

富兰克林国海恒通纯债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：交通银行股份有限公司
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。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。

基金管理人通过交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2017年3月10日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金名称	国海富兰克林基金管理有限公司
基金代码	000406
交易网站	http://www.fund100.com
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月10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	交通银行股份有限公司
报告期天数	30/642,163份
基金合同的期限	不定期

2.2 基金产品说明	
投资目标	通过积极主动的资产配置，在保持基金资产流动性和严格控制风险的前提下，本基金力争在战胜业绩比较基准的基础上获得超越市场的收益。
投资策略	（一）资产配置策略 通过投资收益基点的形成和变化趋势，对各类投资品种进行深入分析，当收益基点出现变化时，结合基金投资组合所处的市场环境，适时调整基金资产在不同类别资产之间的配置比例，来使得本基金的投资组合能够得到公平对待。
（二）行业配置策略 本基金将通过深入研究各行业的景气周期，选择具有较好发展前景的行业进行投资，从而在不同行业之间进行资产配置。	
（三）个券选择策略 本基金将通过深入研究各券种的信用评级、发行主体的经营状况、盈利能力、流动性、估值水平等，精选出具有较高投资价值的个券进行投资。	
（四）债券投资策略 本基金将通过深入研究各券种的信用评级、发行主体的经营状况、支付能力、偿债能力和流动性等，精选出具有较高投资价值的个券进行投资。	
（五）风险管理策略 本基金将通过深入研究各券种的信用评级、发行主体的经营状况、支付能力、偿债能力和流动性等，精选出具有较高投资价值的个券进行投资。	
（六）其他投资策略 本基金将通过深入研究各券种的信用评级、发行主体的经营状况、支付能力、偿债能力和流动性等，精选出具有较高投资价值的个券进行投资。	
（七）资产支持证券投资策略 本基金将通过深入研究各券种的信用评级、发行主体的经营状况、支付能力、偿债能力和流动性等，精选出具有较高投资价值的个券进行投资。	
（八）国债期货投资策略 本基金将通过深入研究各券种的信用评级、发行主体的经营状况、支付能力、偿债能力和流动性等，精选出具有较高投资价值的个券进行投资。	
（九）中小企业私募债投资策略 本基金将通过深入研究各券种的信用评级、发行主体的经营状况、支付能力、偿债能力和流动性等，精选出具有较高投资价值的个券进行投资。	
（十）股票质押回购策略 本基金将通过深入研究各券种的信用评级、发行主体的经营状况、支付能力、偿债能力和流动性等，精选出具有较高投资价值的个券进行投资。	
（十一）定期开放策略 本基金将通过深入研究各券种的信用评级、发行主体的经营状况、支付能力、偿债能力和流动性等，精选出具有较高投资价值的个券进行投资。	
（十二）资产支持票据投资策略 本基金将通过深入研究各券种的信用评级、发行主体的经营状况、支付能力、偿债能力和流动性等，精选出具有较高投资价值的个券进行投资。	
（十三）资产配置策略 本基金将通过深入研究各券种的信用评级、发行主体的经营状况、支付能力、偿债能力和流动性等，精选出具有较高投资价值的个券进行投资。	
（十四）其他投资策略 本基金将通过深入研究各券种的信用评级、发行主体的经营状况、支付能力、偿债能力和流动性等，精选出具有较高投资价值的个券进行投资。	

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 交通银行股份有限公司
住所	深圳市福田区深南大道7010号雅荷大厦16层 中国上海市浦东新区银城中路16号18层
法定代表人	赵晓东 郭继纲
信息披露负责人	赵晓东 021-3892-5500 021-3892-5500 service@fund100.com
电子邮箱	021-3892-5500 021-3892-5500 service@fund100.com
客户服务电话	400-700-4010-5610-5600 和 021-3892-5500
传真	021-6989-3060 021-69720126

2.4 信息披露方式	
登载基金半年度报告的管理人互联网网址	www.fund100.com
基金业协会指定披露信息的网站	www.cifra.org.cn

§ 3 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 回购价款余额	2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日 2,900,406.00
3.1.2 期末可供分配利润	2,896,302.41
3.1.3 年度平均基金份额变动	0.0309
3.1.4 基金份额净值	25.1%
3.1.5 所有者权益	31,062,843.73
3.1.6 基金份额净值	1.0137

注：1. 本基金合同生效日为2017年3月10日。本基金2017年度主要财务指标的计算期间为2017年3月10日-2017年12月31日。
2. 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金管理信息披露编报规则 - 第1号《主要财务指标的计算及披露》。

3. 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)扣除非当期费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

5. 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

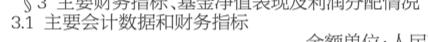
阶段	份额增长率为 长期持有 长短期差 ②	份额增长率为 收益基准 收益差额 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.67%	0.03%	0.60%	-0.03%
过去六个月	1.40%	0.06%	-1.30%	0.06%
过去一年	2.01%	0.06%	-1.95%	0.06%
成立以来	22.01%	0.06%	-2.18%	0.06%
最近一年	21.03%	0.06%	-2.05%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较



注：本基金的基金合同生效日为2017年3月10日，截止本报告期末已完成建仓报告期距建仓结束不满一年。本基金在6个月建仓期结束后，各项投资比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金成立于2017年3月10日，故2017年的业绩为成立日至年底的业绩而非全年的业绩。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 现金分红总额 (元)	每10份基金份额 股息形式股息 总额	每10份基金份额 股息形式股息 总额	备注
2017	0.1310	339,206.00	331,401	339,479.78
合计	0.1310	339,206.00	331,401	339,479.78

注：本基金成立于2017年3月10日，故2017年的业绩为成立日至年底的业绩而非全年的业绩。

3.4 管理人报告

3.4.1 基金管理人及其管理基金的基金

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国海普顿国际有限公司共同出资组建，目前公司注册资本2.22亿元人民币，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全国A股市场第16家上市公司，拥有全国业务牌照，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、研究平台和风控控制体系，借助国海证券股份有限公司的综合业务优势，力图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31只基金产品。

3.4.2 基金经理（或基金经理助理）及基金经理助理简介

姓名	职务	性别	国籍	从业资格	说明
邓峰伟	基金经理	男	中国	基金从业资格	邓峰伟先生，厦门大学金融学硕士，历任深国投资产管理有限公司项目经理、深国投资本管理有限公司项目经理、深国投资本管理有限公司高级经理，现任国海富兰克林基金管理有限公司基金经理。邓峰伟先生具有10年以上的证券从业经验，具备良好的职业操守和严谨的工作态度，具备较强的沟通协调能力和团队合作精神，能够独立履行基金经理职责。

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。

3.2.4 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，本基金管理人严格按照法律法规和《富兰克林国海恒通纯债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取最大利益，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。

3.2.5 管理人对本基金年度报告编制的说明

基金管理人按照法律法规和《富兰克林国海恒通纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定，结合本公司的实际情况，组织编写了本基金年度报告。

3.2.6 管理人对本基金年度报告的评价

基金管理人认为，本基金年度报告真实、准确、完整地反映了本基金本年度的运作情况，不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

3.2.7 管理人对本基金年度报告的报备情况

基金管理人已按相关法律法规和《富兰克林国海恒通纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定，将本基金年度报告于2018年3月25日复核后报送给中国证监会和本公司住所地中国证监会派出机构。

3.2.8 管理人对本基金年度报告的解释和说明