富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6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

送出日期:2018年8月25日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2018年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国富日鑫月益30天理财债券	
基金主代码	004663	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年6月19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	
报告期末基金份额总额	4,129,953,456.47份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国富日鑫月益30天理财债券A	国富日鑫月益30天理财债券B
下属分级基金的交易代码:	004663	004664
报告期末下属分级基金的份额总额	180,249,483.42份	3,949,703,973.05份

2.2 基金产品说明

投资目标	在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,为基金份额持有人谋求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金通过积极主动的组合管理,在保证基金资产安全并满足流动性的前提下,力争创造超越业绩比较基准的投资收益。 1、剩余期限结构配置 基于对宏观经济指标、国家货币政策和财政政策等因素的深入研究,对利率期限结构变化趋势进行研判,预测货币市场利率水平,确定基金投资组合的平均剩余期限及期限分配结构。本基金将投资组合的平均剩余期限控制在150天以内。 2、类属资产配置策略 深入分析国内外宏观经济形势、社会资金运动及各项宏观经济政策对货币市场和债券市场的影响,通过分析各类属品种的相对收益、信用利差变化等,判断类属债券的相对投资价值,并结合各品种的市场容量和流动性状况,在银行存款、短期融资券、国债、央行票据、债券回购等低风险品种间进行合理配置。 3、相对价值挖掘策略 本基金在主要投资于货币市场工具的同时,深入挖掘市场上各类固定收益类投资品种由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况造成的短期内市场失衡,这种失衡将带来一定投资机会。通过分析短期市场机会发生的动因及规律,积极利用市场机会获得超额收益。 4、回购策略 (1)息差放大策略:本基金将在严格控制风险的前提下,利用回购利率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益。 (2)逆回购策略:基金管理人将密切关注由于新股申购、新债发行以及季节效应等因素导致短期资金需求激增的机会,通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率升高所带来的投资机会。 5、现金流管理策略 对市场资金面的变化及本基金申购/赎回变化的动态预测,通过现金库存管理、回购滚动操作、债券品种的期限结构安排及资产变现等措施,动态调整并有效分配现金流,在保证基金资产流动性的基础上,获取稳定的收益。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,属于证券投资基金中的低风险品种,预期风险水平和预期收益低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国海富兰克林基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	王永民
	联系电话	021-3855 5555	010-6659 4896
	电子邮箱	service@ftsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680和021-38789555	95566
传真		021-6888 3050	010-6659 4942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金级别	国富日鑫月益30天理财债券A	国富日鑫月益30天理财债券B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	6,579,243.61	75,713,207.55
本期利润	6,579,243.61	75,713,207.55
本期净值收益率	2.1977%	2.3295%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末基金资产净值	180,249,483.42	3,949,703,973.05
期末基金份额净值	1.00	1.00
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)	
累计净值收益率	4.4089%	4.6921%

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,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 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

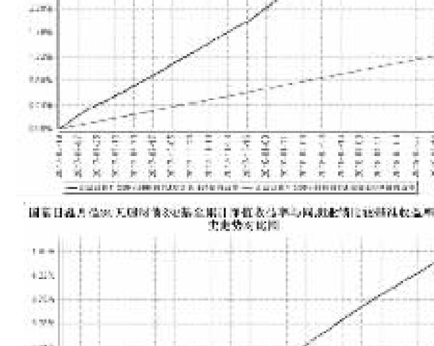
国富日鑫月益30天理财债券A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3362%	0.0017%	0.1096%	0.0000%	0.2266%	0.0017%
过去三个月	1.0193%	0.0014%	0.3331%	0.0000%	0.6862%	0.0014%
过去六个月	2.1977%	0.0019%	0.6646%	0.0000%	1.5331%	0.0019%
过去一年	4.2507%	0.0018%	1.3494%	0.0000%	2.9013%	0.0018%
自基金合同生效起至今	4.4089%	0.0019%	1.3944%	0.0000%	3.0145%	0.0019%

国富日鑫月益30天理财债券B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3577%	0.0017%	0.1096%	0.0000%	0.2481%	0.0017%
过去三个月	1.0855%	0.0014%	0.3331%	0.0000%	0.7524%	0.0014%
过去六个月	2.3295%	0.0019%	0.6646%	0.0000%	1.6649%	0.0019%
过去一年	4.5252%	0.0018%	1.3494%	0.0000%	3.1758%	0.0018%
自基金合同生效起至今	4.6921%	0.0019%	1.3944%	0.0000%	3.2977%	0.0019%

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



注:本基金的基金合同生效日为2017年6月19日。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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国海富兰克林基金管理有限公司成立于2004年11月,由国海证券股份有限公司和富兰克林邓普顿投资集团全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建,目前公司注册资本2.2亿元人民币,国海证券股份有限公司持有51%的股份,邓普顿国际股份有限公司持有49%的股份。

国海证券股份有限公司是国内A股市场第16家上市券商,是拥有全业务牌照,营业网点遍布中国主要城市的全国性综合类证券公司。富兰克林邓普顿投资集团是世界知名基金管理公司,在全球市场上有超过70年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿投资集团享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系,借助国海证券股份有限公司的综合业务优势,力争成为国内一流的基金管理公司。

本公司具有丰富的管理基金经验。自2005年6月第一只基金成立开始,截至本报告期末,本公司已经成功管理了33只基金产品。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王莉	国富日日收益货币基金、国富安享货币基金及国富日鑫月益30天理财债券基金的基金经理	2017年6月21日	-	8年	王莉女士,华东师范大学金融学硕士。历任武汉农村商业银行股份有限公司债券交易员、国海富兰克林基金管理有限公司债券交易员。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富日日收益货币基金、国富安享货币基金及国富日鑫月益30天理财债券基金的基金经理。
严婧璧	国富日日收益货币基金、国富安享货币基金及国富日鑫月益30天理财债券基金的基金经理助理	2018年2月5日	-	10年	严婧璧,上海交通大学药学学士。历任加捷投资咨询公司交易分析师,中驰(创业)资本投资有限公司交易员,珩生资产管理有限公司交易员,太平资产管理有限公司交易员及国海富兰克林基金管理有限公司交易员。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富日日收益货币基金、国富安享货币基金及国富日鑫月益30天理财债券基金的基金经理助理。

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遵规守信情况的说明

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《富兰克林国海日鑫月益30天理财债券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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内公司严格执行《公平交易管理制度》,明确了公平交易的原则和目标,制订了实现公平交易的具体措施,并在技术上按照公平交易原则实现了严格的交易公平分配。

报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

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的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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年债市走出长阳行情,在经历了一月初的探底回升后,市场逐渐明确了合理充裕的政策方向,虽然监管政策仍在适时的落地,但整体看对市场的冲击减小。一季度人民银行预判了传统的大额提现及公开市场操作的到期,通过公开市场操作平滑了资金波动,银行间市场得以平稳过渡,季末贸易战打响并在接下来的二季度不断发酵,影响到了国内的宏观走势,使得央行两次定向降准来合理对冲。在此情况下,利率及高评级信用品种收益率整体大幅回落。另一方面,二季度起低评级特别是民企违约情况不断发生,市场整体风险偏好降低,风险利差反而大幅走扩。存单产品的收益率整体跟随市场,随着每个季末到期量的增加收益率呈现波动下行趋势。

目前信用事件层出不穷,在此背景下仍需仔细筛选流动性尚佳的有配置价值的信用品种。整体来看,高评级存单的风险整体可控,且由于其良好的流动性,其仍然是目前配置上比较理想的品种之一。

报告期内,本基金致力于做好择时,选择在合适时机增加长期限信用品种,在债券配置上采取哑铃型结构,保持短期流动性并力求锁定一部分长期资产的收益率。选择高评级同业存单为配置主力品种,间或择时投资性价比高且资质优良的AAA评级超短融。在保持组合流动性要求的前提下在各投资品种内选择合适的标的,为基金持有人创造稳健的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A类份额净值增长2.1977%,同期业绩比较基准增长0.6646%,基金超额收益率1.5331%;本基金B类份额净值增长2.3295%,同期业绩比较基准增长0.6646%,基金超额收益率1.6649%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年中国宏观经济整体平稳下行,但外部贸易冲突暂时没有看到结束的迹象,预计市场流动性会较为宽松,整体收益率下行为大概率事件,年内或有反复。但在去杠杆的基调不变的大环境下今年低资质债券融资渠道受阻,违约事件频发,需密切关注政策及基本面的变化。下半年本基金将仔细筛选流动性尚佳的有配置价值的信用品种,着力在择时配置上,精选资质较好的信用品种,在保证账户流动性的前提下提升收益率。

本基金将继续按照基金合同及相关法律法规要求,努力做好基金投资工作,争取未来更好的长期投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程,按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会(简称"估值委员会"),并已制订了《公允估值管理办法》。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务,确保基金估值的公允、合理,保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由总经理或其任命者负责,成员包括投研、风险控制、监察稽核、交易、基金核算方面的部门主管,相关人员均具有丰富的证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金根据每日各类基金份额收益情况,以基金净收益为基准,为投资者每日计算当日各类基金份额的收益并分配,并在运作周期到期日集中支付。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	692,024,571.14	726,004,003.14
结算备付金	3,063,636.36	-
存出保证金	606.70	-
交易性金融资产	2,910,720,200.59	1,408,787,855.16
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,880,613,957.62	1,408,787,855.16
资产支持证券投资	30,106,242.97	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	910,864,150.89	993,014,568.06
应收证券清算款	-	-
应收利息	20,381,687.04	6,418,399.72
应收股利	-	-
应收申购款	338,600.00	61,238,226.32
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,537,393,452.72	3,195,463,052.40
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	399,613,100.57	169,999,545.00
应付证券清算款	300,000.00	60,000,000.00
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	934,372.81	484,897.05
应付托管费	266,963.63	138,542.03
应付销售服务费	76,602.86	34,882.22
应付交易费用	59,257.80	45,858.16
应交税费	35,532.45	-
应付利息	303,749.57	125,753.43
应付利润	5,666,938.67	4,813,778.59
递延所得税负债	-	-
其他负债	183,477.89	300,000.00
负债合计	407,439,996.25	235,943,256.48
所有者权益:		
实收基金	4,129,953,456.47	2,959,519,795.92
未分配利润	-	-
所有者权益合计	4,129,953,456.47	2,959,519,795.92
负债和所有者权益总计	4,537,393,452.72	3,195,463,052.40

注:报告截止日2018年6月30日,国富日鑫月益30天理财债券A基金份额净值1.00元,基金份额总额180,249,483.42份;国富日鑫月益30天理财债券B基金份额净值1.00元,基金份额总额3,949,703,973.05份。国富日鑫月益30天理财债券份额总额合计为4,129,953,456.47份。

6.2 利润表

会计主体:富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年6月19日(基金合同生效日)至2017年6月30日
一、收入	97,714,515.86	2,684,953.27
1.利息收入	95,445,183.86	2,684,953.27
其中:存款利息收入	29,174,836.06	230,735.53
债券利息收入	55,957,091.26	-
资产支持证券利息收入	94,152.96	-
买入返售金融资产收入	10,219,103.58	2,454,217.74
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	2,269,332.00	-
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,269,332.00	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	15,422,064.70	268,712.19
1. 管理人报酬	5,078,729.52	131,587.06
2. 托管费	1,451,065.64	37,596.24
3. 销售服务费	572,108.70	77,756.69
4. 交易费用	389.85	-
5. 利息支出	8,077,886.55	-
其中:卖出回购金融资产支出	8,077,886.55	-
6.税金及附加	11,902.79	-
7. 其他费用	229,981.65	21,772.20
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	82,292,451.16	2,416,241.08
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	82,292,451.16	2,416,241.08

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,959,519,795.92	-	2,959,519,795.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	82,292,451.16	82,292,451.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	1,170,433,660.55	-	1,170,433,660.55
其中:1.基金申购款	4,753,089,661.76	-	4,753,089,661.76
2.基金赎回款	-3,582,656,001.21	-	-3,582,656,001.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-82,292,451.16	-82,292,451.16
五、期末所有者权益(基金净值)	4,129,953,456.47	-	4,129,953,456.47
项目	上年度可比期间 2017年6月19日(基金合同生效日)至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,559,391,632.36	-	1,559,391,632.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,416,241.08	2,416,241.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-2,416,241.08	-2,416,241.08
五、期末所有者权益(基金净值)	1,559,391,632.36	-	1,559,391,632.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

林勇 胡昕彦 龚黎

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金(以下简称"国富日鑫月益30天理财债券基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2013]257号《关于核准富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金募集的批复》和机构部函[2017]983号《关于富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金延期募集备案的回函》核准,由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,559,151,732.81元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第647号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金基金合同》于2017年6月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,559,391,632.36份基金份额,其中认购资金利息折合239,899.55份基金份额。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")。

根据《富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金基金合同》和《富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据投资者认(申)购本基金的金额,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费,形成A类和B类两级基金份额。在基金存续期内的任何一个开放日,如A类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额余额达到或超过500万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户的A类基金份额升级为B类基金份额。如B类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额余额低于500万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户的B类基金份额降级为A类基金份额。本基金两类基金份额单独设置基金代码,并分别公布每万份基金净收益、七日年化收益率和运作期年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,通知存款,短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据,及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于2018年8月25日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、财税[2011]13号《关于调整地方教育附加有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4)本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金销售机构
国海证券股份有限公司("国海证券")	基金管理人的股东、基金销售机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年6月19日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,078,729.52	131,587.06
其中:支付销售机构的客户维护费	241,686.20	96,724.68

注:支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.28%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值X 0.28% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年6月19日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,451,065.64	37,596.24

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.08%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值X 0.08% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富日鑫月益30天理财债券A	国富日鑫月益30天理财债券B	合计
国海富兰克林基金管理有限公司	432.60	162,414.39	162,846.99
中国银行	55,526.07	1,624.73	57,150.80
合计	55,958.67	164,039.12	219,997.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年6月19日(基金合同生效日)至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富日鑫月益30天理财债券A	国富日鑫月益30天理财债券B	合计
国海富兰克林基金管理有限公司	25.63	813.67	839.30
中国银行	74,399.71	969.87	75,369.58
合计	74,425.34	1,783.54	76,208.88

注:支付基金销售机构的A类基金份额和B类基金份额的销售服务费分别按前一日该类基金资产净值0.27%和0.01%的年费率计提。其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值X约定年费率/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	国富日鑫月益30天理财债券A	国富日鑫月益30天理财债券B
基金合同生效日(2017年6月19日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	50,040,036.55
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	50,040,036.55
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2017年6月19日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	国富日鑫月益30天理财债券A	国富日鑫月益30天理财债券B
基金合同生效日(2017年6月19日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注:

1.本基金基金合同生效日为2017年6月19日。

2.基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

1.本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

2.本报告期末和上年度末(2017年12月31日)除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年6月19日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	2,024,571.14	41,737.46	1,356,430.75	41,013.26

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额399,613,100.57元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
111715252	17民生银行CD252	2018年7月3日	99.79	1,000,000	99,794,421.06
111815010	18民生银行CD010	2018年7月3日	97.71	1,106,000	108,069,115.51
080216	08国开16	2018年7月3日	100.32	300,000	30,095,268.59
140323	14进出23	2018年7月3日	101.04	600,000	60,624,646.97
160415	16农发15	2018年7月3日	99.50	110,000	10,944,597.66
180201	18国开01	2018年7月4日	100.03	900,000	90,029,594.38
180404	18农发04	2018年7月4日	100.21	130,000	13,027,036.55
合计				4,146,000	412,584,680.72

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为2,880,613,957.62元,属于第三层次的余额为30,106,242.97元,无属于第一层次的余额。(2017年12月31日:第二层次:1,408,787,855.16元,无属于第一层次和第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

交易性金融资产

资产支持证券投资

2018年1月1日	-
购买	30,256,695.54
出售	-
转入第三层级	-
转出第三层级	-150,452.57
当期损失总额	-
- 计入损益的损失	-
2018年6月30日	30,106,242.97
2018年6月30日仍持有的资产计入2018年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下:

项目	2018年6月30日公允价值	估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产——资产支持证券	30,106,242.97	市场法	最近交易价格	100.00	正相关

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	2,910,720,200.59	64.15
	其中:债券	2,880,613,957.62	63.49
	资产支持证券	30,106,242.97	0.66
2	买入返售金融资产	910,864,150.89	20.07
	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	695,088,207.50	15.32
4	其他各项资产	20,720,893.74	0.46
5	合计	4,537,393,452.72	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	13.71	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	399,613,100.57	9.68
	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资产净值比例取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%"。本报告期内,未发生本基金债券正回购的资金余额占基金资产净值比例违反基金合同的情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	83
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	98
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	41

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过120天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	52.89	9.68
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
2	30天(含)—60天	8.45	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
3	60天(含)—90天	5.53	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
4	90天(含)—120天	15.66	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
5	120天(含)—397天(含)	26.83	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
合计		109.36	9.68

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	280,815,157.16	6.80
	其中:政策性金融债	280,815,157.16	6.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	430,195,168.06	10.42
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,169,603,632.40	52.53
8	其他	-	-
9	合计	2,880,613,957.62	69.75
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:

1、上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

2、同业存单中,投资于AAA同业存单的比例为74.43%,AA+同业存单的比例为25.57%。

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111806029	18交通银行CD029	2,000,000	199,401,243.49	4.83
2	111894910	18广州银行CD035	1,700,000	164,108,217.60	3.97
3	111710368	17兴业银行CD368	1,600,000	159,662,463.50	3.87
4	011800649	18徐工SCP003	1,500,000	150,073,136.58	3.63
5	111895228	18宁夏银行CD033	1,500,000	148,046,449.18	3.58
6	111803101	18农业银行CD101	1,200,000	119,265,633.68	2.89
7	111815010	18民生银行CD010	1,200,000	117,254,013.21	2.84
8	011800164	18粤珠江SCP001	1,000,000	100,072,352.20	2.42
9	011800673	18国家核电SCP001	1,000,000	100,000,084.43	2.42
10	111715252	17民生银行CD252	1,000,000	99,794,421.06	2.42

7.7 "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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1533%
报告期内偏离度的最低值	0.0138%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0525%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	146328	借呗27A1	300,000	30,106,242.97	0.73

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

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。

本基金份额资产净值始终维持在1.00元。

7.9.2 本基金本期投资的前十名证券中,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、处罚的证券如下:

兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")于2018年5月4日收到中国银行保险监督管理委员会(以下简称"中国银保监会")出具的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监银罚决字[2018]1号)》,就兴业银行主要违法违规事实公告如下:(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;(六)债券卖出回购业务违规出表;(七)个人理财资金违规投资;(八)提供日期倒签的材料;(九)部分非现场监管统计数据与事实不符;(十)个别董事未经任职资格核准即履职;(十一)变相批量转让个人贷款;(十二)向四证不全的房地产项目提供融资。

中国银保监会处以罚款人民币5,870万元。

本基金对兴业银行投资决策说明:本公司的投研团队经过充分研究,认为上述事件仅对兴业银行短期经营有一定影响,不改变长期投资价值。同时由于本基金看好银行整体的长期发展前景,因此买入兴业银行。本基金管理人对该股的投资决策遵循公司的投资决策制度。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	606.70
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	20,381,687.04
4	应收申购款	338,600.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	20,720,893.74

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国富日鑫月益30天理财债券A	4,676	38,547.79	1,010.42	0.00%	180,248,473.00	100.00%
国富日鑫月益30天理财债券B	11	359,063,997.55	3,944,585,879.06	99.87%	5,118,093.99	0.13%
合计	4,687	881,150.73	3,944,586,889.48	95.51%	185,366,566.99	4.49%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国富日鑫月益30天理财债券A	2,562.93	0.001422%
	国富日鑫月益30天理财债券B	-	-
	合计	2,562.93	0.000062%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国富日鑫月益30天理财债券A	0
	国富日鑫月益30天理财债券B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国富日鑫月益30天理财债券A	0
	国富日鑫月益30天理财债券B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	国富日鑫月益30天理财债券A	国富日鑫月益30天理财债券B
基金合同生效日(2017年6月19日)基金份额总额	932,372,401.87	627,019,230.49
本报告期期初基金份额总额	220,548,552.68	2,738,971,243.24
本报告期基金总申购份额	731,286,572.90	4,021,778,835.84
减:本报告期基金总赎回份额	771,585,642.16	2,811,046,106.03
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	180,249,483.42	3,949,703,973.05

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(一)基金管理人重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

(二)基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自成立以来对其进行审计的均是普华永道中天会计师事务所,未曾改聘其他会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

(一)基金管理人及高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形:

本报告期内,基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

(二)基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国海证券	2	-	-	-	-	-

注:

1. 专用交易单元的选择标准和程序

1)选择代理基金证券买卖的证券经营机构的标准

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构,并租用其交易单元作为基金的专用交易单元。选择的标准是:

①资历雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币;

②财务状况良好,经营行为规范,最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚;

③内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

④具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务;

⑤研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的特定要求,提供专题研究报告。

2)公司基金交易佣金分配依据券商提供的研究报告和服务质量,评判标准包括但不限于:

①全面及时向公司提供高质量的关于宏观、行业和市场的研究报告;

②具有数量研究和开发能力;

③能有效组织上市公司调研;

④能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告;

⑤上门路演和电话会议的质量;

⑥与我公司投资和研究人员的信息交流和沟通能力;

⑦其他与投资相关的服务和支持。

3)租用基金专用交易单元的程序

①基金管理人根据上述标准考察证券经营机构,考察结果经公司领导审批后,我司与被选中的证券经营机构签订《券商交易单元租用协议》和《研究服务协议》,并办理基金专用交易单元租用手续。

②之后,基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况,根据如下选择标准细化的评价体系,每季度对签约证券经营机构的服务进行一次综合评价:

A 提供的研究报告质量和数量;

B 由基金管理人提出课题,证券经营机构提供的研究论文质量;

C 证券经营机构协助我公司研究员调研情况;

D 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况;

E 其他可评价的量化标准。

经过评价,对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留,并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。若本公司认为签约机构的服务不能满足要求,或签约机构违规受到国家有关部门的处罚,本公司有权终止签署的协议,并撤销租用的交易单元;基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构,租用其交易单元。

③交易单元租用协议期限为一年,到期后若双方没有异议可自动延期一年。

2、报告期内证券公司基金专用交易单元的变更情况

报告期内,本基金交易单元无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国海证券	51,252,064.39	100.00%	2,537,800,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

无。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年1月1日至2018年6月30日	1,500,000,000.00	541,315,537.42	-	2,041,315,537.42	49.43%
产品特有风险							

1.流动性风险

投资者大额赎回所持有的基金份额时,为了实现基金资产的迅速变现,在基金交易过程中可能存在无法实现交易价格最优;亦或导致基金仓位调整困难,基金资产不能迅速转变现金,产生流动性风险。

一旦引发巨额赎回,当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难,或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时,可能出现比例赎回、延期支付赎回款等情形。

管理人有权根据本基金合同和招募说明书的约定,基于投资者保护原则,暂停或拒绝申购、暂停赎回。

2.估值风险

投资者大额赎回所持有的基金份额时,基金份额净值可能受到尾差和部分赎回费归入基金资产的影响,从而导致非市场因素的净值异常波动。

国海富兰克林基金管理有限公司

2018年8月25日