

### 富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金

#### 2017 第三季度报告

2017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: 中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期: 2017年10月27日

**1.1 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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预示其未来表现,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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

**§1 基金基本情况**

|          |                     |
|----------|---------------------|
| 基金名称     | 富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金 |
| 基金代码     | 004066              |
| 基金管理人    | 富兰克林国海基金管理有限公司      |
| 基金托管人    | 中国农业银行股份有限公司        |
| 基金合同生效日期 | 2017年7月31日          |

**投资目标**

本基金通过深入挖掘具有长期成长潜力的优质上市公司,精选具有长期竞争优势的个股进行投资,力争实现基金资产的长期增值。

**投资策略**

本基金采取“自上而下”的资产配置和“自下而上”的个股投资策略。在资产配置方面,本基金根据宏观经济、政策、市场估值等因素,动态调整股票、债券、现金等资产的比例。在个股选择方面,本基金采用“自下而上”的选股策略,重点关注具有长期竞争优势的优质上市公司。

**业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中证500指数收益率×40%

**风险收益特征**

本基金为混合型证券投资基金,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金和保本型混合基金。

**基金管理人** 富兰克林国海基金管理有限公司  
**基金托管人** 中国农业银行股份有限公司

| 序号 | 项目       | 金额(元)         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资     | 56,827,071.86 | 63.17        |
| 2  | 固定收益     | 30,627,171.10 | 34.24        |
| 3  | 衍生金融资产   | -             | -            |
| 4  | 买入返售金融资产 | -             | -            |
| 5  | 应收利息     | 1,000,000.00  | 1.12         |
| 6  | 其他资产     | 2,000,000.00  | 2.25         |
| 7  | 资产减值准备   | -             | -            |
| 8  | 负债       | 2,000,000.00  | 2.25         |
| 9  | 净资产      | 88,427,242.96 | 98.99        |

**§2 基金业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中证500指数收益率×40%

**§3 基金投资组合报告**

**3.1 报告期末按行业分类的股票投资组合**

| 行业                  | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|---------------------|----------------|--------------|
| A 医药生物              | 18,426.34      | 0.02         |
| B 制造业               | 1,231,401.20   | 1.39         |
| C 信息技术              | 198,758,452.42 | 224.82       |
| D 电力、热力、燃气及水利生产和供应业 | 1,267,764.36   | 1.43         |
| E 建筑业               | 1,043,144.14   | 1.18         |
| F 批发和零售业            | 1,179,844.62   | 1.33         |
| G 交通运输、仓储和邮政业       | 990,175.18     | 1.12         |
| H 住宿和餐饮业            | -              | -            |
| I 金融业               | 1,152,449.69   | 1.30         |
| J 房地产业              | 29,946,627.27  | 33.87        |
| K 采矿业               | 1,253,816.16   | 1.41         |
| L 建筑业               | -              | -            |
| M 其他制造业             | 2,041,123.88   | 2.31         |
| N 其他行业              | 4,607,724.88   | 5.21         |
| O 国防军工              | 972,860.00     | 1.10         |
| P 农林牧渔              | -              | -            |
| Q 其他综合收益            | 158,296.28     | 0.18         |
| R 公允价值变动资产          | 158,296.28     | 0.18         |
| S 公允价值变动负债          | 3,696,752.15   | 4.18         |
| T 合计                | 186,871,318.38 | 211.77       |

**3.2 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。

**3.3 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组合**

| 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  | 000044 | 中钢国际 | 27,549 | 7,029,268.74 | 7.83         |
| 2  | 002201 | 中航电子 | 23,621 | 6,000,204.10 | 6.78         |
| 3  | 002538 | 宏源证券 | 19,520 | 6,000,000.00 | 6.78         |
| 4  | 002028 | 思源电气 | 18,268 | 5,800,000.00 | 6.58         |
| 5  | 002192 | 汇川技术 | 19,727 | 5,025,304.30 | 5.70         |
| 6  | 000026 | 中国石化 | 47,681 | 5,018,161.15 | 5.66         |
| 7  | 000002 | 万科A  | 19,775 | 5,018,075.75 | 5.66         |
| 8  | 000070 | 双汇发展 | 42,756 | 4,807,724.88 | 5.45         |
| 9  | 000074 | 华远集团 | 11,690 | 4,802,451.40 | 5.43         |
| 10 | 001985 | 华仪股份 | 20,800 | 4,800,000.00 | 5.43         |

**§4 主要财务指标和基金净值表现**

单位:人民币元

**4.1 主要财务指标**

| 主要财务指标                    | 报告期(2017年7月1日至2017年9月30日) | 本报告期末/上年度末 |
|---------------------------|---------------------------|------------|
| 1.本期利润总额                  | 56,827,071.86             | 106.26     |
| 2.净利润                     | 15,179,791.93             | 106.26     |
| 3.归属于母公司普通股股东的净利润         | 6,000,000.00              | 106.26     |
| 4.归属于母公司普通股股东的净利润扣除非经常性损益 | 15,179,791.93             | 106.26     |

**4.2 基金净值表现**

| 期间        | 净值增长率 | 业绩比较基准 | 超额收益   |
|-----------|-------|--------|--------|
| 自基金合同生效以来 | 1.23% | 0.00%  | 1.23%  |
| 最近一年      | 5.26% | 6.89%  | -1.63% |
| 最近三年      | 1.23% | 6.89%  | -5.66% |

**§5 主要财务指标和基金净值表现**

单位:人民币元

**5.1 报告期末按基金资产净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较**

| 期间        | 净值增长率 | 业绩比较基准 | 超额收益   |
|-----------|-------|--------|--------|
| 自基金合同生效以来 | 1.23% | 0.00%  | 1.23%  |
| 最近一年      | 5.26% | 6.89%  | -1.63% |
| 最近三年      | 1.23% | 6.89%  | -5.66% |

**5.2 本基金合同生效以来基金净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较**



**§6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

**6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

| 项目          | 期初 | 期末 | 期末持有份额(股) |
|-------------|----|----|-----------|
| 1. 报告期末持有份额 | -  | -  | 14,986.27 |
| 2. 报告期新增份额  | -  | -  | 14,986.27 |
| 3. 报告期赎回份额  | -  | -  | -         |
| 4. 报告期买入份额  | -  | -  | -         |
| 5. 报告期卖出份额  | -  | -  | -         |
| 6. 报告期申购份额  | -  | -  | -         |
| 7. 报告期赎回份额  | -  | -  | -         |
| 8. 报告期买入份额  | -  | -  | -         |
| 9. 报告期卖出份额  | -  | -  | -         |
| 10. 合计      | -  | -  | 14,986.27 |

**§6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

**6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

| 项目          | 期初 | 期末 | 期末持有份额(股) |
|-------------|----|----|-----------|
| 1. 报告期末持有份额 | -  | -  | 14,986.27 |
| 2. 报告期新增份额  | -  | -  | 14,986.27 |
| 3. 报告期赎回份额  | -  | -  | -         |
| 4. 报告期买入份额  | -  | -  | -         |
| 5. 报告期卖出份额  | -  | -  | -         |
| 6. 报告期申购份额  | -  | -  | -         |
| 7. 报告期赎回份额  | -  | -  | -         |
| 8. 报告期买入份额  | -  | -  | -         |
| 9. 报告期卖出份额  | -  | -  | -         |
| 10. 合计      | -  | -  | 14,986.27 |

**§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**

| 项目          | 期初 | 期末 | 期末持有份额(股) |
|-------------|----|----|-----------|
| 1. 报告期末持有份额 | -  | -  | 14,986.27 |
| 2. 报告期新增份额  | -  | -  | 14,986.27 |
| 3. 报告期赎回份额  | -  | -  | -         |
| 4. 报告期买入份额  | -  | -  | -         |
| 5. 报告期卖出份额  | -  | -  | -         |
| 6. 报告期申购份额  | -  | -  | -         |
| 7. 报告期赎回份额  | -  | -  | -         |
| 8. 报告期买入份额  | -  | -  | -         |
| 9. 报告期卖出份额  | -  | -  | -         |
| 10. 合计      | -  | -  | 14,986.27 |

**§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**

| 项目          | 期初 | 期末 | 期末持有份额(股) |
|-------------|----|----|-----------|
| 1. 报告期末持有份额 | -  | -  | 14,986.27 |
| 2. 报告期新增份额  | -  | -  | 14,986.27 |
| 3. 报告期赎回份额  | -  | -  | -         |
| 4. 报告期买入份额  | -  | -  | -         |
| 5. 报告期卖出份额  | -  | -  | -         |
| 6. 报告期申购份额  | -  | -  | -         |
| 7. 报告期赎回份额  | -  | -  | -         |
| 8. 报告期买入份额  | -  | -  | -         |
| 9. 报告期卖出份额  | -  | -  | -         |
| 10. 合计      | -  | -  | 14,986.27 |

**§8 备查文件目录**

- 中国证监会批准富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金设立的文件;
- 《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金基金合同》;
- 《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金招募说明书》;
- 《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金托管协议》;
- 中国证监会要求的其他文件。

**8.2 存放地点**

基金管理人及基金托管人的住所并载于基金管理人网站: www.fund.com.cn

**8.3 查阅方式**

- 投资者可在基金开放日内至基金管理人或基金托管人处免费查阅,并可按工本费购买复印件。
- 登陆基金管理人网站(www.fund.com.cn)查阅。

富兰克林国海基金管理有限公司  
2017年10月27日

**§8 备查文件目录**

- 中国证监会批准富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金设立的文件;
- 《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金基金合同》;
- 《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金招募说明书》;
- 《富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金托管协议》;
- 中国证监会要求的其他文件。

**8.2 存放地点**

基金管理人及基金托管人的住所并载于基金管理人网站: www.fund.com.cn

**8.3 查阅方式**

- 投资者可在基金开放日内至基金管理人或基金托管人处免费查阅,并可按工本费购买复印件。
- 登陆基金管理人网站(www.fund.com.cn)查阅。

富兰克林国海基金管理有限公司  
2017年10月27日

### 富兰克林国海新活力灵活配置混合型证券投资基金

#### 2017 第三季度报告

2017年9月30日

基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司  
基金托管人: 中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期: 2017年10月27日

**1.1 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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预示其未来表现,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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

**§1 基金基本情况**

|          |                        |
|----------|------------------------|
| 基金名称     | 富兰克林国海新活力灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金代码     | 004069                 |
| 基金管理人    | 富兰克林国海基金管理有限公司         |
| 基金托管人    | 中国农业银行股份有限公司           |
| 基金合同生效日期 | 2017年7月31日             |

**投资目标**

本基金通过深入挖掘具有长期成长潜力的优质上市公司,精选具有长期竞争优势的个股进行投资,力争实现基金资产的长期增值。

**投资策略**

本基金采取“自上而下”的资产配置和“自下而上”的个股投资策略。在资产配置方面,本基金根据宏观经济、政策、市场估值等因素,动态调整股票、债券、现金等资产的比例。在个股选择方面,本基金采用“自下而上”的选股策略,重点关注具有长期竞争优势的优质上市公司。

**业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中证500指数收益率×40%

**风险收益特征**

本基金为混合型证券投资基金,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金和保本型混合基金。

**基金管理人** 富兰克林国海基金管理有限公司  
**基金托管人** 中国农业银行股份有限公司

| 序号 | 项目       | 金额(元)         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资     | 48,927,242.96 | 55.28        |
| 2  | 固定收益     | 30,627,171.10 | 34.24        |
| 3  | 衍生金融资产   | -             | -            |
| 4  | 买入返售金融资产 | -             | -            |
| 5  | 应收利息     | 1,000,000.00  | 1.12         |
| 6  | 其他资产     | 2,000,000.00  | 2.25         |
| 7  | 资产减值准备   | -             | -            |
| 8  | 负债       | 2,000,000.00  | 2.25         |
| 9  | 净资产      | 88,427,242.96 | 98.99        |

**§2 基金业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中证500指数收益率×40%

**§3 基金投资组合报告**

**3.1 报告期末按行业分类的股票投资组合**

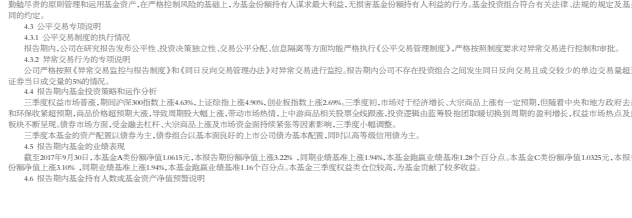
| 行业                  | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|---------------------|----------------|--------------|
| A 医药生物              | 18,426.34      | 0.02         |
| B 制造业               | 1,231,401.20   | 1.39         |
| C 信息技术              | 198,758,452.42 | 224.82       |
| D 电力、热力、燃气及水利生产和供应业 | 1,267,764.36   | 1.43         |
| E 建筑业               | 1,043,144.14   | 1.18         |
| F 批发和零售业            | 1,179,844.62   | 1.33         |
| G 交通运输、仓储和邮政业       | 990,175.18     | 1.12         |
| H 住宿和餐饮业            | -              | -            |
| I 金融业               | 1,152,449.69   | 1.30         |
| J 房地产业              | 29,946,627.27  | 33.87        |
| K 采矿业               | 1,253,816.16   | 1.41         |
| L 建筑业               | -              | -            |
| M 其他制造业             | 2,041,123.88   | 2.31         |
| N 其他行业              | 4,607,724.88   | 5.21         |
| O 国防军工              | 972,860.00     | 1.10         |
| P 农林牧渔              | -              | -            |
| Q 其他综合收益            | 158,296.28     | 0.18         |
| R 公允价值变动资产          | 158,296.28     | 0.18         |
| S 公允价值变动负债          | 3,696,752.15   | 4.18         |
| T 合计                | 186,871,318.38 | 211.77       |

**§4 主要财务指标**

| 主要财务指标                    | 报告期(2017年7月1日至2017年9月30日) | 本报告期末/上年度末 |
|---------------------------|---------------------------|------------|
| 1.本期利润总额                  | 48,927,242.96             | 106.26     |
| 2.净利润                     | 15,179,791.93             | 106.26     |
| 3.归属于母公司普通股股东的净利润         | 6,000,000.00              | 106.26     |
| 4.归属于母公司普通股股东的净利润扣除非经常性损益 | 15,179,791.93             | 106.26     |

**4.2 基金净值表现**

| 期间        | 净值增长率 | 业绩比较基准 | 超额收益   |
|-----------|-------|--------|--------|
| 自基金合同生效以来 | 1.23% | 0.00%  | 1.23%  |
| 最近一年      | 5.26% | 6.89%  | -1.63% |
| 最近三年      | 1.23% | 6.89%  | -5.66% |



**§6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

**6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

| 项目          | 期初 | 期末 | 期末持有份额(股) |
|-------------|----|----|-----------|
| 1. 报告期末持有份额 | -  | -  | 14,986.27 |
| 2. 报告期新增份额  | -  | -  | 14,986.27 |
| 3. 报告期赎回份额  | -  | -  | -         |
| 4. 报告期买入份额  | -  | -  | -         |
| 5. 报告期卖出份额  | -  | -  | -         |
| 6. 报告期申购份额  | -  | -  | -         |
| 7. 报告期赎回份额  | -  | -  | -         |
| 8. 报告期买入份额  | -  | -  | -         |
| 9. 报告期卖出份额  | -  | -  | -         |
| 10. 合计      | -  | -  | 14,986.27 |

### 富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金

#### 2017 第三季度报告

2017年9月30日

基金管理人: 富兰克林国海基金管理有限公司  
基金托管人: 中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期: 2017年10月27日

**1.1 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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预示其未来表现,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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

**§1 基金基本情况**

|          |                         |
|----------|-------------------------|
| 基金名称     | 富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金代码     | 004070                  |
| 基金管理人    | 富兰克林国海基金管理有限公司          |
| 基金托管人    | 中国农业银行股份有限公司            |
| 基金合同生效日期 | 2017年7月31日              |

**投资目标**

本基金通过深入挖掘具有长期成长潜力的优质上市公司,精选具有长期竞争优势的个股进行投资,力争实现基金资产的长期增值。

**投资策略**

本基金采取“自上而下”的资产配置和“自下而上”的个股投资策略。在资产配置方面,本基金根据宏观经济、政策、市场估值等因素,动态调整股票、债券、现金等资产的比例。在个股选择方面,本基金采用“自下而上”的选股策略,重点关注具有长期竞争优势的优质上市公司。

**业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中证500指数收益率×40%

**风险收益特征**

本基金为混合型证券投资基金,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金和保本型混合基金。

**基金管理人** 富兰克林国海基金管理有限公司  
**基金托管人** 中国农业银行股份有限公司

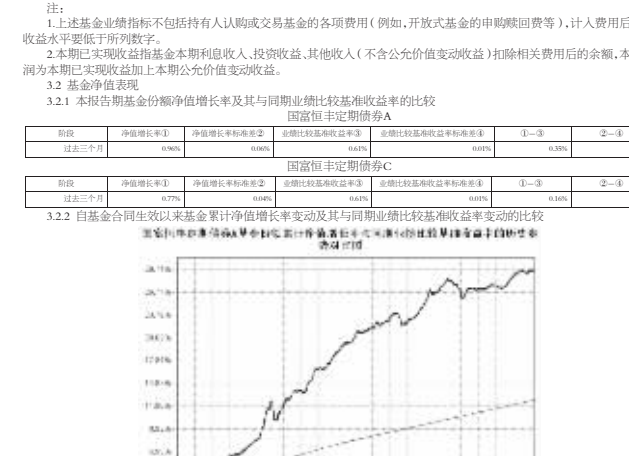
**§2 基金业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中证500指数收益率×40%

**§3 基金投资组合报告**

**3.1 报告期末按行业分类的股票投资组合**

| 行业                  | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|---------------------|----------------|--------------|
| A 医药生物              | 18,426.34      | 0.02         |
| B 制造业               | 1,231,401.20   | 1.39         |
| C 信息技术              | 198,758,452.42 | 224.82       |
| D 电力、热力、燃气及水利生产和供应业 | 1,267,764.36   | 1.43         |
| E 建筑业               | 1,043,144.14   | 1.18         |
| F 批发和零售业            | 1,179,844.62   | 1.33         |
| G 交通运输、仓储和邮政业       | 990,175.18     | 1.12         |
| H 住宿和餐饮业            | -              | -            |
| I 金融业               | 1,152,449.69   | 1.30         |
| J 房地产业              | 29,946,627.27  | 33.87        |
| K 采矿业               | 1,253,816.16   | 1.41         |
| L 建筑业               | -              | -            |
| M 其他制造业             | 2,041,123.88   | 2.31         |
| N 其他行业              | 4,607,724.88   | 5.21         |
| O 国防军工              | 972,860.00     | 1.10         |
| P 农林牧渔              | -              | -            |
| Q 其他综合收益            | 158,296.28     | 0.18         |
| R 公允价值变动资产          | 158,296.28     | 0.18         |
| S 公允价值变动负债          | 3,696,752.15   | 4.18         |
| T 合计                | 186,871,318.38 | 211.77       |



**§6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

**6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

| 项目          | 期初 | 期末 | 期末持有份额(股) |
|-------------|----|----|-----------|
| 1. 报告期末持有份额 | -  | -  | 14,986.27 |
| 2. 报告期新增份额  | -  | -  | 14,986.27 |
| 3. 报告期赎回份额  | -  | -  | -         |
| 4. 报告期买入份额  | -  | -  | -         |
| 5. 报告期卖出份额  | -  | -  | -         |
| 6. 报告期申购份额  | -  | -  | -         |
| 7. 报告期赎回份额  | -  | -  | -         |
| 8. 报告期买入份额  | -  | -  | -         |
| 9. 报告期卖出份额  | -  | -  | -         |
| 10. 合计      | -  | -  | 14,986.27 |

**§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**

| 项目          | 期初 | 期末 | 期末持有份额(股) |
|-------------|----|----|-----------|
| 1. 报告期末持有份额 | -  | -  | 14,986.27 |
| 2. 报告期新增份额  | -  | -  | 14,986.27 |
| 3. 报告期赎回份额  | -  | -  | -         |
| 4. 报告期买入份额  | -  | -  | -         |
| 5. 报告期卖出份额  | -  | -  | -         |
| 6. 报告期申购份额  | -  | -  | -         |
| 7. 报告期赎回份额  | -  | -  | -         |
| 8. 报告期买入份额  | -  | -  | -         |
| 9. 报告期卖出份额  | -  | -  | -         |
| 10. 合计      | -  | -  | 14,986.27 |