

基金管理人：国富蓝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：二〇一三年十月二十三日

§ 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2013年10月18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2013年7月24日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国富日日收益货币
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月24日
报告期末基金份额总额	460,134,380.13份

投资目标 在保持资产安全性的基础上，追求稳定的当期收益。

本基金主要通过投资于提供现金管理工具，通过积极的投资组合管理，在保持资产安全性与较高流动性的基础上，追求稳定的当期收益。

1. 购买赎回结构安排

本基金为货币市场基金，国家货币政策和财政政策、短期资金市况和利率波动、资金供求、市场结构变化等因素的深刻变化，将对本基金的运作产生影响。因此，本基金将根据国家政策的变化，适时调整投资组合的平均剩余期限及期限分布，以应对短期预期收益率上升时，组合平均剩余期限的降低；当长期短期预期收益率下降时，组合平均剩余期限的增加。

2. 资产配置策略

根据市场环境，结合各券种品种的流动性和相对收益水平，采用滚动配置策略，确定组合中各券种的比例。构建不同券种的简单曲线模型，对货币市场工具进行定期评估，根据评估结果在货币市场基金的配置比例及流动性的基础上，投资于各类型债券中价值低估的小券种，在保证投资组合的低风险、高流动性的前提下，通过投资于货币市场基金的二级市场，获取资本利得。

4. 现金管理与风险管理

对市场价格的全面化及成本的申购、赎回变动的动态预测，通过现金管理，回购滚动操作，债券品种的期限结构分析，以及对资金流动性的把握，获得较高的收益。

充分考虑市场的短期和长期的稳定性，选择具有较好流动性的品种，投资于货币市场基金，从而获得较高的收益。

本基金的业经比较基准为“2个交易日存续利率+0.044%”，同期业绩比较基准增长0.255%，基金超额收益率0.5890%，基金份额B类净值增长0.8902%，同期业绩比较基准增长0.2552%，基金超额收益率0.6350%。

5. 风险收益特征

本基金由货币市场基金、混合型证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金。

基金管理人 国富蓝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

报告期末下属两级基金的份额总额

国富日日收益货币A 000024

国富日日收益货币B 190,738,504.48

报告期末下属两级基金的份额总额

190,738,504.48 269,396,075.65

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2013年7月24日–2013年9月30日)

国富日日收益货币A 国富日日收益货币B

1.本期已实现收益 4,946,332.07 6,597,052.50

2.本期利润 4,946,332.07 6,597,052.50

3.期末基金资产净值 190,738,504.48 269,396,075.65

注：本期已实现收益指本基金利息收入、投资收益、其他收入、不含公允价值变动收益、除相关费用后的余额、本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.国富日日收益货币A

阶段 净值收益率① 0.8442% 0.0021% 0.2552% 0.0000% 0.5890% 0.0021%

自基金成立起至今 0.8442% 0.0021% 0.2552% 0.0000% 0.6350% 0.0021%

2.国富日日收益货币B

阶段 净值收益率① 0.8902% 0.0021% 0.2552% 0.0000% 0.6350% 0.0021%

自基金成立起至今 0.8902% 0.0021% 0.2552% 0.0000% 0.6350% 0.0021%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

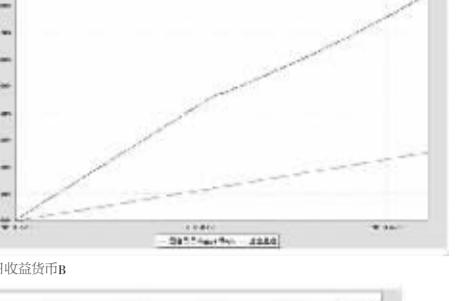
2013年7月24日至2013年9月30日

1. 国富日日收益货币A

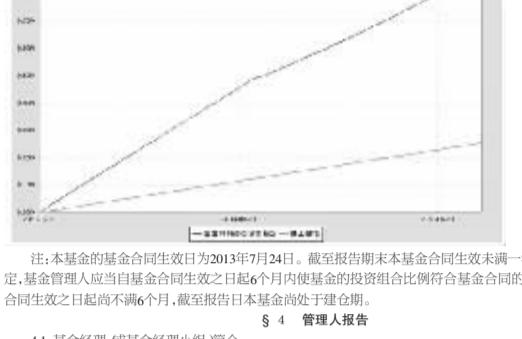
2. 国富日日收益货币B

富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金

2013 第三季度报告



2. 国富日日收益货币



3. 国富日日收益货币B

4.4 报告期内基金的业绩表现

本基金自2013年7月24日起，截至2013年9月30日未满3个月。自2013年7月24日至本报告期末，基金份额A的净值增长0.844%，同期业绩比较基准增长0.255%，基金份额B类净值增长0.8902%，同期业绩比较基准增长0.2552%，基金超额收益率0.5890%。

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	固定收益投资	139,822,674.53	25.86
其中：债券		139,822,674.53	25.86
货币支持证券		-	-
2	买入返售金融资产	-	-
其中：买断式回购的买入返售金融资产		-	-
3	银行存款和结算备付金合计	397,645,098.02	73.55
4	其他各项资产	3,210,499.33	0.59
5	合计	540,767,218.88	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金净资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1.21
其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	78,443,388.33
其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金净资产净值比例按报告期内每个交易日融资余额占基金净资产净值比例的简单平均值。

本基金正回购的资金额超过基金净资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金场内货币基金债券正回购的资金额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.4 投资组合报告中所涉基金的剩余期限

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	85
报告期末投资组合平均剩余期限最高值	86
报告期末投资组合平均剩余期限最低值	3

报告期末投资组合平均剩余期限超过180天的情况说明

本基金报告期内货币基金组合平均剩余期限未超过180天。

5.5 其他资产

5.6 影子定价“与”摊余成本法“确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0007%
报告期内偏离度的最低值	-0.0100%
报告期内偏离度的绝对值的简单平均值	0.0015%

5.7 报告期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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.9 基金会计方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金份额净值始终维持在1.00元。

5.10 本报告期内本基金持有一年内到期的可变利率债券的摊余成本未超过基金资产净值的20%。

5.11 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生关联关系。

5.12 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生关联交易。

5.13 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.14 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.15 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.16 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.17 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.18 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.19 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.20 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.21 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.22 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.23 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.24 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.25 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.26 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.27 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.28 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.29 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.30 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.31 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.32 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.33 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.34 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重大的关联交易。

5.35 本报告期内本基金投资的前十名证券没有发生重