

富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	48
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	国富价值成长一年持有期混合	
基金主代码	010271	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 4 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	291,750,860.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国富价值成长一年持有期混合 A	国富价值成长一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	010271	010272
报告期末下属分级基金的份额总额	196,393,524.43 份	95,357,336.04 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严控组合风险及考虑流动性的前提下，通过采用“GARP”策略，严选未来收益具有成长性和资产价值低估的上市公司股票，力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	<p>本基金贯彻“自上而下”的资产配置策略，通过对宏观经济运行所处的经济周期及趋势的研判，动态跟踪国家财政政策和货币政策，综合分析证券市场流动性、大类资产的估值水平和投资价值等因素，在遵守大类资产投资比例限制的前提下进行积极的资产配置，对基金组合中股票、债券、短期金融工具的配置比例进行调整和优化，平衡投资组合的风险与收益。</p> <p>在股票投资上，本基金采用的“GARP”（Growth at a Reasonable Price）投资策略，核心思想是以合理估值买入有成长潜力的公司股票。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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	021-62159217	
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	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	上海市浦东新区银城路 167 号 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	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	国富价值成长一年持有期混合 A	国富价值成长一年持有期混合 C
本期已实现收益	-13,140,565.57	-6,469,633.91
本期利润	-6,331,469.50	-3,379,493.28
加权平均基金份额 本期利润	-0.0313	-0.0344
本期加权平均净 值利润率	-4.07%	-4.53%
本期基金份额净 值增长率	-4.02%	-4.21%
3.1.2 期末数据	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

和指标		
期末可供分配利润	-49,112,656.66	-24,606,675.45
期末可供分配基金份额利润	-0.2501	-0.2580
期末基金资产净值	147,280,867.77	70,750,660.59
期末基金份额净值	0.7499	0.7420
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-14.75%	-15.98%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国富价值成长一年持有期混合 A

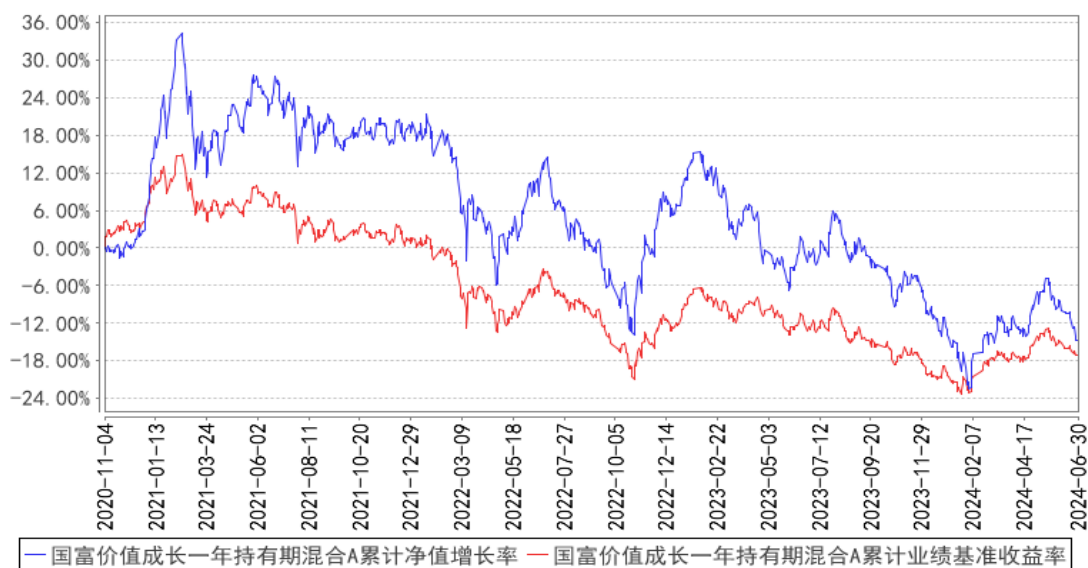
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.49%	0.68%	-1.85%	0.35%	-3.64%	0.33%
过去三个月	-2.04%	1.01%	0.72%	0.54%	-2.76%	0.47%
过去六个月	-4.02%	1.19%	2.20%	0.65%	-6.22%	0.54%
过去一年	-13.46%	1.09%	-4.98%	0.65%	-8.48%	0.44%
过去三年	-32.73%	1.25%	-23.45%	0.78%	-9.28%	0.47%
自基金合同生效起至今	-14.75%	1.28%	-17.06%	0.78%	2.31%	0.50%

国富价值成长一年持有期混合 C

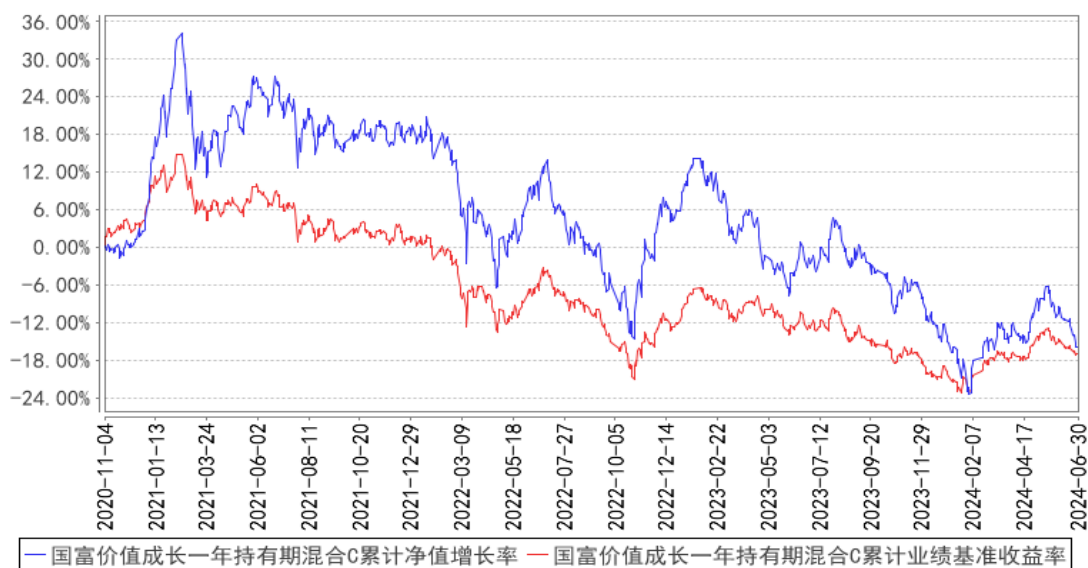
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.51%	0.68%	-1.85%	0.35%	-3.66%	0.33%
过去三个月	-2.12%	1.01%	0.72%	0.54%	-2.84%	0.47%
过去六个月	-4.21%	1.19%	2.20%	0.65%	-6.41%	0.54%
过去一年	-13.79%	1.09%	-4.98%	0.65%	-8.81%	0.44%
过去三年	-33.52%	1.25%	-23.45%	0.78%	-10.07%	0.47%
自基金合同生效起至今	-15.98%	1.28%	-17.06%	0.78%	1.08%	0.50%

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

国富价值成长一年持有期混合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



国富价值成长一年持有期混合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 2020 年 11 月 4 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

§ 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 76 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 2024 年 6 月末，公司旗下合计管理 47 只公募基金产品。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐荔	公司管理	2020 年	-	27 年	徐荔蓉先生, CFA, CPA (非执业), 律师 (非

蓉	层董事、总经理、投资总监，国富中国收益混合基金、国富潜力组合混合基金、国富研究精选混合基金、国富价值成长一年持有期混合基金、国富优质企业一年持有期混合基金及富兰克林国海中国 A 股基金的基金经理	11 月 4 日			执业)，中央财经大学经济学硕士。历任中国技术进出口总公司金融部副总经理、融通基金管理有限公司基金经理、申万巴黎基金管理有限公司（现“申万菱信基金管理有限公司”）基金经理、国海富兰克林基金管理有限公司高级顾问、资产管理部总经理兼投资经理、管理层董事、研究分析部总经理、公司副总经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司管理层董事、总经理、投资总监，国富中国收益混合基金、国富潜力组合混合基金、国富研究精选混合基金、国富价值成长一年持有期混合基金及富兰克林国海中国 A 股基金的基金经理。
---	---	----------	--	--	--

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《富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年股票市场先扬后抑，总体表现为震荡走势。总体看低估值的大市值公司表现较好，中小市值类和成长类公司表现较为疲软，投资者情绪也较为低迷，市场整体防守心态相对浓厚，股市和债市呈现了明显的跷跷板现象。

本基金在上半年继续保持相对均衡的组合布局，同时逐步增加了对成长类公司的持仓，同时对部分公司进行了波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 06 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 0.7499 元，报告期内份额净值下跌 4.02%，同期业绩比较基准上涨 2.20%，跑输业绩比较基准 6.22%；本基金 C 类份额净值为 0.7420 元，报告期内份额净值下跌 4.21%，同期业绩比较基准上涨 2.20%，跑输业绩比较基准 6.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过四十多年的高速发展，中国经济逐步进入中高速的增长阶段，这种过渡和转折阶段必然面临多种挑战，各类驱动中国经济持续增长的力量如市场化，企业家精神，产业政策等都面临新的定位和平衡，而这种平衡需要时间和不断的碰撞及磨合，股票市场做为社会的集中映射，就充分反映了这种现实。

中国经济已经逐步转为消费主导的经济体，经济的韧性和弹性都已经有了本质的变化，我们对中长期经济仍然持相对乐观的看法，在各方力量逐步达成新的均衡之后经济或仍将保持较高的增长速度，股票市场从中短期看明显过度悲观，未来一段时间均值回归驱动的反弹或将仍然是市场的主流趋势，上市公司的盈利的持续性增长仍然是我们重点观察和跟踪的指标，在目前的阶段，

耐心寻找并持有优质的成长类公司将是我们的重点。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、

投资组合报告等内容，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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	9,445,921.59	6,050,640.50
结算备付金		2,138,410.68	63,979.41
存出保证金		20,817.85	24,844.10
交易性金融资产	6.4.7.2	206,848,949.51	238,951,200.18
其中：股票投资		193,659,806.77	225,093,955.25
基金投资		-	-
债券投资		13,189,142.74	13,857,244.93
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	1,929,113.04
应收股利		452,086.08	-
应收申购款		10,024.56	46,023.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		218,916,210.27	247,065,800.75
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		11.95	2,798,996.91
应付赎回款		474,665.08	327,266.02
应付管理人报酬		225,544.27	253,537.39
应付托管费		37,590.69	42,256.23
应付销售服务费		24,361.19	27,572.78
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	6.4.7.9	122,508.73	211,594.00
负债合计		884,681.91	3,661,223.33
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	291,750,860.47	312,428,027.71
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-73,719,332.11	-69,023,450.29
净资产合计		218,031,528.36	243,404,577.42
负债和净资产总计		218,916,210.27	247,065,800.75

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 291,750,860.47 份，其中国富价值成长一年持有期混合 A 基金份额净值 0.7499 元，基金份额总额 196,393,524.43 份；国富价值成长一年持有期混合 C 基金份额净值 0.7420 元，基金份额总额 95,357,336.04 份。

6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-7,859,820.76	-21,941,663.24
1. 利息收入		12,357.11	16,281.35
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,357.11	16,281.35
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）		-17,771,414.57	9,387,321.74
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-21,333,029.76	7,228,426.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	136,409.18	190,040.92

资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	3,425,206.01	1,968,854.29
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	9,899,236.70	-31,345,266.33
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		1,851,142.02	3,186,594.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,371,910.79	2,459,058.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	228,651.82	409,843.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	148,363.70	217,707.65
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	102,215.71	99,985.44
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-9,710,962.78	-25,128,258.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-9,710,962.78	-25,128,258.08
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-9,710,962.78	-25,128,258.08

6.3 净资产变动表

会计主体：富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产	312,428,027.71	-	-69,023,450.29	243,404,577.42
加：会计政策变 更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	312,428,027.71	-	-69,023,450.29	243,404,577.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-20,677,167.24	-	-4,695,881.82	-25,373,049.06
(一)、综合收益总额	-	-	-9,710,962.78	-9,710,962.78
(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)	-20,677,167.24	-	5,015,080.96	-15,662,086.28
其中：1. 基金申购款	4,021,904.50	-	-981,692.89	3,040,211.61
2. 基金赎回款	-24,699,071.74	-	5,996,773.85	-18,702,297.89
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	291,750,860.47	-	-73,719,332.11	218,031,528.36
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	383,666,457.98	-	-23,772,242.98	359,894,215.00
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	383,666,457.98	-	-23,772,242.98	359,894,215.00
三、本期增减变动	-39,157,887.18	-	-22,895,442.31	-62,053,329.49

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-25,128,258.08	-25,128,258.08
(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)	-39,157,887.18	-	2,232,815.77	-36,925,071.41
其中: 1. 基金申购款	9,822,811.48	-	-642,544.66	9,180,266.82
2. 基金赎回款	-48,980,698.66	-	2,875,360.43	-46,105,338.23
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	344,508,570.80	-	-46,667,685.29	297,840,885.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

徐荔蓉

于意

肖燕

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海价值成长一年持有期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[2020]2193号《关于准予富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》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《富兰克林国海价值成长一年持有期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 894,750,304.88 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

(2020)第 0917 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 894,884,237.89 份基金份额,其中认购资金利息折合 133,933.01 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《富兰克林国海价值成长一年持有期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/申购费用、销售服务费收取方式的差异,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用,并不再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;在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,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并公布基金份额净值,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。

本基金每份基金份额的最短持有期限为自基金合同生效日(对认购份额而言,下同)或基金份额申购确认日(对申购份额而言,下同)起至基金合同生效日或基金份额申购确认日的一年对日(如不存在该对日或该对日为非工作日的,则延后至下一工作日)的前一日的期间。在最短持有期限内,基金份额不能赎回或转换转出;本基金每份基金份额在其最短持有期限到期后的下一个工作日(含)起,基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回或转换转出申请。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海价值成长一年持有期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、中小板、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、证券公司短期公司债券等)、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)。基金的投资组合比例为:本基金投资组合中股票(含存托凭证)投资比例为基金资产的 60%-95%,港股通标的股票最高投资比例不得超过股票资产的 50%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,本基金所指的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:沪深 300 指数收益率 \times 50%+恒生指数收益率 \times 20%+中债综合指数收益率 \times 30%。

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 8 月 31 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。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。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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	9,445,921.59
等于：本金	9,445,046.45
加：应计利息	875.14
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	9,445,921.59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	270,943,989.23	-	193,659,806.77	-77,284,182.46	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	13,056,310.00	143,242.74	13,189,142.74	-10,410.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,056,310.00	143,242.74	13,189,142.74	-10,410.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	284,000,299.23	143,242.74	206,848,949.51	-77,294,592.46	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30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	28,501.13
其中：交易所市场	28,501.13
银行间市场	-
应付利息	-
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
债券账户维护费	4,500.00
合计	122,508.73

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国富价值成长一年持有期混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	208,398,367.69	208,398,367.69
本期申购	3,599,218.30	3,599,218.30
本期赎回（以“-”号填列）	-15,604,061.56	-15,604,061.56
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	196,393,524.43	196,393,524.43

国富价值成长一年持有期混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	104,029,660.02	104,029,660.02
本期申购	422,686.20	422,686.20
本期赎回（以“-”号填列）	-9,095,010.18	-9,095,010.18
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	95,357,336.04	95,357,336.04

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国富价值成长一年持有期混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,583,275.11	-50,153,436.68	-45,570,161.57
本期期初	4,583,275.11	-50,153,436.68	-45,570,161.57
本期利润	-13,140,565.57	6,809,096.07	-6,331,469.50
本期基金份额交易产生的变动数	255,946.96	2,533,027.45	2,788,974.41
其中：基金申购款	-46,764.47	-830,475.47	-877,239.94
基金赎回款	302,711.43	3,363,502.92	3,666,214.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,301,343.50	-40,811,313.16	-49,112,656.66

国富价值成长一年持有期混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,456,423.83	-24,909,712.55	-23,453,288.72
本期期初	1,456,423.83	-24,909,712.55	-23,453,288.72
本期利润	-6,469,633.91	3,090,140.63	-3,379,493.28
本期基金份额交易产生的变动数	133,072.50	2,093,034.05	2,226,106.55
其中：基金申购款	-10,434.88	-94,018.07	-104,452.95
基金赎回款	143,507.38	2,187,052.12	2,330,559.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,880,137.58	-19,726,537.87	-24,606,675.45

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	9,837.82
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	2,332.94
其他	186.35
合计	12,357.11

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

股票投资收益——买卖股票差价收入	-21,333,029.76
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	-21,333,029.76

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	62,632,647.37
减：卖出股票成本总额	83,818,513.29
减：交易费用	147,163.84
买卖股票差价收入	-21,333,029.76

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	146,118.80
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-9,709.62
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	136,409.18

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	13,896,623.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,610,045.62
减：应计利息总额	296,287.56
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-9,709.62

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,425,206.01
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	3,425,206.01

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	9,899,236.70
股票投资	9,910,481.08
债券投资	-11,244.38
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	9,899,236.70

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
债券账户维护费	9,000.00
银行汇划费用	1,715.70
证券组合费	1,992.41
合计	102,215.71

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
国海证券	15,892,815.08	15.27	15,143,473.35	19.73

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国海证券	13,952.15	17.19	11,862.98	41.62
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国海证券	14,102.57	23.84	6,218.15	24.42

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,371,910.79	2,459,058.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	617,424.82	1,115,130.72
应支付基金管理人的净管理费	754,485.97	1,343,927.99

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：

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

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：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	228,651.82	409,843.04

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：

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

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，支付基金托管人兴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：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富价值成长一年持有期混合 A	国富价值成长一年持有期混合 C	合计
国海富兰克林基金管理有限公司	-	250.46	250.46
兴业银行	-	123,401.70	123,401.70
合计	-	123,652.16	123,652.16
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富价值成长一年持有期混合 A	国富价值成长一年持有期混合 C	合计
国海富兰克林基金管理有限公司	-	3,393.28	3,393.28
兴业银行	-	176,479.04	176,479.04
合计	-	179,872.32	179,872.32

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 0.40% 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 × 0.40% ÷ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

1. 基金管理人运用自有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
2. 本报告期和上年度可比期间（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

1. 本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
2. 本报告期末和上年度末（2023 年 12 月 31 日）除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	9,445,921.59	9,837.82	9,120,554.27	15,694.53

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股锁定	17.39	20.60	140	2,434.60	2,884.00	-
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	其中 40 股为锁定期送股的股份
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股锁定	17.43	34.56	176	3,067.68	6,082.56	-
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁定	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁定	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股锁定	16.16	32.27	377	6,092.32	12,165.79	-
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定	55.82	91.24	141	5,637.82	12,864.84	其中 40 股为锁定期送股的股份
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股锁定	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定	11.88	18.98	470	5,583.60	8,920.60	-

301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股锁定	44.95	65.93	132	5,933.40	8,702.76	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股锁定	21.73	25.26	260	5,649.80	6,567.60	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股锁定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股锁定	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定	21.28	29.49	95	2,021.60	2,801.55	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	955	17,810.75	17,810.75	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股锁定	18.65	18.65	107	1,995.55	1,995.55	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定	29.02	25.36	78	2,263.56	1,978.08	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股锁定	72.46	68.06	35	2,536.10	2,382.10	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股锁定	26.00	37.49	106	2,756.00	3,973.94	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股锁定	19.18	22.66	118	2,263.24	2,673.88	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股锁定	38.18	38.90	58	2,214.44	2,256.20	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股锁定	23.35	25.13	89	2,078.15	2,236.57	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股锁定	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股锁定	22.66	15.89	307	6,956.62	4,878.23	-

688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定	19.86	42.51	230	4,567.80	9,777.30	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定	86.96	174.93	81	7,043.76	14,169.33	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股锁定	15.69	18.79	397	6,228.93	7,459.63	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格、合格境外机构投资者托管人资格或其他经管理人评估资质良好的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-

A-1 以下	-	-
未评级	3,032,192.05	-
合计	3,032,192.05	-

注：1. 本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

2. 未评级债券为期限在一年以内的国债、政策银行债、央行票据及未有第三方机构评级的信用债。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	10,156,950.69	13,857,244.93
合计	10,156,950.69	13,857,244.93

注：1. 本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

2. 未评级债券为期限大于一年的国债、政策银行债、央行票据及未有第三方机构评级的信用债。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,445,921.59	-	-	-	9,445,921.59
结算备付金	2,138,410.68	-	-	-	2,138,410.68
存出保证金	20,817.85	-	-	-	20,817.85
交易性金融资产	13,189,142.74	-	-	-193,659,806.77	206,848,949.51
应收股利	-	-	-	452,086.08	452,086.08
应收申购款	-	-	-	10,024.56	10,024.56
资产总计	24,794,292.86	-	-	-194,121,917.41	218,916,210.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	474,665.08	474,665.08
应付管理人报酬	-	-	-	225,544.27	225,544.27
应付托管费	-	-	-	37,590.69	37,590.69
应付清算款	-	-	-	11.95	11.95
应付销售服务费	-	-	-	24,361.19	24,361.19
其他负债	-	-	-	122,508.73	122,508.73
负债总计	-	-	-	884,681.91	884,681.91
利率敏感度缺口	24,794,292.86	-	-	-193,237,235.50	218,031,528.36
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,050,640.50	-	-	-	6,050,640.50
结算备付金	63,979.41	-	-	-	63,979.41
存出保证金	24,844.10	-	-	-	24,844.10
交易性金融资产	13,857,244.93	-	-	-225,093,955.25	238,951,200.18
应收申购款	-	-	-	46,023.52	46,023.52
应收清算款	-	-	-	1,929,113.04	1,929,113.04
资产总计	19,996,708.94	-	-	-227,069,091.81	247,065,800.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	327,266.02	327,266.02
应付管理人报酬	-	-	-	253,537.39	253,537.39
应付托管费	-	-	-	42,256.23	42,256.23
应付清算款	-	-	-	2,798,996.91	2,798,996.91
应付销售服务费	-	-	-	27,572.78	27,572.78
其他负债	-	-	-	211,594.00	211,594.00
负债总计	-	-	-	3,661,223.33	3,661,223.33
利率敏感度缺口	19,996,708.94	-	-	-223,407,868.48	243,404,577.42

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金资产净值的比例为 6.05%（上年

度末：5.69%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产或负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	50,990,336.38	-	50,990,336.38
应收股利	-	452,086.08	-	452,086.08
资产合计	-	51,442,422.46	-	51,442,422.46
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	51,442,422.46	-	51,442,422.46
项目	上年度末 2023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	-	43,860,558.64	-	43,860,558.64
资产合计	-	43,860,558.64	-	43,860,558.64
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净	-	43,860,558.64	-	43,860,558.64

额				
---	--	--	--	--

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	2,572,121.12	2,193,027.93
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-2,572,121.12	-2,193,027.93	

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	193,659,806.77	88.82	225,093,955.25	92.48
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	193,659,806.77	88.82	225,093,955.25	92.48

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升5%	16,930,766.57	17,423,523.05
	2. 业绩比较基准下降5%	-16,930,766.57	-17,423,523.05

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	193,468,346.87	224,294,959.20
第二层次	13,208,949.04	13,857,244.93
第三层次	171,653.60	798,996.05

合计	206,848,949.51	238,951,200.18
----	----------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	193,659,806.77	88.46
	其中：股票	193,659,806.77	88.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,189,142.74	6.02
	其中：债券	13,189,142.74	6.02
	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	11,584,332.27	5.29
8	其他各项资产	482,928.49	0.22
9	合计	218,916,210.27	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 50,990,336.38 元，占期末净值比例为 23.39%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	95,588,809.96	43.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,014,397.00	1.38
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,690,843.40	4.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	191,592.91	0.09
J	金融业	34,168,693.76	15.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,419.12	0.00
M	科学研究和技术服务业	12,714.24	0.01
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	142,669,470.39	65.44

7.2.2 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（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	10,951,064.78	5.02
消费者常用品	-	-
能源	10,222,016.00	4.69
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	25,418,138.00	11.66
公用事业	-	-

房地产	4,399,117.60	2.02
合计	50,990,336.38	23.39

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	50,000	16,994,101.60	7.79
2	600036	招商银行	400,000	13,676,000.00	6.27
3	300750	宁德时代	70,000	12,602,100.00	5.78
4	002142	宁波银行	550,000	12,133,000.00	5.56
5	03690	美团-W	108,000	10,951,064.78	5.02
6	00883	中国海洋石油	500,000	10,222,016.00	4.69
7	002648	卫星化学	500,000	8,990,000.00	4.12
8	002050	三花智控	464,100	8,855,028.00	4.06
9	603899	晨光股份	270,000	8,445,600.00	3.87
10	01024	快手-W	200,000	8,424,036.40	3.86
11	300782	卓胜微	99,100	7,704,034.00	3.53
12	601100	恒立液压	160,000	7,452,800.00	3.42
13	002271	东方雨虹	500,000	6,170,000.00	2.83
14	603565	中谷物流	699,988	6,117,895.12	2.81
15	603868	飞科电器	150,000	5,760,000.00	2.64
16	603288	海天味业	149,932	5,168,156.04	2.37
17	300751	迈为股份	41,000	4,898,680.00	2.25
18	06098	碧桂园服务	1,000,000	4,399,117.60	2.02
19	300059	东方财富	399,971	4,223,693.76	1.94
20	601318	中国平安	100,000	4,136,000.00	1.90
21	002352	顺丰控股	100,000	3,569,000.00	1.64
22	600970	中材国际	249,950	3,014,397.00	1.38
23	000625	长安汽车	220,000	2,954,600.00	1.36
24	300760	迈瑞医疗	10,000	2,909,100.00	1.33
25	300957	贝泰妮	60,000	2,899,200.00	1.33
26	688008	澜起科技	50,000	2,858,000.00	1.31
27	600298	安琪酵母	100,000	2,793,000.00	1.28
28	600276	恒瑞医药	60,000	2,307,600.00	1.06
29	300769	德方纳米	44,944	1,267,420.80	0.58
30	300122	智飞生物	30,000	840,900.00	0.39
31	688692	达梦数据	802	175,947.31	0.08
32	301536	星辰科技	3,767	130,985.29	0.06
33	301392	汇成真空	2,189	128,899.54	0.06
34	301565	中仑新材	4,694	115,238.68	0.05
35	301580	爱迪特	1,313	99,875.96	0.05
36	603381	永臻股份	889	24,636.57	0.01

37	603285	键邦股份	1,062	19,806.30	0.01
38	301538	骏鼎达	141	12,864.84	0.01
39	301508	中机认检	344	12,714.24	0.01
40	301526	国际复材	3,731	12,424.23	0.01
41	301516	中远通	604	11,252.52	0.01
42	688691	灿芯股份	230	9,777.30	0.00
43	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
44	301413	安培龙	213	8,807.55	0.00
45	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
46	688652	京仪装备	191	7,466.19	0.00
47	688709	成都华微	397	7,459.63	0.00
48	301459	丰茂股份	186	7,386.06	0.00
49	688653	康希通信	569	7,328.72	0.00
50	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
51	688720	艾森股份	165	6,689.10	0.00
52	688648	中邮科技	303	6,617.52	0.00
53	301587	中瑞股份	260	6,567.60	0.00
54	301568	思泰克	203	6,459.46	0.00
55	001389	广合科技	176	6,082.56	0.00
56	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
57	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
58	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
59	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
60	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
61	688584	上海合晶	307	4,878.23	0.00
62	603341	龙旗科技	106	3,973.94	0.00
63	601083	锦江航运	413	3,948.28	0.00
64	603193	润本股份	177	3,255.03	0.00
65	001359	平安电工	140	2,884.00	0.00
66	603082	北自科技	95	2,801.55	0.00
67	603344	星德胜	118	2,673.88	0.00
68	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
69	001239	永达股份	189	2,623.32	0.00
70	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
71	603325	博隆技术	35	2,382.10	0.00
72	603375	盛景微	58	2,256.20	0.00
73	603004	鼎龙科技	130	2,203.50	0.00
74	603312	西典新能	78	1,978.08	0.00
75	001358	兴欣新材	95	1,949.40	0.00
76	603231	索宝蛋白	114	1,942.56	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	06098	碧桂园服务	9,508,439.28	3.91
2	00883	中国海洋石油	7,730,600.18	3.18
3	300751	迈为股份	5,914,506.00	2.43
4	603288	海天味业	5,488,292.84	2.25
5	000625	长安汽车	3,666,361.00	1.51
6	600970	中材国际	3,097,546.00	1.27
7	300059	东方财富	2,543,385.12	1.04
8	002230	科大讯飞	2,208,593.00	0.91
9	300122	智飞生物	1,267,907.00	0.52
10	688692	达梦数据	69,741.92	0.03
11	688584	上海合晶	69,566.20	0.03
12	688709	成都华微	62,289.30	0.03
13	301536	星宸科技	60,874.72	0.03
14	301580	爱迪特	59,019.35	0.02
15	301587	中瑞股份	56,454.54	0.02
16	301538	骏鼎达	55,875.82	0.02
17	301565	中仑新材	55,764.72	0.02
18	688691	灿芯股份	45,618.42	0.02
19	301591	肯特股份	42,435.12	0.02
20	688695	中创股份	41,630.08	0.02

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	00700	腾讯控股	7,410,504.08	3.04
2	300760	迈瑞医疗	7,310,867.00	3.00
3	002648	卫星化学	7,301,298.60	3.00
4	01024	快手-W	6,019,771.90	2.47
5	000786	北新建材	5,569,894.00	2.29
6	002001	新和成	5,226,694.00	2.15
7	000338	潍柴动力	5,030,638.00	2.07
8	601012	隆基绿能	3,811,022.00	1.57
9	06098	碧桂园服务	3,303,546.84	1.36
10	002920	德赛西威	2,826,760.00	1.16
11	002230	科大讯飞	1,994,359.00	0.82
12	603899	晨光股份	1,834,977.10	0.75
13	600298	安琪酵母	1,779,672.00	0.73
14	600036	招商银行	1,492,675.00	0.61
15	301591	肯特股份	121,179.50	0.05
16	688691	灿芯股份	100,249.50	0.04

17	688709	成都华微	86,287.95	0.04
18	301538	骏鼎达	84,891.00	0.03
19	301539	宏鑫科技	79,981.52	0.03
20	001389	广合科技	73,243.32	0.03

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	42,473,883.73
卖出股票收入（成交）总额	62,632,647.37

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。

7.5 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	13,189,142.74	6.05
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	13,189,142.74	6.05

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019693	22 国债 28	100,000	10,156,950.69	4.66
2	019733	24 国债 02	30,000	3,032,192.05	1.39

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以套期保值为目的，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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，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，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债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国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	20,817.85
2	应收清算款	-
3	应收股利	452,086.08
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,024.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	482,928.49

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
国富价值成长一年持有期混合 A	1,047,288	187.53	-	-	196,393,524.43	100.00
国富价值成长一年持有期混合 C	3,159	30,185.92	-	-	95,357,336.04	100.00
合计	1,050,447	277.74	-	-	291,750,860.47	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	国富价值成长一年持有期混合 A	106,237.21	0.054094
	国富价值成长一年持有期混合 C	5,020.68	0.005265
	合计	111,257.89	0.038135

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国富价值成长一年持有期混合 A	10~50
	国富价值成长一年持有期混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国富价值成长一年持有期混合 A	0
	国富价值成长一年持有期混合 C	0

	合 C	
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富价值成长一年持有期混合 A	国富价值成长一年持有期混合 C
基金合同生效日 (2020 年 11 月 4 日) 基金份额总额	558,082,315.09	336,801,922.80
本报告期期初基金份额总额	208,398,367.69	104,029,660.02
本报告期基金总申购份额	3,599,218.30	422,686.20
减：本报告期基金总赎回份额	15,604,061.56	9,095,010.18
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	196,393,524.43	95,357,336.04

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(一) 基金管理人重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人无重大人事变动。

(二) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	2	88,165,462.71	84.73	67,200.16	82.81	-
国海证券	3	15,892,815.08	15.27	13,952.15	17.19	-
川财证券	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，本基金交易单元无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
广发证券	26,656,646.00	100.00	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	国海富兰克林基金管理有限公司关于住所变更的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 1 月 20 日
2	富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 1 月 22 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	2024 年 1 月 22 日
4	国海富兰克林基金管理有限公司关于终止浦领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	2024 年 2 月 7 日
5	关于增加上海中正达广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	2024 年 3 月 23 日
6	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	2024 年 3 月 30 日
7	富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 3 月 30 日
8	富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 4 月 22 日
9	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	2024 年 4 月 22 日
10	关于增加北京创金启富基金销售有限公司为国海富兰克林基金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	2024 年 5 月 24 日
11	富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金（国富价值成长一年持有期混合 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	2024 年 6 月 26 日
12	富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金（国富价值成长一年持有期混合 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	2024 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于公司治理风险、流动性风险、退市风险、股价波动风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海价值成长一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

国海富兰克林基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日