

富兰克林国海全球科技互联混合型证券投资基金  
(QDII)  
2024 年第 3 季度报告

2024 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：2024 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2024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2024年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国富全球科技互联混合（QDII）
基金主代码	006373
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月20日
报告期末基金份额总额	424,740,248.69份
投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下，力争总回报最大化，以谋求长期保值增值。
投资策略	在股票投资上，本基金主要投资于科技互联主题的公司，本基金所指的科技互联主题相关公司指主要收入或预期收入来源于科技互联主题及相关业务的公司，在个股选择上，主要包括股票初级筛选、公司深度基本面分析、投资价值评估、投资组合构建与管理 and 投资组合的调整和优化。在债券投资上，本基金根据基金资产投资运作的具体情况，通过债券投资以达到优化流动性管理的目的。本基金将投资于境内债券及与中国证监会签订了双边监管合作谅解备忘录的国家或地区信用等级为投资级以上的债券，其投资组合以安全性、流动性和收益性为配置原则。在金融衍生品

	投资上，基金管理人在确保与基金投资目标相一致的前提下，可本着谨慎和风险可控的原则，适度投资于经中国证监会允许的各类金融衍生产品，如期权、期货、权证、远期合约、掉期等。在外汇管理上，本基金将贯彻以实现外汇管理的套期保值、有效规避人民币汇率风险为主的外汇管理政策。			
业绩比较基准	40%×MSCI 全球信息科技指数+40%×中证海外中国互联网指数+人民币活期存款利率（税后）×20%			
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。			
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	国富全球科技互联混合（QDII）人民币 A	国富全球科技互联混合（QDII）美元现汇 A	国富全球科技互联混合（QDII）人民币 C	国富全球科技互联混合（QDII）美元现汇 C
下属分级基金的交易代码	006373	006374	021842	021843
报告期末下属分级基金的份额总额	397,075,410.24份	2,484,815.04份	25,124,667.03份	55,356.38份
境外资产托管人	英文名称：JP Morgan Chase Bank, National Association 中文名称：摩根大通银行			

### § 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（2024年7月1日-2024年9月30日）		2024年7月25日（增设C类份额日）-2024年9月30日	
	国富全球科技互联混合（QDII）人民币 A	国富全球科技互联混合（QDII）美元现汇 A	国富全球科技互联混合（QDII）人民币 C	国富全球科技互联混合（QDII）美元现汇 C
1. 本期已实现收益	16,865,688.58	761,363.28	1,488,894.22	23,302.53
2. 本期利润	-14,288,993.04	127,730.59	1,721,292.57	28,401.62
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0375	0.0530	0.1142	0.8511

4. 期末基金资产净值	1,282,410,006.12	55,157,535.67	81,100,925.74	1,226,573.10
5. 期末基金份额净值	3.2296	3.1678	3.2279	3.1621

注：1. 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。

2. 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. 国富全球科技互联混合（QDII）人民币份额以人民币计价并进行申购获得人民币份额；国富全球科技互联混合（QDII）美元份额以美元计价并进行申购获得美元份额。

4. 国富全球科技互联混合（QDII）美元份额的加权平均基金份额本期利润为每份美元份额对应的利润。

5. 本基金自 2024 年 7 月 25 日起增设 C 类份额。

6. 国富全球科技互联混合（QDII）美元份额 A 类的期末基金份额净值为 3.1678 美元，折合人民币份额净值 22.1980 元；国富全球科技互联混合（QDII）美元份额 C 类的期末基金份额净值为 3.1621 美元，折合人民币份额净值 22.1581 元。

## 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

国富全球科技互联混合（QDII）人民币 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	0.17%	1.43%	9.90%	1.25%	-9.73%	0.18%
过去六个月	9.37%	1.26%	16.63%	1.15%	-7.26%	0.11%
过去一年	38.22%	1.16%	28.55%	1.03%	9.67%	0.13%
过去三年	38.21%	1.27%	18.05%	1.37%	20.16%	-0.10%
过去五年	170.17%	1.35%	58.46%	1.36%	111.71%	-0.01%
自基金合同生效起至今	222.96%	1.28%	75.58%	1.32%	147.38%	-0.04%

国富全球科技互联混合（QDII）美元现汇 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
----	--------	-----------	--------	--------	-----	-----

		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	1.88%	1.41%	9.90%	1.25%	-8.02%	0.16%
过去六个月	10.76%	1.25%	16.63%	1.15%	-5.87%	0.10%
过去一年	41.55%	1.16%	28.55%	1.03%	13.00%	0.13%
过去三年	27.83%	1.27%	18.05%	1.37%	9.78%	-0.10%
过去五年	169.00%	1.34%	58.46%	1.36%	110.54%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	216.78%	1.28%	75.58%	1.32%	141.20%	-0.04%

## 国富全球科技互联混合（QDII）人民币 C

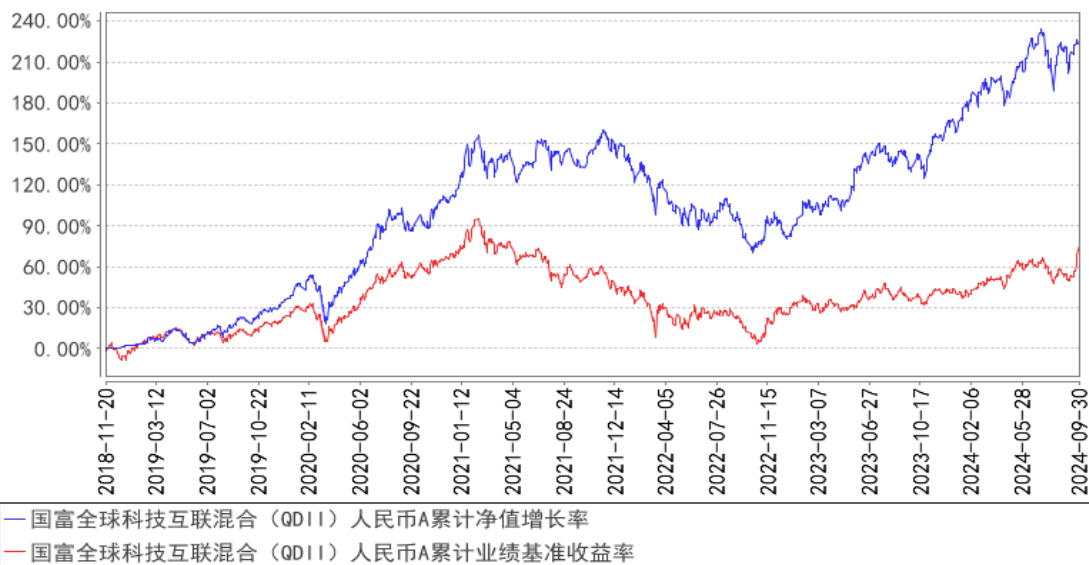
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
自增设 C 类 份额至今	5.51%	1.46%	12.15%	1.33%	-6.64%	0.13%

## 国富全球科技互联混合（QDII）美元现汇 C

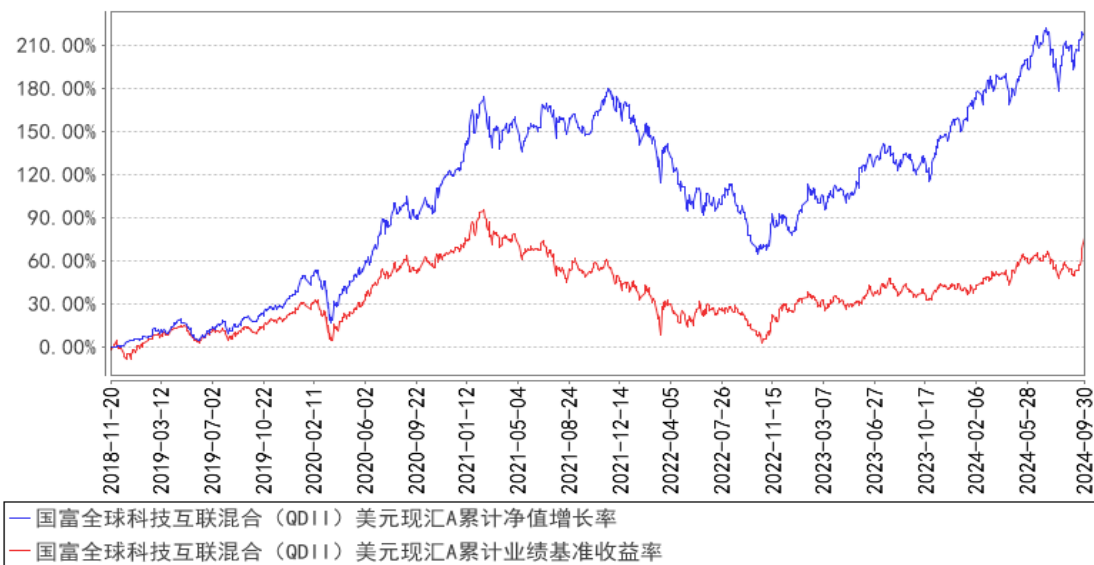
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
自增设 C 类 份额至今	7.25%	1.44%	12.15%	1.33%	-4.90%	0.11%

### 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

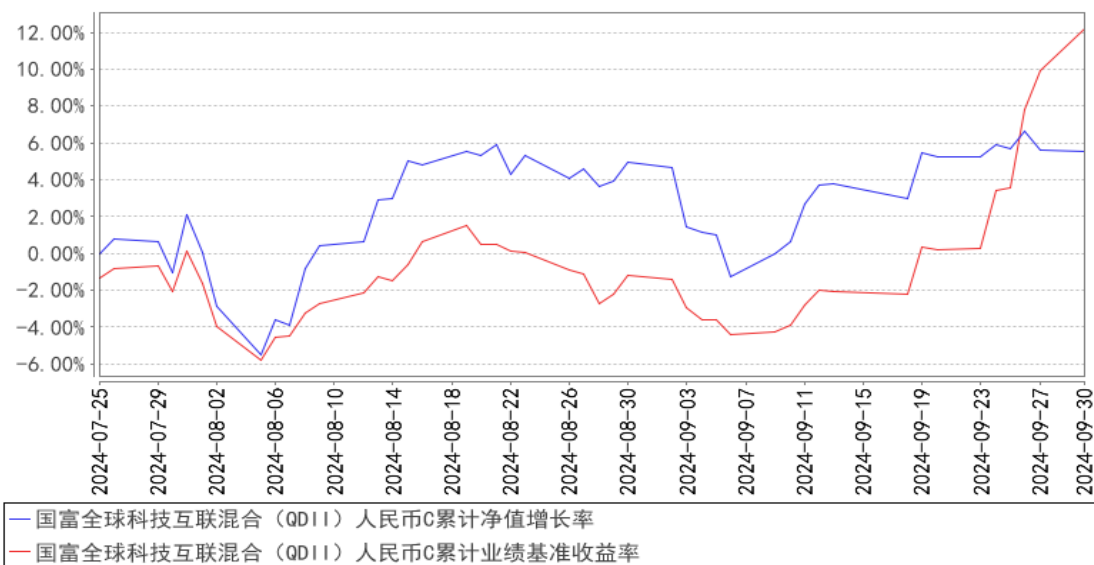
**国富全球科技互联混合 (QDII) 人民币A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



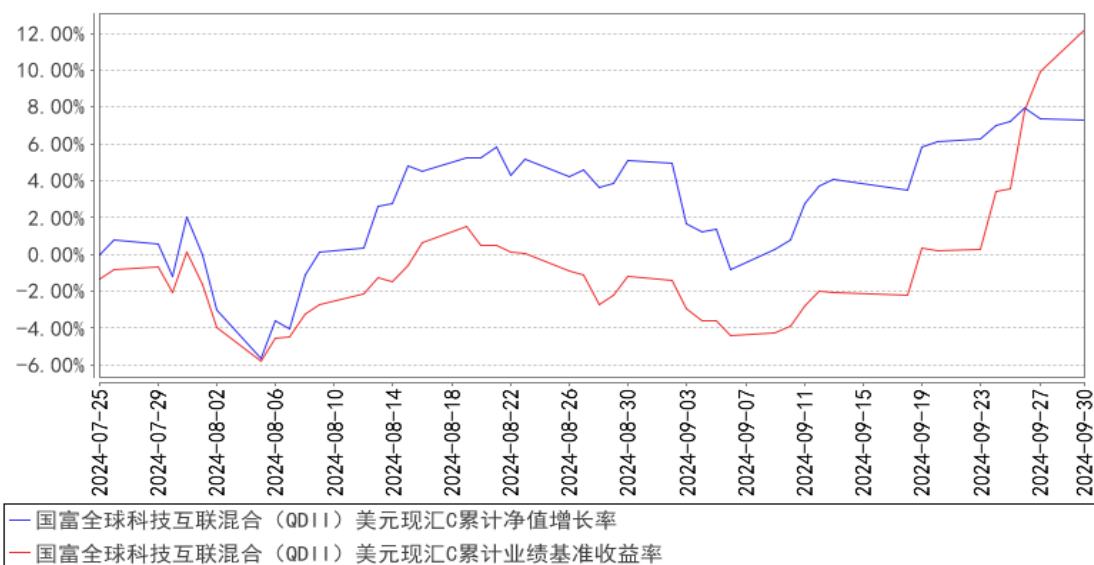
**国富全球科技互联混合 (QDII) 美元现汇A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



**国富全球科技互联混合（QDII）人民币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**



**国富全球科技互联混合（QDII）美元现汇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2018年11月20日，并于2024年7月25日增设人民币C类份额和美元现汇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		
徐成	公司QDII投资总监，国富亚洲机会	2018年11月20日	-	18年	徐成先生，CFA，朴茨茅斯大学（英国）金融决策分析硕士。历任永丰金证券（亚

	股票(QDII)基金、国富大中华精选混合(QDII)基金、国富美元债一年持有期债券(QDII)基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金、国富全球科技互联混合(QDII)基金及国富港股通远见价值混合基金的基金经理				洲)有限公司上海办事处研究员,新加坡东京海上国际资产管理有限公司上海办事处研究员、高级研究员、首席代表,国海富兰克林基金管理有限公司QDII投资副总监。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司QDII投资总监,国富亚洲机会股票(QDII)基金、国富大中华精选混合(QDII)基金、国富美元债一年持有期债券(QDII)基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金、国富全球科技互联混合(QDII)基金及国富港股通远见价值混合基金的基金经理。
狄星华	国富全球科技互联混合(QDII)基金的基金经理兼高级研究员	2018年11月20日	-	16年	狄星华女士, CFA, 上海大学世界经济硕士。历任道琼斯咨询(上海)有限公司分析师, 易唯思商务咨询有限公司高级分析师, 国海富兰克林基金管理有限公司高级研究员。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富全球科技互联混合(QDII)基金的基金经理兼高级研究员。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

## 4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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《富兰克林国海全球科技互联混合型证券投资基金（QDII）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。

## 4.4 公平交易专项说明

### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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。

#### 4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

三季度，海外市场波动明显放大。市场面对经济数字以及一系列事件时，展现了情绪化的一面。劳动力市场的表现已经取代了通货膨胀指标，成为全市场关注的焦点。主要原因是主流观点认为劳动力市场一旦衰退，或将会急速恶化，同时带来消费的减缓，进而造成市场整体的衰退。七月和八月，市场反复博弈“衰退”和“软着陆”的概率。九月初，纳斯达克单周跌幅 5.8%，这是自 2022 年 1 月以来的最差单周表现。但随着季度 GDP、非农、服务 PMI 等经济指标的超预期，市场对于衰退的担忧逐一化解。九月，联储宣布降息 50 基点。我们认为，一方面，美联储希望保持“软着陆”的局面，投资人风险偏好会获得改善，这对权益资产是相对有利的。另一方面，利率下降有利于改善中小企业的融资成本，企业的扩张意愿也会有所提高。

另外，我们觉得一直以来被诟病的美股集中度问题在慢慢得到改善，M7 屡创新高的同时，以 Russell 2000 为代表的中小盘指数也慢慢接近前高，这表明市场的深度和宽度有所改善，对我们择股也是个好消息。马上要进入美国第三季度财报季，市场普遍预期标普 500 指数成分股在第三季度盈利同比增长约 4%，较上季度 12% 的同比增长大幅放缓，我们认为存在超预期的可能性。

七月份，本基金有比较大的申购量，前期股指涨幅较大，我们没有急于建仓，因此整体仓位和个股仓位都被现金稀释，比较幸运地没有出现巨幅回撤。另外，本基金的各个板块投资相对分散，没有大仓位投资在硬件端，因此在七月份北美半导体指数 Soxx 指数出现暴跌的情况下，我们的回撤幅度也相对可控。回头来看，我们在今年五月的时候，就认为波动率会随着降息周期的开启和选举的到来而增加，但还是相对低估了第三季度的波动情况。虽说我们仍然努力加强了本基金的均衡力量，争取降低个股之间的相关度，但在宏观面完全压倒基本面的情况下，我们能做的防守相对有限。后续在股市某段时间出现非理性连续上涨或非理性巨幅下跌时，我们将更关心个股的估值安全边际，进一步避免风格过于集中的风险。这样做的好处是，在极端情况下，无论是组合抗跌能力还是基金经理的心理应对都会相对从容。

#### 4.6 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 09 月 30 日，本基金人民币 A 类份额净值为 3.2296 人民币元，报告期内份额净

值上涨 0.17%，业绩比较基准上涨 9.90%，跑输业绩比较基准 9.73%；本基金美元现汇 A 类份额净值为 3.1678 美元，报告期内份额净值上涨 1.88%，业绩比较基准上涨 9.90%，跑输业绩比较基准 8.02%；本基金人民币 C 类份额净值为 3.2279 人民币元，自成立以来份额净值上涨 5.51%，业绩比较基准上涨 12.15%，跑输业绩比较基准 6.64%；本基金美元现汇 C 类份额净值为 3.1621 美元，自成立以来份额净值上涨 7.25%，业绩比较基准上涨 12.15%，跑输业绩比较基准 4.90%。

#### 4.7 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,270,644,191.22	77.99
	其中：普通股	1,084,311,987.48	66.55
	优先股	-	-
	存托凭证	186,332,203.74	11.44
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	101,699,824.30	6.24
	其中：债券	101,699,824.30	6.24
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	199,018,803.19	12.22
8	其他资产	57,904,211.42	3.55
9	合计	1,629,267,030.13	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 59,279,165.65 元，占期末净值比例为 4.17%。

### 5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	1,097,595,739.16	77.30

中国香港	102,061,111.29	7.19
日本	70,987,340.77	5.00
合计	1,270,644,191.22	89.49

注：以上国家（地区）均按照股票及存托凭证上市交易地点进行统计。

### 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	179,802,812.44	12.66
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	70,250,306.18	4.95
医疗保健	54,631,596.41	3.85
工业	144,316,688.00	10.16
信息技术	601,284,763.06	42.35
电信服务	212,051,453.17	14.93
公用事业	8,306,571.96	0.59
房地产	-	-
合计	1,270,644,191.22	89.49

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

### 5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

#### 5.4.1 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	TSMC	台湾集成电路制造股份有限公司	TSM UN	纽约证券交易所	美国	82,500	100,400,450.54	7.07
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	33,100	99,805,907.68	7.03
3	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	100,000	85,097,865.60	5.99
4	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	60,800	79,385,881.59	5.59
5	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META US	纳斯达克证券交易所	美国	19,000	76,215,005.06	5.37
6	Eli Lilly	礼来	LLY US	纽约证券交	美国	8,800	54,631,	3.85

	& Co			易所			596.41	
7	ALPHABET INC	ALPHABET 公司	GOOG US	纳斯达克证券交易所	美国	44,500	52,134,740.67	3.67
8	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	中国香港	120,000	48,112,300.08	3.39
9	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto Networks 股份有限公司	PANW US	纳斯达克证券交易所	美国	19,400	46,465,508.81	3.27
10	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	12,700	45,065,661.53	3.17

注：上述表格“所属国家（地区）”均按照股票及存托凭证上市交易地点统计。

### 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
未评级	28,005,202.19	1.97
投资级	73,694,622.11	5.19
非投资级	-	-

注：上述债券投资组合主要适用标准普尔、穆迪、惠誉等国际权威机构评级。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	019727	23 国债 24	27,400,000	28,005,202.19	1.97
2	US912797LQ83	B 12/19/24	22,423,680	22,199,505.43	1.56
3	US912797LF29	B 12/05/24	21,022,200	20,848,477.72	1.47
4	US912797HE00	B 10/31/24	8,408,880	8,375,001.25	0.59
5	US912797MJ32	B 02/06/25	8,408,880	8,277,505.26	0.58

注：数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	132.83
2	应收证券清算款	6,178,185.06
3	应收股利	637,911.81
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,689,679.33
6	其他应收款	33,398,302.39
7	其他	-
8	合计	57,904,211.42

### 5.10.4 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。

### 5.10.5 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	国富全球科技 互联混合 (QDII)人民 币 A	国富全球科技 互联混合 (QDII)美元 现汇 A	国富全球科 技互联混合 (QDII)人民 币 C	国富全球科 技互联混合 (QDII)美元 现汇 C
报告期期初基金份额总额	294,653,219.17	2,179,788.13	-	-
报告期期间基金总申购份额	275,883,920.97	729,314.76	32,565,307.22	55,853.87
减：报告期期间基金总赎回份额	173,461,729.90	424,287.85	7,440,640.19	497.49
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	397,075,410.24	2,484,815.04	25,124,667.03	55,356.38

## § 7 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自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全球科技互联混合型证券投资基金（QDII）设立的文件；
- 2、《富兰克林国海全球科技互联混合型证券投资基金（QDII）基金合同》；
- 3、《富兰克林国海全球科技互联混合型证券投资基金（QDII）招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海全球科技互联混合型证券投资基金（QDII）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  
2024 年 10 月 25 日