(基金净值)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,公允反映了国富鑫享价值一年封闭运作混合基金2022年12月31日的财务状况以及2022年5月31日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间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,我们独立于国富鑫享价值一年封闭运作混合基金,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>国富鑫享价值一年封闭运作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鑫享价值一年封闭运作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鑫享价值一年封闭运作混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国富鑫享价值一年封闭运作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	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准</p>

	<p>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,就可能导致对国富鑫享价值一年封闭运作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鑫享价值一年封闭运作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	薛竞 张晓阳
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	2023 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
资产：		

银行存款	7.4.7.1	79,652,424.42
结算备付金		663,314.24
存出保证金		55,906.92
交易性金融资产	7.4.7.2	196,816,528.72
其中：股票投资		179,297,231.46
基金投资		-
债券投资		17,519,297.26
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		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		6,310,737.38
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		283,498,911.68
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		2.08
应付赎回款		-
应付管理人报酬		364,052.56
应付托管费		60,675.44
应付销售服务费		37,728.43
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	298,643.73
负债合计		761,102.24
<b>净资产：</b>		

实收基金	7.4.7.7	304,361,478.01
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.8	-21,623,668.57
净资产合计		282,737,809.44
负债和净资产总计		283,498,911.68

注：1. 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 304,361,478.01 份，其中国富鑫享价值一年封闭混合 A 类基金份额净值 0.9298 元，基金份额 225,315,270.95 份；国富鑫享价值一年封闭混合 C 类基金份额净值 0.9265 元，基金份额 79,046,207.06 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2022 年 5 月 31 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 5 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 5 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-18,165,920.14
1. 利息收入		398,317.13
其中：存款利息收入	7.4.7.9	362,321.47
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		35,995.66
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,204,067.47
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-11,090,596.57
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	75,503.91
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.12	-
股利收益	7.4.7.13	811,025.19
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-8,360,169.80

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-
<b>减：二、营业总支出</b>		3,457,748.43
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,622,747.40
2. 托管费	7.4.10.2.2	437,124.52
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	272,115.70
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	7.4.7.16	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.17	125,760.81
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-21,623,668.57
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-21,623,668.57
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-21,623,668.57

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金

本报告期：2022年5月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022年5月31日（基金合同生效日）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（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	304,361,478.01	-	-	304,361,478.01
三、本期	-	-	-21,623,668.57	-21,623,668.57

增减变动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	-21,623,668.57	-21,623,668.57
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	304,361,478.01	-	-21,623,668.57	282,737,809.44

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：

徐荔蓉

于意

肖燕

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3377号《关于准予富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金注册的批复》注册,由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 304,323,895.23 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0399 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 5 月 31 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 304,361,478.01 份基金份额,其中认购资金利息折合 37,582.78 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金根据认购、申购费及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/申购时收取认购/申购费用、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、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《富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债及其他经中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会

相关规定)。封闭运作期内,本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 60% - 100%(其中,投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%);封闭运作期届满转为开放式运作后,本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 60%—95%(其中,投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%);本基金封闭运作期结束前一个月至转为开放式基金后一个月内,基金投资不受前述比例限制。封闭运作期内,每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;封闭运作期届满转为开放式运作后,每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 x50%+恒生指数收益率 x20%+中债综合指数收益率 x30%。

本财务报表由本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于 2023 年 3 月 29 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》、《富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作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 2022 年 5 月 31 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 5 月 31 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 5 月 31 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。

#### 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或金融负债。

##### (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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

本基金在封闭期内不适用损益平准金。

本基金转为开放式基金后, 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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关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。

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

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	79,652,424.42
等于：本金	79,643,907.16
加：应计利息	8,517.26
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	79,652,424.42

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	187,639,599.26	-	179,297,231.46	-8,342,367.80	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	17,384,742.00	152,357.26	17,519,297.26	-17,802.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,384,742.00	152,357.26	17,519,297.26	-17,802.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	205,024,341.26	152,357.26	196,816,528.72	-8,360,169.80	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	173,643.73
其中：交易所市场	173,643.73
银行间市场	-
应付利息	-
审计费用	45,000.00
信息披露费	80,000.00
合计	298,643.73

## 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

## 国富鑫享价值一年封闭混合 A

项目	本期 2022 年 5 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	225,315,270.95	225,315,270.95
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	225,315,270.95	225,315,270.95

## 国富鑫享价值一年封闭混合 C

项目	本期 2022 年 5 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	79,046,207.06	79,046,207.06
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	79,046,207.06	79,046,207.06

注：1. 本基金自 2022 年 2 月 28 日至 2022 年 5 月 27 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 304,323,895.23 元，折合为 304,323,895.23 份基金份额（其中 A 类基金份额 225,288,483.37 份，C 类基金份额 79,035,411.86 份）。根据《富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 37,582.78 元在本基金成立后，折合为 37,582.78 份基金份额（其中 A 类基金份额 26,787.58 份，C 类基金份额 10,795.20 份），划入基金份额持有人账户。

2. 本基金本报告期内封闭运作。

## 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

## 国富鑫享价值一年封闭混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-9,624,491.10	-6,192,126.39	-15,816,617.49
本期基金份额交易产生	-	-	-

的变动数			
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,624,491.10	-6,192,126.39	-15,816,617.49

## 国富鑫享价值一年封闭混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-3,639,007.67	-2,168,043.41	-5,807,051.08
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,639,007.67	-2,168,043.41	-5,807,051.08

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年5月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	357,796.18
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	4,236.72
其他	288.57
合计	362,321.47

## 7.4.7.10 股票投资收益

## 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年5月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-11,090,596.57
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	-11,090,596.57

## 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年5月31日（基金合同生效日）至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	94,282,761.85
减：卖出股票成本总额	104,939,625.33
减：交易费用	433,733.09
买卖股票差价收入	-11,090,596.57

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年5月31日（基金合同生效日）至2022年12 月31日
债券投资收益——利息收入	34,160.67
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券 到期兑付）差价收入	41,343.24
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	75,503.91

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年5月31日（基金合同生效日）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	391,463.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成 本总额	350,000.00
减：应计利息总额	104.33
减：交易费用	15.55
买卖债券差价收入	41,343.24

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年5月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	811,025.19
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	811,025.19

#### 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年5月31日（基金合同生效日）至2022年12月 31日
1. 交易性金融资产	-8,360,169.80
股票投资	-8,342,367.80
债券投资	-17,802.00
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	-8,360,169.80

#### 7.4.7.15 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 7.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年5月31日（基金合同生效日）至2022 年12月31日
审计费用	45,000.00
信息披露费	80,000.00
证券出借违约金	-
银行汇划费用	210.00
证券组合费	150.81
其他手续费	400.00
合计	125,760.81

#### 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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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 2022年5月31日（基金合同生效日）至2022年 12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
国海证券	18,458,837.40	4.82

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内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 2022年5月31日（基金合同生效日）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	17,190.77	6.04	-	-

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

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

#### 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
	2022 年 5 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,622,747.40
其中：支付销售机构的客户维护费	612,719.69

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数。}$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 5 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	437,124.52

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值  $\times$  0.25% / 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		
	2022 年 5 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富鑫享价值一年封闭混合 A	国富鑫享价值一年封闭混合 C	合计
国海富兰克林基金管理有限公司	-	33,049.38	33,049.38
国海证券	-	45,553.92	45,553.92
兴业银行	-	79,368.07	79,368.07
合计	-	157,971.37	157,971.37

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值的年费率 0.60% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国海富兰克林基金管理有限公司，再由国海富兰克林基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值  $\times$  0.60%  $\div$  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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

1. 基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
2. 本基金基金合同生效日为 2022 年 5 月 31 日,本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

1. 本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
2. 本基金基金合同生效日为 2022 年 5 月 31 日,本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2022 年 5 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	79,652,424.42	357,796.18

注:本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管,按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

#### 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 (2022 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
301165	锐捷网络	2022 年 11 月 14 日	6 个月	新股锁定	32.38	31.61	323	10,458.74	10,210.03	-
301223	中荣股份	2022 年 10 月 13 日	6 个月	新股锁定	26.28	18.13	499	13,113.72	9,046.87	-

301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	新股锁定	13.28	11.40	570	7,569.60	6,498.00	-
301280	珠城科技	2022年12月19日	6个月	新股锁定	67.40	44.80	195	13,143.00	8,736.00	-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股锁定	44.09	35.13	251	11,066.59	8,817.63	-
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	新股锁定	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定	5.00	7.53	2,234	11,170.00	16,822.02	-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	新股锁定	13.88	15.86	766	10,632.08	12,148.76	-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股锁定	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301335	天元宠物	2022年11月11日	6个月	新股锁定	49.98	33.82	252	12,594.96	8,522.64	-
301356	天振股份	2022年11月3日	6个月	新股锁定	63.00	43.33	172	10,836.00	7,452.76	-
301359	东南电子	2022年11月2日	6个月	新股锁定	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301361	众智科技	2022年11月8日	6个月	新股锁定	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股锁定	30.66	37.85	287	8,799.42	10,862.95	-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股锁定	119.88	175.78	89	10,669.32	15,644.42	-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股锁定	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301377	鼎泰高科	2022年11月	6个月	新股锁定	22.88	17.63	491	11,234.08	8,656.33	-

		11 日									
301379	天山电子	2022 年 10 月 19 日	6 个月	新股锁定	31.51	24.63	385	12,131.35	9,482.55		-
301388	欣灵电气	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股锁定	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20		-
301396	宏景科技	2022 年 11 月 4 日	6 个月	新股锁定	40.13	31.90	323	12,961.99	10,303.70		-
301398	星源卓镁	2022 年 12 月 8 日	6 个月	新股锁定	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70		-
688143	长盈通	2022 年 12 月 1 日	6 个月	新股锁定	35.67	42.66	1,855	66,167.85	79,134.30		-
688291	金橙子	2022 年 10 月 17 日	6 个月	新股锁定	26.77	24.11	3,961	106,035.97	95,499.71		-
688420	美腾科技	2022 年 12 月 1 日	6 个月	新股锁定	48.96	39.04	1,685	82,497.60	65,782.40		-

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

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

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

券投资及资产支持证券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，主要是发掘各类风险的风险点，判断风险发生的频度和损失，对风险实行分级管理。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的分析报告，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时对各种风险进行监控和评估，并通过风险处置流程，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人兴业银行，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 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	79,652,424.42	-	-	-	79,652,424.42
结算备付金	663,314.24	-	-	-	663,314.24
存出保证金	55,906.92	-	-	-	55,906.92
交易性金融资产	17,519,297.26	-	-	-179,297,231.46	196,816,528.72
应收清算款	-	-	-	6,310,737.38	6,310,737.38
资产总计	97,890,942.84	-	-	-185,607,968.84	283,498,911.68
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	364,052.56	364,052.56
应付托管费	-	-	-	60,675.44	60,675.44
应付清算款	-	-	-	2.08	2.08
应付销售服务费	-	-	-	37,728.43	37,728.43
其他负债	-	-	-	298,643.73	298,643.73
负债总计	-	-	-	761,102.24	761,102.24

利率敏感度缺口	97,890,942.84	-	-184,846,866.60	282,737,809.44
---------	---------------	---	-----------------	----------------

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 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金净资产的比例为 6.20%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	9,378,839.23	-	9,378,839.23
资产合计	-	9,378,839.23	-	9,378,839.23
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	9,378,839.23	-	9,378,839.23

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末（2022 年 12 月 31 日）
分析	1. 所有外币相对人民币升值 5%	增加约 47
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 47

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。封闭运作期内，本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 60% - 100%(其中，投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%)；封闭运作期届满转为开放式运作后，本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 60% - 95%(其中，投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%)；本基金封闭运作期结束前一个月至转为开放式基金后一个月内，基金投资不受前述比例限制。封闭运作期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；封闭运作期届满转为开放式运作后，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	179,297,231.46	63.41
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	179,297,231.46	63.41

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2022 年 12 月 31 日，本基金合同生效尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 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 2022 年 12 月 31 日
第一层次	178,857,993.00
第二层次	17,519,297.26
第三层次	439,238.46
合计	196,816,528.72

###### 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

项目	本期 2022年5月31日（基金合同生效日）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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	466,777.04	466,777.04
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-27,538.58	-27,538.58
其中：计入损益的利得或损失	-	-27,538.58	-27,538.58
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	439,238.46	439,238.46
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	-	-27,538.58	-27,538.58

注：

于2022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。

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	439,238.46	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.2783-2.4756	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 2022 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。

**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	179,297,231.46	63.24
	其中：股票	179,297,231.46	63.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,519,297.26	6.18
	其中：债券	17,519,297.26	6.18
	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	80,315,738.66	28.33
8	其他各项资产	6,366,644.30	2.25
9	合计	283,498,911.68	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 9,378,839.23 元，占期末净值比例为 3.32%。

**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	12,970,873.00	4.59
C	制造业	93,522,312.08	33.08

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,797,178.00	0.99
E	建筑业	2,448,264.00	0.87
F	批发和零售业	677,056.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	2,304,870.84	0.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,401,355.87	2.26
J	金融业	33,475,376.60	11.84
K	房地产业	9,823,314.00	3.47
L	租赁和商务服务业	842,517.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	2,372,044.85	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	601,421.99	0.21
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,681,808.00	0.59
	合计	169,918,392.23	60.10

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
消费者非必需品	6,598,143.31	2.33
公用事业	527,654.59	0.19
电信业务	865,221.32	0.31
信息技术	682,708.40	0.24
金融	-	-
医疗保健	-	-
原材料	-	-
工业	705,111.61	0.25
能源	-	-
消费者常用品	-	-
房地产	-	-
合计	9,378,839.23	3.32

注：以上分类采用 GICS 行业分类标准。

### 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	002142	宁波银行	224,800	7,294,760.00	2.58
2	601100	恒立液压	95,100	6,005,565.00	2.12
3	002966	苏州银行	641,970	4,994,526.60	1.77

4	002050	三花智控	233,900	4,963,358.00	1.76
5	002475	立讯精密	141,500	4,492,625.00	1.59
6	601318	中国平安	94,100	4,422,700.00	1.56
7	601128	常熟银行	577,300	4,358,615.00	1.54
8	300573	兴齐眼药	32,300	4,040,084.00	1.43
9	600256	广汇能源	427,800	3,858,756.00	1.36
10	600048	保利发展	240,000	3,631,200.00	1.28
11	300896	爱美客	6,300	3,568,005.00	1.26
12	603212	赛伍技术	111,900	3,547,230.00	1.25
13	002487	大金重工	83,800	3,466,806.00	1.23
14	600519	贵州茅台	1,900	3,281,300.00	1.16
15	002648	卫星化学	197,000	3,053,500.00	1.08
16	601658	邮储银行	658,400	3,041,808.00	1.08
17	600765	中航重机	95,700	2,975,313.00	1.05
18	600406	国电南瑞	121,600	2,967,040.00	1.05
19	601088	中国神华	104,200	2,878,004.00	1.02
20	03690	美团-W	17,600	2,746,555.13	0.97
21	002180	纳思达	51,100	2,651,579.00	0.94
22	001979	招商蛇口	209,900	2,651,037.00	0.94
23	300059	东方财富	136,600	2,650,040.00	0.94
24	601012	隆基绿能	58,000	2,451,080.00	0.87
25	601669	中国电建	345,800	2,448,264.00	0.87
26	002508	老板电器	88,100	2,445,656.00	0.86
27	600745	闻泰科技	45,300	2,381,874.00	0.84
28	600938	中国海油	155,700	2,366,640.00	0.84
29	600030	中信证券	118,500	2,359,335.00	0.83
30	002960	青鸟消防	81,900	2,292,381.00	0.81
31	688111	金山办公	8,542	2,259,273.58	0.80
32	300124	汇川技术	32,500	2,258,750.00	0.80
33	601628	中国人寿	60,100	2,230,912.00	0.79
34	600309	万华化学	23,700	2,195,805.00	0.78
35	300957	贝泰妮	14,700	2,193,828.00	0.78
36	002304	洋河股份	13,500	2,166,750.00	0.77
37	02333	长城汽车	201,000	1,824,200.26	0.65
37	601633	长城汽车	9,400	278,428.00	0.10
38	002472	双环传动	80,000	2,036,000.00	0.72
39	02331	李宁	33,500	2,027,387.92	0.72
40	002271	东方雨虹	60,100	2,017,557.00	0.71
41	688271	联影医疗	11,217	1,985,184.66	0.70
42	603565	中谷物流	129,596	1,884,325.84	0.67
43	600325	华发股份	197,200	1,786,632.00	0.63
44	002001	新和成	94,820	1,777,875.00	0.63
45	600690	海尔智家	72,400	1,770,904.00	0.63

46	300750	宁德时代	4,500	1,770,390.00	0.63
47	300274	阳光电源	15,700	1,755,260.00	0.62
48	600383	金地集团	171,500	1,754,445.00	0.62
49	603259	药明康德	21,100	1,709,100.00	0.60
50	600603	广汇物流	205,600	1,681,808.00	0.59
51	300401	花园生物	103,100	1,483,609.00	0.52
52	002129	TCL 中环	39,100	1,472,506.00	0.52
53	601899	紫金矿业	146,300	1,463,000.00	0.52
54	300751	迈为股份	3,300	1,359,072.00	0.48
55	002493	荣盛石化	106,300	1,307,490.00	0.46
56	01138	中远海能	132,000	705,111.61	0.25
56	600026	中远海能	34,900	420,545.00	0.15
57	600570	恒生电子	26,300	1,064,098.00	0.38
58	002747	埃斯顿	49,000	1,062,320.00	0.38
59	600011	华能国际	137,200	1,044,092.00	0.37
60	000423	东阿阿胶	25,000	1,017,500.00	0.36
61	300308	中际旭创	37,200	1,005,516.00	0.36
62	601009	南京银行	90,000	937,800.00	0.33
63	600027	华电国际	159,200	936,096.00	0.33
64	600438	通威股份	23,100	891,198.00	0.32
65	688789	宏华数科	5,147	888,526.61	0.31
66	00700	腾讯控股	2,900	865,221.32	0.31
67	600109	国金证券	97,400	847,380.00	0.30
68	601888	中国中免	3,900	842,517.00	0.30
69	000932	华菱钢铁	177,200	832,840.00	0.29
70	603833	欧派家居	6,800	826,404.00	0.29
71	600905	三峡能源	144,600	816,990.00	0.29
72	000762	西藏矿业	20,800	803,088.00	0.28
73	000983	山西焦煤	66,900	779,385.00	0.28
74	002049	紫光国微	5,740	756,646.80	0.27
75	002064	华峰化学	102,100	694,280.00	0.25
76	03800	协鑫科技	386,000	682,708.40	0.24
77	001308	康冠科技	21,900	679,776.00	0.24
78	301015	百洋医药	28,400	677,056.00	0.24
79	002466	天齐锂业	8,400	663,516.00	0.23
80	300347	泰格医药	6,200	649,760.00	0.23
81	300015	爱尔眼科	19,357	601,421.99	0.21
82	601699	潞安环能	35,000	589,750.00	0.21
83	600563	法拉电子	3,500	559,580.00	0.20
84	000651	格力电器	17,100	552,672.00	0.20
85	300699	光威复材	7,600	549,100.00	0.19
86	02380	中国电力	179,000	527,654.59	0.19
87	688385	复旦微电	7,350	513,103.50	0.18

88	605068	明新旭腾	15,900	471,753.00	0.17
89	002920	德赛西威	3,600	379,224.00	0.13
90	601456	国联证券	30,000	337,500.00	0.12
91	603728	鸣志电器	10,000	333,300.00	0.12
92	600933	爱柯迪	15,100	274,971.00	0.10
93	300760	迈瑞医疗	800	252,776.00	0.09
94	603606	东方电缆	3,500	237,405.00	0.08
95	601225	陕西煤业	12,500	232,250.00	0.08
96	688291	金橙子	3,961	95,499.71	0.03
97	301280	珠城科技	1,948	92,441.75	0.03
98	688143	长盈通	1,855	79,134.30	0.03
99	301398	星源卓镁	2,549	78,837.80	0.03
100	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.02
101	301368	丰立智能	3,368	66,558.14	0.02
102	688420	美腾科技	1,685	65,782.40	0.02
103	001338	永顺泰	1,649	34,826.88	0.01
104	301301	川宁生物	2,234	16,822.02	0.01
105	301367	怡和嘉业	89	15,644.42	0.01
106	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
107	301311	昆船智能	766	12,148.76	0.00
108	301363	美好医疗	287	10,862.95	0.00
109	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
110	301396	宏景科技	323	10,303.70	0.00
111	301165	锐捷网络	323	10,210.03	0.00
112	301379	天山电子	385	9,482.55	0.00
113	301223	中荣股份	499	9,046.87	0.00
114	301290	东星医疗	251	8,817.63	0.00
115	301377	鼎泰高科	491	8,656.33	0.00
116	301335	天元宠物	252	8,522.64	0.00
117	301356	天振股份	172	7,452.76	0.00
118	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
119	301265	华新环保	570	6,498.00	0.00
120	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
121	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

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

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002142	宁波银行	6,677,022.00	2.36

2	002050	三花智控	5,987,069.00	2.12
3	601100	恒立液压	5,508,877.00	1.95
4	002475	立讯精密	5,447,323.00	1.93
5	300769	德方纳米	4,865,277.40	1.72
6	002966	苏州银行	4,640,751.30	1.64
7	600256	广汇能源	4,569,073.30	1.62
8	601128	常熟银行	4,505,871.00	1.59
9	600048	保利发展	4,189,205.00	1.48
10	600011	华能国际	4,149,536.00	1.47
11	601318	中国平安	4,052,376.00	1.43
12	300573	兴齐眼药	3,997,047.00	1.41
13	603260	合盛硅业	3,929,732.00	1.39
14	002487	大金重工	3,880,407.00	1.37
15	601088	中国神华	3,796,994.00	1.34
16	603212	赛伍技术	3,743,894.00	1.32
17	600188	兖矿能源	3,553,791.00	1.26
18	600519	贵州茅台	3,469,865.00	1.23
19	000999	华润三九	3,415,595.00	1.21
20	002001	新和成	3,348,005.60	1.18

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 累计卖出金额超期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300769	德方纳米	3,750,636.00	1.33
2	603260	合盛硅业	3,184,639.00	1.13
3	600188	兖矿能源	3,095,657.00	1.09
4	600011	华能国际	2,909,849.00	1.03
5	000999	华润三九	2,875,930.00	1.02
6	603938	三孚股份	2,802,724.00	0.99
7	601225	陕西煤业	2,459,662.00	0.87
8	600809	山西汾酒	2,405,853.00	0.85
9	688599	天合光能	2,403,103.65	0.85
10	600522	中天科技	2,391,646.00	0.85
11	002371	北方华创	2,256,814.00	0.80
12	600741	华域汽车	2,073,653.64	0.73
13	002603	以岭药业	2,069,757.00	0.73
14	300373	扬杰科技	2,046,435.00	0.72
15	300003	乐普医疗	1,816,744.00	0.64
16	603179	新泉股份	1,668,840.00	0.59
17	603806	福斯特	1,611,842.00	0.57
18	603612	索通发展	1,606,182.00	0.57
19	600795	国电电力	1,464,227.00	0.52

20	300347	泰格医药	1,448,191.00	0.51
----	--------	------	--------------	------

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	292,579,224.59
卖出股票收入（成交）总额	94,282,761.85

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	17,519,297.26	6.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,519,297.26	6.20

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019679	22 国债 14	174,000	17,519,297.26	6.20

#### 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

本基金以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值

水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。

## 8.11 投资组合报告附注

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

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

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	55,906.92
2	应收清算款	6,310,737.38
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,366,644.30

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
国富鑫享 价值一年	2,021	111,487.02	131,494,807.55	58.36	93,820,463.40	41.64

封闭混合 A						
国富鑫享价值一年封闭混合 C	2,139	36,954.75	25,600,133.34	32.39	53,446,073.72	67.61
合计	4,160	73,163.82	157,094,940.89	51.61	147,266,537.12	48.39

### 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	国富鑫享价值一年封闭混合 A	15,923.08	0.007067
	国富鑫享价值一年封闭混合 C	1,330,165.67	1.682770
	合计	1,346,088.75	0.442266

### 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	国富鑫享价值一年封闭混合 A	0
	国富鑫享价值一年封闭混合 C	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	国富鑫享价值一年封闭混合 A	0
	国富鑫享价值一年封闭混合 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富鑫享价值一年封闭混合 A	国富鑫享价值一年封闭混合 C
基金合同生效日（2022 年 5 月 31 日）基金份额总额	225,315,270.95	79,046,207.06
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金	-	-

拆分变动份额		
本报告期期末基金份额总额	225,315,270.95	79,046,207.06

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (一) 基金管理人重大人事变动

1、经国海富兰克林基金管理有限公司第六届董事会第十三次会议审议通过，自 2022 年 3 月 1 日起，季勇先生担任公司副总经理。相关公告已于 2022 年 3 月 3 日在《上海证券报》和公司网站披露。

2、经国海富兰克林基金管理有限公司第六届董事会第二十一次会议审议通过，自 2022 年 6 月 1 日起，徐荔蓉先生不再担任公司副总经理，聘任徐荔蓉先生担任公司总经理。相关公告已于 2022 年 6 月 3 日在《证券时报》和公司网站披露。

#### (二) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

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 45,000.00 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，基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中没有受到稽查或处罚的情况。

## 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 (%)	
广发证券	2	364,267,619.31	95.18	267,286.87	93.96	-
国海证券	3	18,458,837.40	4.82	17,190.77	6.04	-

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，本基金逐步新增国海证券上海、深圳和北交所交易单元各 1 个，广发证券上海及深圳交易单元各 1 个。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
广发证券	17,776,205.12	100.00	106,643,000.00	100.00	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

## 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	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	2022-1-24
2	富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-1-25
3	富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-1-25
4	富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作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	2022-1-25
5	富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作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	2022-1-25

6	富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-1-25
7	富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金（国富鑫享价值一年封闭运作混合 A 份额）基金产品资料概要	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-1-25
8	富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金（国富鑫享价值一年封闭运作混合 C 份额）基金产品资料概要	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-1-25
9	关于增加部分销售机构为富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-2-21
10	国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-3-3
11	国海富兰克林基金管理有限公司关于北京分公司办公地址变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-3-24
12	关于富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金延长募集期的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-3-25
13	国海富兰克林基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-4-2
14	关于增加部分销售机构为富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-4-12
15	关于增加部分销售机构为富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-4-22
16	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-4-22
17	关于增加部分销售机构为富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-5-6
18	富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-6-1
19	国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-6-3
20	国海富兰克林基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-6-20

21	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	2022-7-21
22	国海富兰克林基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-8-4
23	关于在招商银行招赢通平台开通国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金的销售业务并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-8-25
24	国海富兰克林基金管理有限公司 2022 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-8-31
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	2022-10-26
26	富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022-10-26

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

基金资产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鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海鑫享价值一年封闭运作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

2023 年 3 月 31 日