

富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金  
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国富中小盘股票
基金主代码	450009
交易代码	450009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 11 月 23 日
报告期末基金份额总额	1,745,124,109.07 份
投资目标	本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票，力求在有效控制风险的前提下，获得基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过分析宏观经济状况、资产估值水平和市场特征等因素，仅在上述资产配置范围内适度调整股票、债券、货币市场工具和其他法律法规允许的金融工具的投资比例。在股票投资上，基金在资产配置范围相对固定的情况下，主要采用精选个股和行业优化的投资策略，挖掘并投资于具有良好治理结构、成长性好、估值合理及具有巨大发展潜力的中小市值上市公司。本基金的债券投资为股票投资不易实施预定投资策略时的防守性措施。 本基金也可投资权证。
业绩比较基准	中证 700 指数收益率×90%+银行同业存款利率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于较高风险收益特征的证券投资基金。
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年7月1日—2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	202,347,794.71
2. 本期利润	-354,725,823.82
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1732
4. 期末基金资产净值	4,644,924,571.78
5. 期末基金份额净值	2.662

注：

1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或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水平要低于所列数字。
2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 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

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	-5.77%	1.07%	0.59%	1.06%	-6.36%	0.01%
过去六个月	-3.83%	0.94%	9.80%	0.93%	-13.63%	0.01%
过去一年	21.33%	1.10%	12.97%	1.05%	8.36%	0.05%
过去三年	112.86%	1.26%	52.11%	1.32%	60.75%	-0.06%
过去五年	144.33%	1.13%	23.64%	1.18%	120.69%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	381.08%	1.48%	37.47%	1.43%	343.61%	0.05%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

国富中小盘股票基金份额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 2010 年 11 月 23 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵晓东	公司权益投资总监、职工监事，国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金、国富弹性市值混合基金、国富恒瑞债券基金、国富基本面优选混合基金、国富兴海回报混合基金及国富竞争优势三年持有期混合基金的基金经理	2010年11月23日	-	18年	赵晓东先生，香港大学 MBA。历任淄博矿业集团项目经理，浙江证券分析员，上海交大高新技术股份有限公司高级投资经理，国海证券有限责任公司行业研究员，国海富兰克林基金管理有限责任公司研究员、高级研究员、国富弹性市值混合基金及国富潜力组合混合基金的基金经理助理、国富沪深 300 指数增强基金的基金经理、国海富兰克林基金管理有限责任公司 QDII 投资总监。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限责任公司权益投资总监、职工监事，国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金、国富弹性市值混合基金、国富恒瑞债券基金、国富基本面优选混合基金、国富兴海回报混合基金及国富竞争优势三年持有期混合基金的基金经理。

注：

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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《富兰克林国海中小盘股票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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配、信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》，严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

##### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，市场普遍出现回暖，但分化较大，创业板走势明显好于沪深 300 指数。三季度中证 700 上涨 1.49%，沪深 300 指数下跌 6.25%，创业板指数下跌 4.74%，市场的表现上，新能源汽车产业链，煤炭等大宗商品板块表现较好，金融等蓝筹公司表现依然不佳。三季度中国经济走势平稳，出口超预期，受地产政策影响，消费和投资依然未见大的起色，国内货币政策整体偏宽松。海外市场三季度依然强势，海外经济恢复强劲。

截止 9 月底，基金总体维持了较高的权益仓位，组合结构整体变化不大。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 2.662 元，本报告期份额净值下跌 5.77%，同期

业绩比较基准上涨 0.59%，跑输业绩基准 6.36%，业绩落后的原因主要来自金融配置偏高，成长股配置较少和个股表现不佳。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	4,136,156,140.54	87.76
	其中：股票	4,136,156,140.54	87.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	310,364,756.20	6.58
	其中：债券	310,364,756.20	6.58
	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	256,861,100.27	5.45
8	其他资产	9,844,593.52	0.21
9	合计	4,713,226,590.53	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	22,782.76	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,998,956,477.95	43.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	51,029,390.20	1.10
E	建筑业	38,297.80	0.00
F	批发和零售业	98,588.90	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	43,380.37	0.00
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	264,585,674.16	5.70
J	金融业	1,220,904,041.30	26.28
K	房地产业	515,586,953.46	11.10
L	租赁和商务服务业	13,391.91	0.00

M	科学研究和技术服务业	84,761,453.14	1.82
N	水利、环境和公共设施管理业	88,765.14	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,707.31	0.00
R	文化、体育和娱乐业	15,891.02	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,136,156,140.54	89.05

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”。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未通过港股通交易机制投资港股。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601966	玲珑轮胎	9,882,688	348,463,578.88	7.50
2	000338	潍柴动力	18,000,120	305,516,205.39	6.58
3	600016	民生银行	70,800,000	276,828,000.00	5.96
4	601166	兴业银行	13,566,618	248,269,109.40	5.34
5	688018	乐鑫科技	962,705	201,503,783.55	4.34
6	600298	安琪酵母	3,848,180	193,063,190.60	4.16
7	601009	南京银行	20,011,727	181,106,129.35	3.90
8	603899	晨光文具	2,512,974	170,831,972.52	3.68
9	600036	招商银行	3,285,390	165,747,925.50	3.57
10	600383	金地集团	13,800,859	154,569,620.80	3.33

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,691,749.80	0.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	220,234,000.00	4.74
	其中：政策性金融债	220,234,000.00	4.74
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）	88,439,006.40	1.90
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	310,364,756.20	6.68

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	210201	21 国开 01	1,400,000	140,084,000.00	3.02
2	190202	19 国开 02	600,000	60,138,000.00	1.29
3	113050	南银转债	399,840	46,125,542.40	0.99
4	110059	浦发转债	390,000	40,524,900.00	0.87
5	210206	21 国开 06	200,000	20,012,000.00	0.43

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	792,357.77
2	应收证券清算款	39,499.44
3	应收股利	-
4	应收利息	4,133,955.89
5	应收申购款	4,878,780.42
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	9,844,593.52

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	40,524,900.00	0.87
2	113044	大秦转债	1,788,564.00	0.04

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000338	潍柴动力	80,341,467.03	1.73	非公开发行的股份锁定

**§ 6 开放式基金份额变动**

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,235,206,282.74
报告期期间基金总申购份额	424,489,929.36
减：报告期期间基金总赎回份额	914,572,103.03
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,745,124,109.07

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本公司管理的该基金的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本公司管理的该基金的情况。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 影响投资者决策的其他重要信息

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

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 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)。

### 9.3 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

2021 年 10 月 27 日