

## 富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金

## 2017年度报告摘要

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

送出日期：2018年3月27日

## § 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员、基金经理等人员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，并对其内容的真實性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金经理人以忠实诚信、勤勉尽责的原则管理运用基金财产，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摘要。

本年度报告摘要于2018年年度报告全文，投资者了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告日期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

1.2

## § 2 基金简介

## 2.1 基金的基本情况

基金名称	国海富兰克林恒久信用债券
基金代码	460018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月11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
报告期天数	365,020.00份

基金合同终止日：不定期

下一级基金份额的赎回费率：国海富兰克林恒久信用债券A 国海富兰克林恒久信用债券C

下级基金份额的交易代码：460018 460019

报告期天数对应的每万份基金的收益总额：14,763,151.00份

报告期天数对应的每万份基金的收益：0.707,763.01份

2.2 基金产品说明

本基金的投资目标：在有效控制风险并保持资产流动性的基础上，通过积极的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争取得超越业绩比较基准的稳定回报。

投资策略：本基金将综合分析宏观经济形势、利率水平、资金供求状况、证券市场运行特征，通过评估各类资产的预期风险和预期收益，确定各类资产的配置比例。

业绩比较基准：6.0%+中债企业债指数收益率×60%+中债国债指数收益率×40%

风险特征：本基金为债券型基金，属于债券基金中的中低风险品种，其预期风险和预期收益水平低于股票基金，高于货币基金及短期理财基金。

4.3 管理人关于公平交易制度的说明

本公司建立了《公平交易管理制度》，确保公司旗下投资组合能够得到公平对待，避免各投资组合之间的利益输送行为。

1.在研究投资对象方面，投资研究等部门通过适当的会议会沟通机制，就相关问题进行讨论；公司建立了统一的研究平台，研究报告信息通过研究平台进行发布。

2.建立投资对象评价制度，投票权代表对所投项目需要由研究报告支持作为依据，并经过相关领导审批；建立研究报告的定期更新机制。

3.在投资决策方面，公司对各类资产管理业务之间建立防火墙，确保业务隔离及人员隔离，同时各投资组合经理投资决策保持独立。

4.公司对所有投资组合的交易指令实行集中交易，在公司交易系统中设置公平交易功能，按照时间优先、价格优先的原则执行并保存记录；公司内部严格执行了对债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易分配机制，以确保公平的合情合理地对待不同客户。

5.报告期内，公司建立了《公平交易管理制度》，明确了公平交易的原则，制定了公平交易的内部控制制度。

6.本公司定期对交易行为进行监控并记录在监察稽核定期报告中做专项说明。公司也会在各投资组合的定期报告中，披露公平交易制度执行情况及公平交易分析。

7.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

8.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

9.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

10.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

11.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

12.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

13.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

14.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

15.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

16.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

17.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

18.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

19.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

20.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

21.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

22.本公司定期对各投资组合的交易行为进行分析，对各投资组合分别投资类别（股票、债券、基金）进行归因分析，构建了异常交易的类型，异常交易的界定标准、相对价值判断等多方面的投资决策模型，构建了包括但不限于股票、债券、基金等在内的异常交易识别模型。

23.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 中国农业银行股份有限公司

姓名 赵晓东 钱军

信息披露负责人 联系电话 021-39365666 010-66000009

电子邮箱 service@fundtf.com tpxqcb@china.com

客户服务电话 400-700-4019, 021-39706005

客户服务邮箱 021-39706005

2.4 报告披露方式

基金业协会指定网站的正文中公开的互联网网址 www.fundtf.com

基金管理人和基金托管人的住所

2.5 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 年份期间数据

2017年 2016年 2015年

国海富久信 A 国海富久信 B 国海富久信 C 国海富久信 D 国海富久信 E

本期已实现收益 3,063,436.01 39,007,697.00 3,211,204 66,094,040 940,561,057 89,971,271

本期利润 1,27,130,327 27,161,458 1,009,040 46,402,232 56,228 99,978,29

加权平均基金份额净值 0.0262 0.0262 0.0262 0.0262 0.0262 0.0262

本期末基金资产净值 71,303,090.00 1,119,125,968 1,026,000 1,788,041,46 43,967,708 898,29 92,457,207

期末基金总份额 1,2020 1,2020 1,2020 1,2020 1,2020 1,2020

期末基金净值 1.2020 1.2020 1.2020 1.2020 1.2020 1.2020

3.1.2 年度数据

3.1.3 年度利润

3.1.4 年度可供分配利润

3.1.5 年度可供分配利润

3.1.6 年度可供分配利润

3.1.7 年度可供分配利润

3.1.8 年度可供分配利润

3.1.9 年度可供分配利润

3.1.10 年度可供分配利润

3.1.11 年度可供分配利润

3.1.12 年度可供分配利润

3.1.13 年度可供分配利润

3.1.14 年度可供分配利润

3.1.15 年度可供分配利润

3.1.16 年度可供分配利润

3.1.17 年度可供分配利润

3.1.18 年度可供分配利润

3.1.19 年度可供分配利润

3.1.20 年度可供分配利润

3.1.21 年度可供分配利润

3.1.22 年度可供分配利润

3.1.23 年度可供分配利润

3.1.24 年度可供分配利润

3.1.25 年度可供分配利润

3.1.26 年度可供分配利润

3.1.27 年度可供分配利润

3.1.28 年度可供分配利润

3.1.29 年度可供分配利润

3.1.30 年度可供分配利润

3.1.31 年度可供分配利润

3.1.32 年度可供分配利润

3.1.33 年度可供分配利润

3.1.34 年度可供分配利润

3.1.35 年度可供分配利润

3.1.36 年度可供分配利润

3.1.37 年度可供分配利润

3.1.38 年度可供分配利润

3.1.39 年度可供分配利润

3.1.40 年度可供分配利润

3.1.41 年度可供分配利润

3.1.42 年度可供分配利润

3.1.43 年度可供分配利润

3.1.44 年度可供分配利润

3.1.45 年度可供分配利润

3.1.46 年度可供分配利润

3.1.47 年度可供分配利润

3.1.48 年度可供分配利润

3.1.49 年度可供分配利润

3.1.50 年度可供分配利润

3.1.51 年度可供分配利润

3.1.52 年度可供分配利润

3.1.53 年度可供分配利润

3.1.54 年度可供分配利润