富兰克林国海中证A100指数增强型证券投资基金（LOF）
2026年第3季度报告

2026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：2026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约定，于2026年10月23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2026年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富中证A100指数增强（LOF）
场内简称	国富中证A100LOF
基金主代码	164508
交易代码	164508
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2015年3月26日
报告期末基金份额总额	25,968,607.34份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金。通过量化风险管理方法，控制基金投资组合与标的指数构成的偏差，同时采取适当的增强策略，在严格控制跟踪误差风险的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期增值。在正常市场情况下，本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。
投资策略	本基金基于被动复制的指数化投资方法，在严格控制跟踪误差风险的基础上，适度运用资产配置调整、行业配置调整、指数成份股权重优化等主动增强策略，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。在资产配置上，本基金采取指数增强策略。为控制基金的跟踪误差风险，本基金的资产配置将保持与业绩比较基准基本一致，只在股票、债券（主要是国债）、现金等各大类资产间进行小幅度的主动调整，追求适度超越业绩比较基准的收益目标。在股票投资上，为严格控制跟踪误差风险，本基金的股票投资以被动复制跟踪标的指数为主，辅以适度的增强策略。在债券投资上，本基金债券投资的主要目的是在保证基金资产流动性的前提下，提高基金资产的投资收益。 本基金也可进行股指期货投资。

业绩比较基准	中证A100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，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

注：根据《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》和《关于富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金5年分级运作期届满与基金份额转换的公告》，本基金基金合同生效后5年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金(LOF)，本基金转型日为2020年3月26日，自2020年3月27日（基金转型后首个运作日）起基金名称变更为“富兰克林国海中证100指数增强型证券投资基金(LOF)”。因标的指数名称变更，自2024年10月28日起，富兰克林国海中证100指数增强型证券投资基金（LOF）相应更名为富兰克林国海中证A100指数增强型证券投资基金（LOF）。

§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（2026年7月1日 - 2026年9月30日）
1.本期已实现收益	674,247.75
2.本期利润	-4,768,082.46
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1833
4.期末基金资产净值	32,056,426.14
5.期末基金份额净值	1.234

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	-12.98%	1.47%	-13.41%	1.34%	0.43%	0.13%

过去六个月	-1.83%	1.41%	-3.22%	1.33%	1.39%	0.08%
过去一年	-4.19%	1.23%	-6.60%	1.18%	2.41%	0.05%
过去三年	17.64%	1.11%	17.85%	1.13%	-0.21%	-0.02%
过去五年	-9.40%	1.08%	-10.64%	1.11%	1.24%	-0.03%
自基金合同生效起至今	19.23%	1.12%	10.72%	1.13%	8.51%	-0.01%

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



注：本基金已在转换基准日 2020 年 3 月 26 日日终转换为上市开放式基金（LOF）。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		
张志强	本基金的基金经理，量化与指数投资总监、金融工程部总经理	2015 年 3 月 26 日	-	23 年	CFA，硕士。历任美国 Enreach Technology Inc. 软件工程师，海通证券股份有限公司研究所高级研究员，友邦华泰基金管理有限公司高级数量分析师，国海富兰克林基金管理有限公司首席数量分析师、风险控制部总经理、业务发展部总经理、兼任投资经理、职工监事。截至本报告期末任国

					海富兰克林基金管理有限公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理，国富沪深300指数增强基金、国富中证A100指数增强（LOF）基金、国富国证港股通科技指数基金、国富北证50成份指数发起式基金及国富标普港股通低波红利指数发起式基金的基金经理。

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《富兰克林国海中证A100指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》的约定，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交易所公开竞价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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026年三季度，在全球科技股一度出现较大幅度下跌的背景下，A股市场也呈现回调态势。风格方面，价值和红利优势明显。行业方面，煤炭、石油石化、农林牧渔、银行、保险、医药生物、房地产等行业取得较大幅度上涨，而电子、通信、建筑材料、电力设备、基础化工、国防军工、有色金属等行业跌幅较大。本季度中证A100指数下跌了14.09%。

三季度，中国制造业PMI指数逐月上行，3个月PMI值分别为49.2、49.8、50.1。生产端呈

现同样特征，但需求端恢复较弱，供需不平衡的状况未见明显改善。流动性方面，季初资金面未如预期宽松，资金利率中枢甚至较前期有所抬升；但在央行持续的流动性支持下，市场总体维持了合理宽松的局面，此后资金面基本保持平稳。季末，央行宣布结构性降息，将PSL利率调降了0.25%。A股方面，受前期热点板块大幅回调的影响，市场交易热度呈现下降趋势，观望气氛较浓。外部环境方面，美国重新进入加息周期，伊朗、也门地区冲突此起彼伏，对全球风险资产形成一定压制。短期而言，市场或延续震荡格局。中期来看，本轮科技周期或仍处于成长期，国内流动性环境和政策环境较好，顺应科技产业发展趋势、满足新质生产力要求、符合国家经济发展大战略的人工智能基础设施建设和应用、半导体芯片等核心科技产业、高端制造业等或具备较好的投资价值。

报告期内，本基金在保持均衡的组合配置以控制主动投资风险的前提下，继续使用量化选股模型精选个股、构建投资组合，取得了一定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要财务指标”及“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”部分披露。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于五千万元，因前述情形，经公司决策，自2024年7月1日起，由基金管理人承担本基金项下相关固定费用。

§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	29,399,044.32	91.61
	其中：股票	29,399,044.32	91.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,925,404.30	6.00
	其中：债券	1,925,404.30	6.00
	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	761,437.00	2.37

8	其他资产	7,227.60	0.02
9	合计	32,093,113.22	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	116,313.00	0.36
B	采矿业	2,086,506.00	6.51
C	制造业	19,342,745.82	60.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	549,045.00	1.71
E	建筑业	182,789.60	0.57
F	批发和零售业	24,921.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	478,596.00	1.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	964,038.23	3.01
J	金融业	3,109,279.00	9.70
K	房地产业	242,269.51	0.76
L	租赁和商务服务业	51,440.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	1,173,388.08	3.66
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	41,065.08	0.13
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,362,396.32	88.48

5.2.2 报告期末积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	875,625.00	2.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,112.00	0.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	89,884.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	38,813.00	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,552.00	0.00
J	金融业	4,662.00	0.01

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	1,036,648.00	3.23

5.2.3 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	300308	中际旭创	2,640	2,134,281.60	6.66
2	300750	宁德时代	5,760	1,676,793.60	5.23
3	600519	贵州茅台	1,077	1,355,533.74	4.23
4	601318	中国平安	22,300	1,188,367.00	3.71
5	603259	药明康德	7,012	1,173,388.08	3.66
6	300502	新易盛	2,800	1,089,200.00	3.40
7	600036	招商银行	24,000	990,240.00	3.09
8	601899	紫金矿业	27,800	828,162.00	2.58
9	000333	美的集团	9,900	792,990.00	2.47
10	603986	兆易创新	2,100	743,190.00	2.32

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	301536	星宸科技	1,200	148,032.00	0.46
2	301377	鼎泰高科	400	136,400.00	0.43
3	300765	石药创新	2,100	99,099.00	0.31
4	000893	亚钾国际	2,000	73,680.00	0.23
5	300475	香农芯创	400	61,296.00	0.19

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	1,925,404.30	6.01

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	1,925,404.30	6.01

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	019792	25国债19	19,000	1,925,404.30	6.01

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与股指期货交易，以提高投资管理效率，降低跟踪误差风险。

本基金参与股指期货交易，将采用流动性好、交易活跃的合约，以高效调整股票仓位。此外，在预期大额申购赎回、大额分红等情形发生时，本基金可以通过参与股指期货交易进行有效的现金头寸管理，同时达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金参与股指期货交易，将严格遵循有关法律法规要求，遵循本基金管理人制定的相关投资决策流程和风险控制制度，事前将交易方案提交本基金管理人的股指期货投资决策小组审核通

过，在股指期货投资决策小组核定的范围内进行。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

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约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	4,110.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,117.09
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,227.60

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	26,057,615.58
报告期期间基金总申购份额	283,712.03
减：报告期期间基金总赎回份额	372,720.27
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	25,968,607.34

§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 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
个人	1	20260701-20260930	13,735,347.99	-	-	13,735,347.99	52.89
产品特有风险							
1.流动性风险 投资者大额赎回所持有的基金份额时，为了实现基金资产的迅速变现，在基金交易过程中可能存在无法实现交易价格最优；亦或导致基金仓位调整困难，基金资产不能迅速转变成现金，产生流动性风险。 一旦引发巨额赎回，当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，可能出现比例赎回、延期支付赎回款等情形。 管理人有权根据本基金合同和招募说明书的约定，基于投资者保护原则，暂停或拒绝申购、暂停赎回。 2.估值风险 投资者大额赎回所持有的基金份额时，基金份额净值可能受到尾差和部分赎回费归入基金资							

产的影响，从而导致非市场因素的净值异常波动。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金设立的文件；

2、本基金基金合同；

3、本基金招募说明书；

4、本基金托管协议；

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。

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 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

2026年10月27日