

富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

费板块领涨市场。9月份,A股纳入英富时罗素指数,MSCI上调高股息权重,市场对未来增量资金存在预期,市场出现反弹,金融、白酒、石化等蓝筹表现较好,电子、计算机出现较大调整。

7月份,本基金保持中性仓位,银行和计算机持仓对业绩贡献较大,医药和商贸零售持仓对业绩产生较大拖累,单月基金跑输业绩比较基准;8月份,本基金持仓的银行对业绩贡献较大,医药和商贸零售持仓对业绩产生较大拖累,单月基金净值跑输业绩比较基准;9月份,本基金中的银行、石化持仓对业绩贡献较大,电子、计算机持仓对业绩产生较大拖累,单月基金净值跑输业绩比较基准。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2018年3季度,本基金份额净值为1.087元,基金份额下跌4.90%,业绩基准下跌1.77%,小幅跑输业绩基准3.13个百分点,持仓中银行对净值表现贡献较大,医药、计算机持仓对业绩拖累较大。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情况说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	投资组合	数量(只)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	股票投资	102,022,000.00	89,812,000.00	82.62
2	债券投资	132,022,000.00	132,022,000.00	120.67
3	资产支持证券	-	-	-
4	买入返售金融资产	-	-	-
5	银行存款	-	-	-
6	其他金融资产	-	-	-
7	待摊费用	-	-	-
8	其他资产	-	-	-
9	负债	-	-	-
10	合计	304,044,000.00	304,044,000.00	277.69

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,619,127.59	1.85
B	制造业	77,406,380.75	25.46
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	59,246,717.88	19.49
D	建筑业	7,283,000.00	2.39
E	交通运输、仓储和邮政业	5,619,127.59	1.85
F	信息传输、软件和信息技术服务业	3,969,203.23	1.30
G	金融业	59,246,717.88	19.49
H	房地产业	5,619,127.59	1.85
I	批发和零售业	5,619,127.59	1.85
J	住宿和餐饮业	5,619,127.59	1.85
K	其他	5,619,127.59	1.85
合计		132,022,000.00	40.26

5.2.1 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	制造业	5,619,127.59	1.85
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
D	建筑业	-	-
E	交通运输、仓储和邮政业	-	-
F	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
G	金融业	-	-
H	房地产业	-	-
I	批发和零售业	-	-
J	住宿和餐饮业	-	-
K	其他	-	-
合计		5,619,127.59	1.85

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股票。

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

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	000001	平安银行	2,000,000	37,000,000.00	3.39
2	000002	万科A	4,500,000	19,725,000.00	1.80
3	000003	招商银行	1,000,000	12,700,000.00	1.17
4	000005	浦发银行	400,211	6,726,026.61	0.62
5	000012	华商银行	200,000	4,200,000.00	0.39
6	000029	张裕A	200,000	5,200,000.00	0.48
7	002049	紫光股份	136,344	4,299,748.60	0.39
8	000028	广田股份	228,022	3,279,122.64	0.30
9	000075	华菱钢铁	228,000	1,442,000.00	0.13
10	000007	中国神华	228,000	3,200,000.00	0.29

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

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	000001	平安银行	2,000,000	37,000,000.00	3.39
2	000002	万科A	4,500,000	19,725,000.00	1.80
3	000003	招商银行	1,000,000	12,700,000.00	1.17
4	000005	浦发银行	400,211	6,726,026.61	0.62
5	000012	华商银行	200,000	4,200,000.00	0.39
6	000029	张裕A	200,000	5,200,000.00	0.48
7	002049	紫光股份	136,344	4,299,748.60	0.39
8	000028	广田股份	228,022	3,279,122.64	0.30
9	000075	华菱钢铁	228,000	1,442,000.00	0.13
10	000007	中国神华	228,000	3,200,000.00	0.29

5.3.2 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

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	000001	平安银行	2,000,000	37,000,000.00	3.39
2	000002	万科A	4,500,000	19,725,000.00	1.80
3	000003	招商银行	1,000,000	12,700,000.00	1.17
4	000005	浦发银行	400,211	6,726,026.61	0.62
5	000012	华商银行	200,000	4,200,000.00	0.39
6	000029	张裕A	200,000	5,200,000.00	0.48
7	002049	紫光股份	136,344	4,299,748.60	0.39
8	000028	广田股份	228,022	3,279,122.64	0.30
9	000075	华菱钢铁	228,000	1,442,000.00	0.13
10	000007	中国神华	228,000	3,200,000.00	0.29

5.3.3 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

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	000001	平安银行	2,000,000	37,000,000.00	3.39
2	000002	万科A	4,500,000	19,725,000.00	1.80
3	000003	招商银行	1,000,000	12,700,000.00	1.17
4	000005	浦发银行	400,211	6,726,026.61	0.62
5	000012	华商银行	200,000	4,200,000.00	0.39
6	000029	张裕A	200,000	5,200,000.00	0.48
7	002049	紫光股份	136,344	4,299,748.60	0.39
8	000028	广田股份	228,022	3,279,122.64	0.30
9	000075	华菱钢铁	228,000	1,442,000.00	0.13
10	000007	中国神华	228,000	3,200,000.00	0.29

5.3.4 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

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	000001	平安银行	2,000,000	37,000,000.00	3.39
2	000002	万科A	4,500,000	19,725,000.00	1.80
3	000003	招商银行	1,000,000	12,700,000.00	1.17
4	000005	浦发银行	400,211	6,726,026.61	0.62
5	000012	华商银行	200,000	4,200,000.00	0.39
6	000029	张裕A	200,000	5,200,000.00	0.48
7	002049	紫光股份	136,344	4,299,748.60	0.39
8	000028	广田股份	228,022	3,279,122.64	0.30
9	000075	华菱钢铁	228,000	1,442,000.00	0.13
10	000007	中国神华	228,000	3,200,000.00	0.29

5.3.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

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	000001	平安银行	2,000,000	37,000,000.00	3.39
2	000002	万科A	4,500,000	19,725,000.00	1.80
3	000003	招商银行	1,000,000	12,700,000.00	1.17
4	000005	浦发银行	400,211	6,726,026.61	0.62
5	000012	华商银行	200,000	4,200,000.00	0.39
6	000029	张裕A	200,000	5,200,000.00	0.48
7	002049	紫光股份	136,344	4,299,748.60	0.39
8	000028	广田股份	228,022	3,279,122.64	0.30
9	000075	华菱钢铁	228,000	1,442,000.00	0.13
10	000007	中国神华	228,000	3,200,000.00	0.29

5.3.6 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股票投资

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	000001	平安银行	2,000,000	37,000,000.00	3.39
2	000002	万科A	4,500,000	19,725,000.00	1.80
3	000003	招商银行	1,000,000	12,700,000.00	1.17
4	000005	浦发银行	400,211	6,726,026.61	0.62
5	000012	华商银行	200,000	4,200,000.00	0.39
6	000029	张裕A	200,000	5,200,000.00	0.48
7	002049	紫光股份	136,344	4,299,748.60	0.39
8	000028	广田股份	228,022	3,279,122.64	0.30
9	000075	华菱钢铁	228,000	1,442,000.00	0.13
10	000007	中国神华	228,000	3,200,000.00	0.29

5.3.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

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	000001	平安银行	2,000,000	37,000,000.00	3.39
2	000002	万科A	4,500,000	19,725,000.00	1.80
3	000003	招商银行	1,000,000	12,700,000.00	1.17
4	000005	浦发银行	400,211	6,726,026.61	0.62
5	000012	华商银行	200,000	4,200,000.00	0.39
6	000029	张裕A	200,000	5,200,000.00	0.48
7	002049	紫光股份	136,344	4,299,748.60	0.39
8	000028	广田股份	228,022	3,279,122.64	0.30
9	000075	华菱钢铁	228,000	1,442,000.00	0.13
10	000007	中国神华	228,000	3,200,000.00	0.29

5.3.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

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	000001	平安银行	2,000,000	37,000,000.00	3.39
2	000002	万科A	4,500,000	19,725,000.00	1.80
3	000003	招商银行	1,000,000	12,700,000.00	1.17
4	000005	浦发银行	400,211	6,726,026.61	0.62
5	000012	华商银行	200,000	4,200,000.00	0.39
6	000029	张裕A	200,000	5,200,000.00	0.48
7	002049	紫光股份	136,344	4,299,748.60	0.39
8	000028	广田股份	228,022	3,279,122.64	0.30
9	000075	华菱钢铁	228,000	1,442,000.00	0.13
10	000007	中国神华	228,000	3,200,000.00	0.29

5.3.9 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股票投资

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	000001	平安银行	2,000,000	37,000,000.00	3.39
2	000002	万科A	4,500,000	19,725,000.00	1.80
3	000003	招商银行	1,000,000	12,700,000.00	1.17
4	000005	浦发银行	400,211	6,726,026.61	0.62
5	000012	华商银行	200,000	4,200,000.00	0.39
6	000029	张裕A	200,000	5,200,000.00	0.48
7	002049	紫光股份	136,344	4,299,748.60	0.39
8	000028	广田股份	228,022	3,279,122.64	0.30
9	000075	华菱钢铁	228,000	1,442,000.00	0.13
10	000007	中国神华	228,000	3,200,000.00	0.29

5.3.10 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

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	000001	平安银行	2,000,000	37,000,000.00	3.39
2	000002	万科			