

富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金
2023 年第 3 季度报告

2023 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：2023 年 10 月 25 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 2023 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 2023 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
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	1,594,328,968.31 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

下属分级基金的基金简称	国富中小盘股票 A	国富中小盘股票 C
下属分级基金的交易代码	450009	017948
报告期末下属分级基金的份额总额	1,548,076,092.97 份	46,252,875.34 份

§ 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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	国富中小盘股票 A	国富中小盘股票 C
1. 本期已实现收益	-49,453,277.93	-1,422,834.41
2. 本期利润	-89,913,967.55	-3,104,319.93
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0566	-0.0829
4. 期末基金资产净值	3,779,153,169.47	112,701,921.43
5. 期末基金份额净值	2.4412	2.4366

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

国富中小盘股票 A

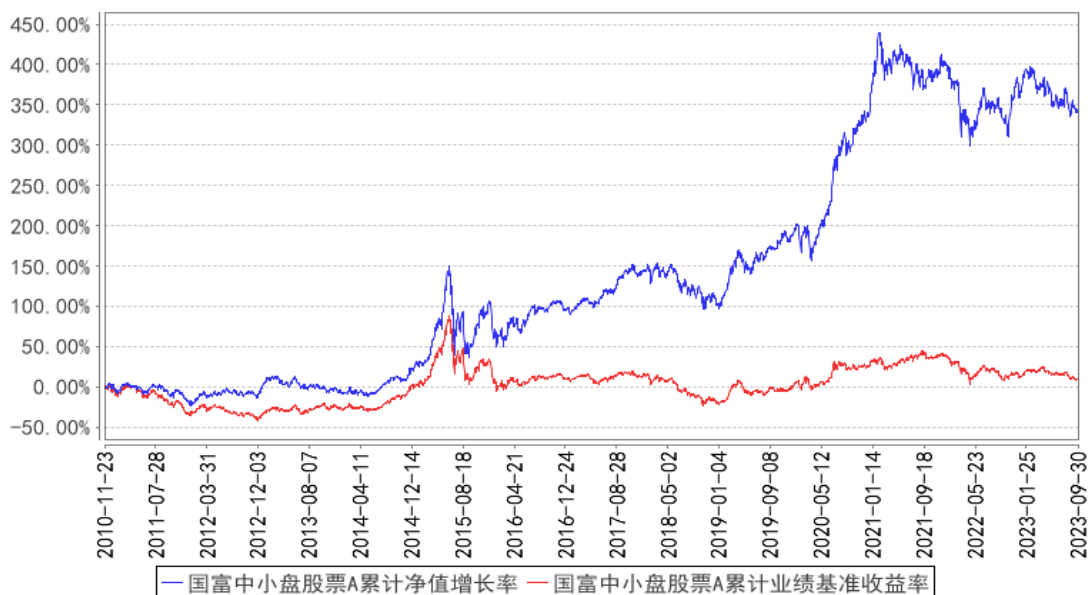
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.42%	0.76%	-5.17%	0.78%	2.75%	-0.02%
过去六个月	-6.86%	0.80%	-9.27%	0.79%	2.41%	0.01%
过去一年	1.17%	0.88%	-0.12%	0.81%	1.29%	0.07%
过去三年	11.27%	1.04%	-9.20%	1.01%	20.47%	0.03%
过去五年	95.20%	1.16%	22.26%	1.20%	72.94%	-0.04%
自基金合同生效起至今	341.17%	1.41%	10.50%	1.37%	330.67%	0.04%

国富中小盘股票 C

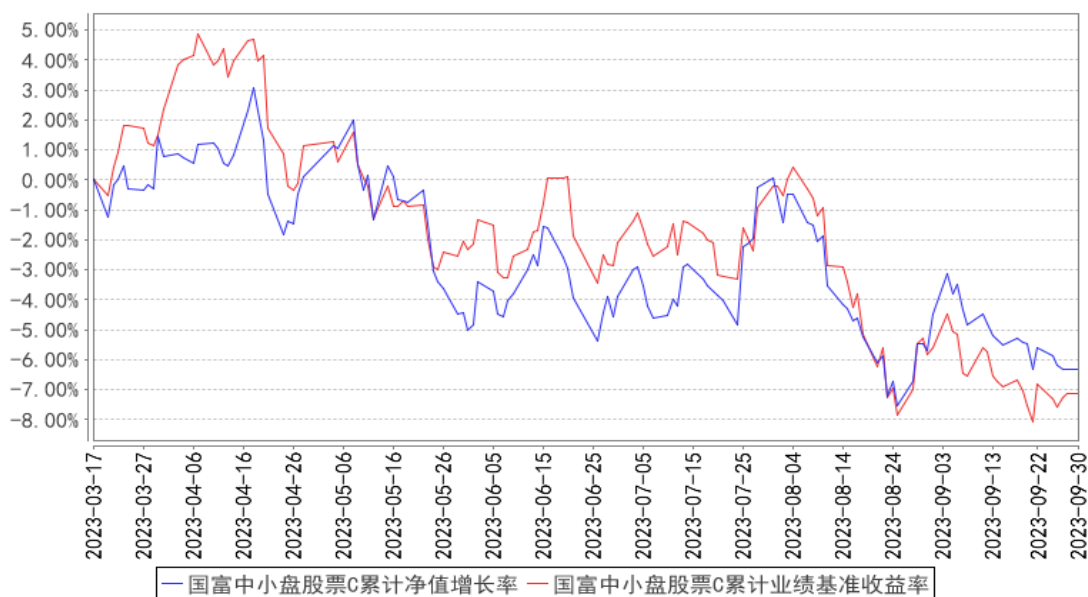
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.52%	0.76%	-5.17%	0.78%	2.65%	-0.02%
过去六个月	-7.04%	0.80%	-9.27%	0.79%	2.23%	0.01%
自增设 C 类份额至今	-6.31%	0.80%	-7.14%	0.77%	0.83%	0.03%

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



国富中小盘股票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 2010 年 11 月 23 日，并于 2023 年 3 月 17 日增设 C 类份额。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

§ 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	-	20 年	赵晓东先生，香港大学 MBA。历任淄博矿业集团项目经理，浙江证券分析师，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 指数增强基金及国富焦点驱动混合基金的基金经理、国海富兰克林基金管理有限公司 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公司权益投资总监、职工监事，国富中小盘股票基金、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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，国内经济依然处在复苏期，经济数据缓慢向好。房地产竣工数据符合预期，但新开工还没有大的起色；基建投资平稳增长；制造业维持稳定。出口数据符合预期，前三季度数据总体平稳向好。消费数据缓慢恢复，尤其航空，旅游和住宿等表现亮眼，高端消费有增速下滑的态势，但中低端消费形势有加速向好的趋势。

三季度资本市场，继续维持震荡的态势。宽基大盘指数表现好于小盘指数。前期表现较好的人工智能等板块回调较大，大盘蓝筹的分红板块走势明显强于其他板块。从市场的情绪看，投资者参与度不高，可能等待更明确的经济复苏数据或者更大力度的财政或货币政策。

本组合继续维持二季度以来的配置，以大金融和消费板块为主，半导体、机械和资源等经济增长受益的板块为辅，大部分公司以行业龙头为主。权益仓位保持相对较高。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 9 月 30 日,本基金 A 类份额净值为 2.4412 元,本报告期内份额净值下跌 2.42%,同期业绩基准下跌 5.17%,跑赢业绩比较基准 2.75%。本基金 C 类份额净值为 2.4366 元,本报告期内份额净值下跌 2.52%,同期业绩基准下跌 5.17%,跑赢业绩比较基准 2.65%。

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	3,425,278,883.92	87.77
	其中:股票	3,425,278,883.92	87.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	270,363,583.84	6.93
	其中:债券	270,363,583.84	6.93
	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	100,034,775.09	2.56
	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	97,109,405.74	2.49
8	其他资产	9,576,248.28	0.25
9	合计	3,902,362,896.87	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	-	-
B	采矿业	287,926,128.87	7.40
C	制造业	1,656,756,498.65	42.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,563.97	0.00
E	建筑业	11,369.83	0.00
F	批发和零售业	115,270.12	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	169,695,156.10	4.36
J	金融业	1,035,333,287.66	26.60
K	房地产业	143,544,762.75	3.69
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	131,806,353.28	3.39
N	水利、环境和公共设施管理业	35,307.23	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	21,185.46	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,425,278,883.92	88.01

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 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	002568	百润股份	9,381,016	270,454,691.28	6.95
2	601658	邮储银行	52,008,504	258,482,264.88	6.64
3	601128	常熟银行	32,212,191	235,793,238.12	6.06
4	601577	长沙银行	28,747,657	235,443,310.83	6.05
5	002142	宁波银行	6,006,519	161,395,165.53	4.15
6	600256	广汇能源	20,470,260	156,392,786.40	4.02
7	601155	新城控股	10,833,567	143,544,762.75	3.69
8	601699	潞安环能	6,926,453	131,533,342.47	3.38
9	000338	潍柴动力	9,868,404	123,651,102.12	3.18
10	002050	三花智控	3,698,711	109,851,716.70	2.82

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	1,890,414.71	0.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	174,082,934.25	4.47
	其中：政策性金融债	174,082,934.25	4.47
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）	94,390,234.88	2.43
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	270,363,583.84	6.95
----	----	----------------	------

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	210202	21 国开 02	1,700,000	174,082,934.25	4.47
2	110059	浦发转债	610,000	66,377,592.88	1.71
3	113062	常银转债	150,320	17,693,269.40	0.45
4	113052	兴业转债	100,000	10,319,372.60	0.27
5	019528	15 国债 28	15,660	1,890,414.71	0.05

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

根据基金合同，本基金不投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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	726,616.87
2	应收证券清算款	7,253,399.23
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,596,232.18
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	9,576,248.28

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	66,377,592.88	1.71
2	113062	常银转债	17,693,269.40	0.45
3	113052	兴业转债	10,319,372.60	0.27

5.11.5 报告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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富中小盘股票 A	国富中小盘股票 C
报告期期初基金份额总额	1,635,596,967.57	36,993,130.37
报告期期间基金总申购份额	73,919,110.65	22,446,305.09
减：报告期期间基金总赎回份额	161,439,985.25	13,186,560.12
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	1,548,076,092.97	46,252,875.34

§ 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

单位：份

项目	国富中小盘股票 A	国富中小盘股票 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	3,732,362.82	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,732,362.82	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.24	-

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

无。

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。

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

2023 年 10 月 25 日