

**富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金  
2016年半年度报告**

**2016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：2016年8月26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2016年8月23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2016年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| 1.2 目录.....                                  | 3  |
| §2 基金简介.....                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现.....                        | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8  |
| §4 管理人报告.....                                | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 12 |
| 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.....             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 13 |
| 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.....       | 13 |
| §5 托管人报告.....                                | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....                  | 13 |
| 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..... | 13 |
| 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.....     | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）.....                      | 14 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 14 |
| 6.2 利润表.....                                 | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 17 |
| 6.4 报表附注.....                                | 18 |
| §7 投资组合报告.....                               | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 41 |
| 7.2 债券回购融资情况.....                            | 42 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限.....                        | 42 |
| 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.....         | 43 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 43 |
| 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....      | 44 |
| 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....          | 44 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....   | 45 |
| 7.9 投资组合报告附注.....                            | 45 |
| §8 基金份额持有人信息.....                            | 46 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                   | 46 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....                | 46 |
| 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情况.....        | 47 |
| §9 开放式基金份额变动.....                            | 47 |
| §10 重大事件揭示.....                              | 47 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                        | 47 |
| 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.....        | 48 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....             | 48 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                          | 48 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                   | 48 |

---

|      |                                   |    |
|------|-----------------------------------|----|
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况..... | 48 |
| 10.7 | 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....          | 48 |
| 10.8 | 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....             | 50 |
| 10.9 | 其他重大事件.....                       | 50 |
| §11  | 备查文件目录.....                       | 52 |
| 11.1 | 备查文件目录.....                       | 52 |
| 11.2 | 存放地点.....                         | 52 |
| 11.3 | 查阅方式.....                         | 52 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                     |                      |                   |
|---------------------|----------------------|-------------------|
| 基金名称                | 富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金 |                   |
| 基金简称                | 国富日日收益货币             |                   |
| 基金主代码               | 000203               |                   |
| 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           |                   |
| 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          | 9,109,458,442.24份    |                   |
| 基金合同存续期             | 不定期                  |                   |
| 下属两级基金的基金简称         | 国富日日收益货币A            | 国富日日收益货币B         |
| 下属两级基金的交易代码         | 000203               | 000204            |
| 报告期末下属两级基金的份<br>额总额 | 294,888,899.03份      | 8,814,569,543.21份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 在力求保持基金资产安全性与较高流动性的基础上，追求稳定的当期收益。   |
| 投资策略 | <p>本基金主要为投资者提供现金管理工具，通过积极的投资组合管理，同时充分把握市场短期失衡带来的套利机会，在安全性、流动性和收益性之间寻求最佳平衡点。</p> <p>1、剩余期限结构配置</p> <p>基于对国内外宏观经济形势、国家货币政策和财政政策、短期资金市场利率波动、资金供求、市场结构变化等因素的深入研究，对利率期限结构变动趋势进行研判，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。当预期短期利率上升时，缩短组合的平均剩余期限；当预期短期利率下降时，适度延长组合的平均剩余期限。</p> <p>2、类属资产配置策略</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>根据市场环境，结合各债券品种之间的流动性、相对收益水平、信用等级、参与主体资金的供求变化及到期期限等因素，灵活运用哑铃形策略、梯形策略及纺锤形策略等，确定组合中各债券品种的配置比例。</p> <p>3、个券选择，构建投资组合</p> <p>构建不同券种的收益率曲线预测模型，对货币市场工具进行估值，确定价格中枢的变动趋势，在综合考虑风险收益匹配水平及流动性的基础上，投资于各类属债券中价值低估的个券。在保证投资组合低风险、高流动性的前提下，构建投资组合，并根据投资环境的变化相机调整，尽可能提升组合的收益。</p> <p>4、现金流均衡管理策略</p> <p>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，在保证基金资产充分流动性的基础上，获取稳定的收益。</p> <p>5、充分把握市场短期失衡带来的套利机会</p> <p>由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级发生突然变化等情况会造成市场在短期内的非有效性；由于新股、新债发行以及季节效应等因素会使市场资金供求关系发生短期失衡。本基金管理人将积极把握由于市场短期失衡而带来的套利机会，通过跨市场套利、跨品种套利、跨期限套利、正回购放大等策略获取超额收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 同期7 天通知存款利率（税后）  |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。  |

### 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<br>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                                   | 010-66594896         |
|         | 电子邮箱 | service@ftsfund.com                             | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-700-4518、9510-5680<br>和021-38789555         | 95566                |
| 传真      |      | 021-6888 3050                                   | 010-66594942         |
| 注册地址    |      | 广西南宁市西乡塘区总部<br>路1号中国—东盟科技企业<br>孵化基地一期C-6栋二<br>层 | 北京市西城区复兴门内大<br>街1号   |
| 办公地址    |      | 上海市浦东新区世纪大道<br>8号上海国金中心二期9层                     | 北京市西城区复兴门内大<br>街1号   |
| 邮政编码    |      | 200120  | 100818               |
| 法定代表人   |      | 吴显玲   | 田国立                  |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 证券日报            |
| 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  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                 | 办公地址                        |
|--------|--------------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 国海富兰克林基金管理有限<br>公司 | 上海市浦东新区世纪大道8号上<br>海国金中心二期9层 |

## §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

|               |                           |           |
|---------------|---------------------------|-----------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2016年1月1日-2016年6月30日） |           |
|               | 国富日日收益货币A                 | 国富日日收益货币B |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 2,316,499.43     | 63,601,157.90    |
| 本期利润          | 2,316,499.43     | 63,601,157.90    |
| 本期净值收益率       | 1.1583%          | 1.2801%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日) |                  |
| 期末基金资产净值      | 294,888,899.03   | 8,814,569,543.21 |
| 期末基金份额净值      | 1.000            | 1.000            |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2016年6月30日) |                  |
| 累计净值收益率       | 11.8502%         | 12.6401%         |

注：

1.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。

2.本基金利润分配按月结转份额。

## 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

(1) 国富日日收益货币A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

| 阶段(A级)      | 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       | 0.1890<br>%  | 0.0013<br>% | 0.1068<br>% | 0.0000<br>%   | 0.0822<br>% | 0.0013<br>% |
| 过去三个月       | 0.5711<br>%  | 0.0014<br>% | 0.3248<br>% | 0.0000<br>%   | 0.2463<br>% | 0.0014<br>% |
| 过去六个月       | 1.1583<br>%  | 0.0018<br>% | 0.6517<br>% | 0.0000<br>%   | 0.5066<br>% | 0.0018<br>% |
| 过去一年        | 2.5617<br>%  | 0.0048<br>% | 1.3192<br>% | 0.0000<br>%   | 1.2425<br>% | 0.0048<br>% |
| 自基金合同生效日起至今 | 11.8502<br>% | 0.0058<br>% | 3.9686<br>% | 0.0000<br>%   | 7.8816<br>% | 0.0058<br>% |

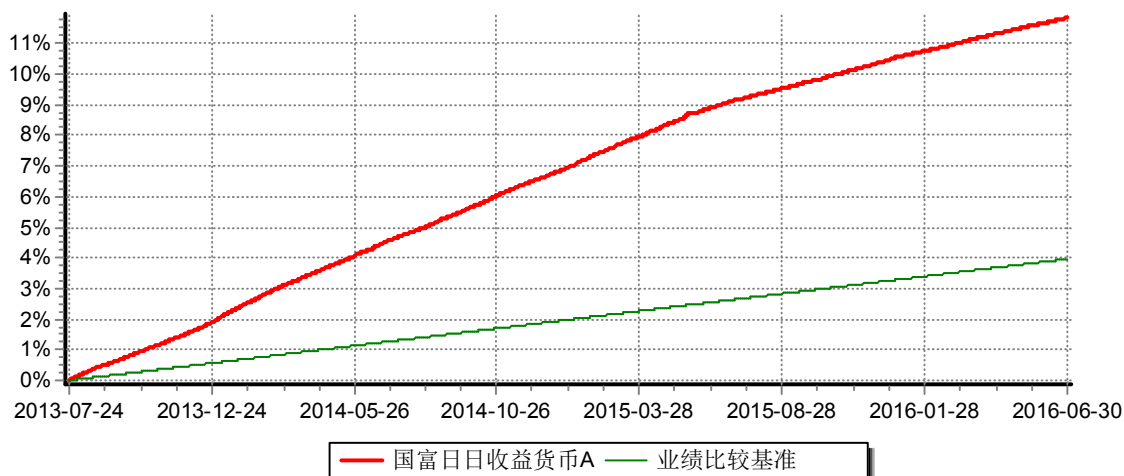
(2) 国富日日收益货币B基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

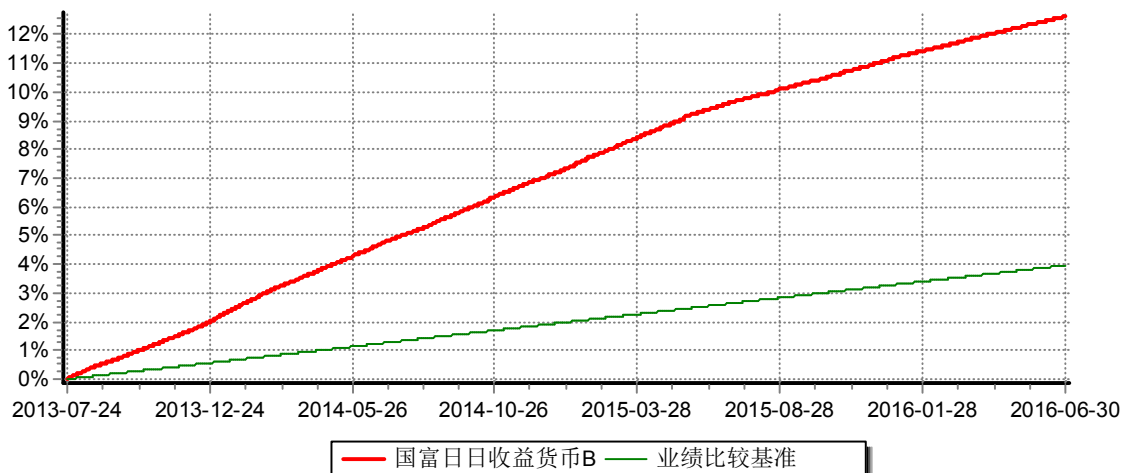


较

| 阶段(B级)      | 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       | 0.2081<br>%  | 0.0012<br>% | 0.1068<br>% | 0.0000<br>%   | 0.1013<br>% | 0.0012<br>% |
| 过去三个月       | 0.6306<br>%  | 0.0014<br>% | 0.3248<br>% | 0.0000<br>%   | 0.3058<br>% | 0.0014<br>% |
| 过去六个月       | 1.2801<br>%  | 0.0018<br>% | 0.6517<br>% | 0.0000<br>%   | 0.6284<br>% | 0.0018<br>% |
| 过去一年        | 2.8079<br>%  | 0.0050<br>% | 1.3192<br>% | 0.0000<br>%   | 1.4887<br>% | 0.0050<br>% |
| 自基金合同生效日起至今 | 12.6401<br>% | 0.0059<br>% | 3.9686<br>% | 0.0000<br>%   | 8.6715<br>% | 0.0059<br>% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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2013年7月24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65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25只基金产品（包含A、C类混合基金，A、B、C类债券基金，A、B类货币市场基金）。

#### 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期限 |      | 证券从业年限 | 说明                     |
|-----|--------|-------------|------|--------|------------------------|
|     |        | 任职日期        | 离任日期 |        |                        |
| 胡永燕 | 国富日日收益 | 2013年7月24日  | —    | 8年     | 胡永燕女士，中国人民大学金融学硕士。历任华泰 |

|    |  |            |   |    |  |
|----|--|------------|---|----|--|
|    | 货币基金、国富恒丰定期债券基金、国富新机遇混合基金、国富新增长混合基金及国富新价值混合基金的基金经理 |            |   |    | 资产管理有限公司固定收益组合管理部研究员、投资助理及投资经理，并曾在国海富兰克林基金管理有限公司负责公司投资管理部固定收益小组固定收益类产品的投资与研究工<br>作。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、国富恒丰定期债券基金、国富新机遇混合基金、国富新增长混合基金及国富新价值混合基金的基金经理。 |
| 王莉 | 国富日日收益货币基金的基金经理                                    | 2016年1月22日 | — | 6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的基金经理。  |

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合规守信情况的说明

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《富兰克林国海日日收益货币市场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。

中国证监会上海监管局于前一报告期间对公司进行了常规全面现场检查，本报告期内就公司内部控制提出了相应改进意见并采取责令改正的行政监管措施，公司已经按照要求完成了改进工作。

### 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，公司不同投资组合之间发生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%的情况发生一次，为相关投资组合经理因投资组合投资策略不同而发生的同日反向交易，经公司检查和分析未发现异常情况。

### 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

债券市场上半年先抑后扬，收益率呈现冲高回落走势。春节之前债券市场延续去年牛市行情，收益率持续下探至年内低点。在一季度强劲的经济数据和超预期的信贷数据公布后，投资者对经济的过度悲观预期得到纠正，债券收益率止跌回升。至营改增前夕，国债金融债利率大幅上升，与此同时在密集的信用违约事件冲击下，产能过剩和低评级民企债券遭到市场抛弃，导致信用债收益率快速上行。五六月份伴随经济数据和通胀数据的回落，市场气氛有所复苏，债券收益率震荡下行，信用债市场仍然延续分化走势。

报告期内，本基金保持较低的债券仓位，债券结构中以政策性金融债与主体评级为AAA的信用债为主，同时加强对存单的投资。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，基金份额A类净值增长1.1583%，同期业绩比较基准增长0.6517%，基金超额收益率0.5066%，基金份额B类净值增长1.2801%，同期业绩比较基准增长0.6517%，基金超额收益率0.6284%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后期，国内一线地产持续降温将可能拖累下阶段经济数据和信贷数据的表现，构成基本面的利好。外围市场英国脱欧、美国延迟加息亦对市场气氛有所提振。如果银行理财收益率要求回报进一步降低，债券市场收益率将有进一步打开的空间。

预计下阶段的交易性机会仍将在利率债和高信用等级债券上，高收益债券则期待行业拐点到来而形成的结构性机会。与此同时，需要密切关注的风险包括汇率贬值和通胀加剧对市场情绪的冲击。

本基金将根据市场资金面的变化和组合的资金变化，在作好流动性管理的前提下，将为基金持有人创造稳健的收益。

#### 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

本基金利润分配按月结转份额。本基金管理人已根据本基金基金合同和相关法律法规的规定对应分配利润进行了分配。

#### 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”）在对富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金（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、基金份额申购赎回价格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：富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

金额单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2016年6月30日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|------------|---------|-------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                   |                     |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 4,545,197,442.75  | 4,142,024,147.37    |
| 结算备付金      |         |                   | —                   |
| 存出保证金      |         | —                 | —                   |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 2,169,539,484.20  | 1,767,033,850.28    |
| 其中：股票投资    |         | —                 | —                   |
| 基金投资       |         | —                 | —                   |
| 债券投资       |         | 2,169,539,484.20  | 1,767,033,850.28    |
| 资产支持证券投资   |         | —                 | —                   |
| 贵金属投资      |         | —                 | —                   |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | —                 | —                   |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | 2,546,777,240.16  | 2,475,404,543.10    |
| 应收证券清算款    |         | —                 | —                   |
| 应收利息       | 6.4.7.5 | 37,873,405.77     | 28,245,320.28       |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收股利            |            | —                         | —                           |
| 应收申购款           |            | 264,463,081.18            | 41,533,866.52               |
| 递延所得税资产         |            | —                         | —                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | —                         | —                           |
| 资产总计            |            | 9,563,850,654.06          | 8,454,241,727.55            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2015年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                           |                             |
| 短期借款            |            | —                         | —                           |
| 交易性金融负债         |            | —                         | —                           |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | —                         | —                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | 401,799,599.10            | —                           |
| 应付证券清算款         |            | 39,899,818.42             | —                           |
| 应付赎回款           |            | 80,019.82                 | 170,519.87                  |
| 应付管理人报酬         |            | 1,496,273.10              | 669,625.28                  |
| 应付托管费           |            | 453,416.07                | 202,916.75                  |
| 应付销售服务费         |            | 67,562.08                 | 93,946.46                   |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 88,122.36                 | 34,613.07                   |
| 应交税费            |            | —                         | —                           |
| 应付利息            |            | 22,016.44                 | —                           |
| 应付利润            |            | 10,405,204.76             | 6,820,022.27                |
| 递延所得税负债         |            | —                         | —                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 80,179.67                 | 161,256.03                  |
| 负债合计            |            | 454,392,211.82            | 8,152,899.73                |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 9,109,458,442.24          | 8,446,088,827.82            |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | —                         | —                           |
| 所有者权益合计         |            | 9,109,458,442.24          | 8,446,088,827.82            |
| 负债和所有者权益总计      |            | 9,563,850,654.06          | 8,454,241,727.55            |

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.000元，基金份额总额9,109,458,442.24份，其中A类基金份额总额294,888,899.03份，B类基金份额总额8,814,569,543.21份。

## 6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金

本报告期：2016年1月1日-2016年6月30日

金额单位：人民币元

| 项目                        | 附注号            | 本期2016年1月1日<br>-2016年6月30日 | 上年度可比期间2015<br>年01月01日-2015年06<br>月30日 |
|---------------------------|----------------|----------------------------|--|
| 一、收入                      |                | 81,219,395.50              | 22,140,990.91                          |
| 1.利息收入                    |                | 77,127,098.77              | 19,843,930.14                          |
| 其中：存款利息收入                 | 6.4.7.11       | 44,705,624.17              | 10,620,301.79                          |
| 债券利息收入                    |                | 23,830,470.16              | 8,247,605.11                           |
| 资产支持证券利息收<br>入            |                | —                          | —                                      |
| 买入返售金融资产收<br>入            |                | 8,591,004.44               | 976,023.24                             |
| 其他利息收入                    |                | —                          | —                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）          |                | 4,092,296.73               | 2,297,060.77                           |
| 其中：股票投资收益                 |                | —                          | —                                      |
| 基金投资收益                    |                | —                          | —                                      |
| 债券投资收益                    | 6.4.7.12       | 4,092,296.73               | 2,297,060.77                           |
| 资产支持证券投资收<br>益            | 6.4.7.12.<br>3 | —                          | —                                      |
| 贵金属投资收益                   | 6.4.7.13       | —                          | —                                      |
| 衍生工具收益                    | 6.4.7.14       | —                          | —                                      |
| 股利收益                      |                | —                          | —                                      |
| 3.公允价值变动收益（损失以<br>“-”号填列） |                | —                          | —                                      |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填<br>列）     |                | —                          | —                                      |
| 5.其他收入（损失以“-”号填<br>列）     |                | —                          | —                                      |



|                     |          |               |               |
|---------------------|----------|---------------|---------------|
| 减：二、费用              |          | 15,301,738.17 | 3,229,266.40  |
| 1. 管理人报酬            |          | 8,547,981.62  | 1,456,924.90  |
| 2. 托管费              |          | 2,590,297.36  | 441,492.48    |
| 3. 销售服务费            |          | 507,685.05    | 273,160.74    |
| 4. 交易费用             | 6.4.7.15 | 320.00        | —             |
| 5. 利息支出             |          | 3,483,231.13  | 921,204.41    |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | 3,483,231.13  | 921,204.41    |
| 6. 其他费用             | 6.4.7.16 | 172,223.01    | 136,483.87    |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) |          | 65,917,657.33 | 18,911,724.51 |
| 减：所得税费用             |          | —             | —             |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)   |          | 65,917,657.33 | 18,911,724.51 |

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金

本报告期：2016年1月1日-2016年6月30日

金额单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2016年1月1日-2016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)                   | 8,446,088,827.82           | —             | 8,446,088,827.82   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)          | —                          | 65,917,657.33 | 65,917,657.33      |
| 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) | 663,369,614.42             | —             | 663,369,614.42     |
| 其中：1.基金申购款                        | 15,645,822,073.55          | —             | 15,645,822,073.55  |
| 2.基金赎回款                           | -14,982,452,459.13         | —             | -14,982,452,459.13 |

|  |                                    |                |                   |
|--|------------------------------------|----------------|-------------------|
| 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) | —                                  | -65,917,657.33 | -65,917,657.33    |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 9,109,458,442.24                   | —              | 9,109,458,442.24  |
| 项 目                                    | 上年度可比期间<br>2015年01月01日-2015年06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)                        | 1,652,912,497.42                   | —              | 1,652,912,497.42  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | —                                  | 18,911,724.51  | 18,911,724.51     |
| 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)      | -821,851,210.64                    | —              | -821,851,210.64   |
| 其中：1.基金申购款                             | 2,778,457,394.36                   | —              | 2,778,457,394.36  |
| 2.基金赎回款                                | -3,600,308,605.00                  | —              | -3,600,308,605.00 |
| 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) | —                                  | -18,911,724.51 | -18,911,724.51    |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 831,061,286.78                     | —              | 831,061,286.78    |

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：

吴显玲

胡昕彦

黄宇虹

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

富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金(以下简称“国富日日收益货币市场基

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]366号《关于核准富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金募集的批复》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《富兰克林国海日日收益货币市场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1,789,653,168.69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(2013)第462号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金基金合同》于2013年7月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,789,816,474.37份基金份额,其中认购资金利息折合163,305.68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。

根据《富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金基金合同》和《富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据基金份额持有人持有本基金的基金份额数量设定不同分类,将基金份额分为A类和B类,对各类基金份额按照不同的费率计提销售服务费。在基金存续期内的任何一个开放日,如A类基金份额持有人持有的基金份额余额达到500万份,即调整为B类份额持有人,如B类基金份额持有人持有的基金份额余额少于500万份,即降级为A类份额持有人。本基金两类基金份额单独设置基金代码,并单独公布每万份已实现收益和基金七日年化收益率。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金、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、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,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)的中央银行票据以及中国证监会以及中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为:同期7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2016年8月26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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海日日收益货币市场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发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期间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2016年6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016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**

##### **6.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2016年1月1日至2016年6月30日。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(1) 金融资产的分类**

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### **(2) 金融负债的分类**

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

##### **6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易

费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的A、B类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 6.4.4.8 损益平准金

不适用。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法

差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一级别基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值1.00元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

### 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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2016年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 45,497,442.75     |
| 定期存款         | 4,499,700,000.00  |
| 其中：存款期限1-3个月 | 2,547,700,000.00  |
| 存款期限1个月以内    | 50,000,000.00     |
| 存款期限3个月以上    | 1,902,000,000.00  |
| 合计           | 4,545,197,442.75  |

注：

1.定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

2.本基金报告期内提前支取部分定期存款，根据约定，原定期存款利率不变，提前支取未造成利息损失。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

金额单位：人民币元

| 项目 |       | 本期末 2016年6月30日       |                      |              |         |
|----|-------|----------------------|----------------------|--------------|---------|
|    |       | 摊余成本                 | 影子定价                 | 偏离金额         | 偏离度     |
| 债券 | 交易所市场 | —                    | —                    | —            | —       |
|    | 银行间市场 | 2,169,539,484.2<br>0 | 2,171,046,000.0<br>0 | 1,506,515.80 | 0.0165% |
|    | 合计    | 2,169,539,484.2<br>0 | 2,171,046,000.0<br>0 | 1,506,515.80 | 0.0165% |

注：

1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；



2. 偏离度 = 偏离金额 / 摊余成本法确定的基金资产净值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

金额单位：人民币元

| 项目    | 本期末2016年6月30日    |           |
|-------|------------------|-----------|
|       | 账面余额             | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 600,000,000.00   | —         |
| 银行间市场 | 1,946,777,240.16 | —         |
| 合计    | 2,546,777,240.16 | —         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

### 6.4.7.5 应收利息

金额单位：人民币元

| 项目         | 本期末 2016年6月30日 |
|------------|----------------|
| 应收活期存款利息   | 12,894.83      |
| 应收定期存款利息   | 14,527,316.08  |
| 应收其他存款利息   | —              |
| 应收结算备付金利息  | —              |
| 应收债券利息     | 22,375,522.47  |
| 应收买入返售证券利息 | 957,672.39     |
| 应收申购款利息    | —              |
| 应收黄金合约拆借孳息 | —              |
| 其他         | —              |
| 合计         | 37,873,405.77  |

### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

金额单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|----------------|
| 交易所市场应付交易费用 | —              |
| 银行间市场应付交易费用 | 88,122.36      |
| 合计          | 88,122.36      |

**6.4.7.8 其他负债**

金额单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —              |
| 应付赎回费       | 119.69         |
| 审计费         | 40,278.42      |
| 信息披露费       | 39,781.56      |
| 合计          | 80,179.67      |

**6.4.7.9 实收基金****6.4.7.9.1 国富日日收益货币A**

金额单位：人民币元

| 项目(A级)        | 本期2016年1月1日-2016年6月30日 |                   |
|---------------|------------------------|-------------------|
|               | 基金份额(份)                | 账面金额              |
| 上年度末          | 1,182,692,037.09       | 1,182,692,037.09  |
| 本期申购          | 389,341,201.39         | 389,341,201.39    |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -1,277,144,339.45      | -1,277,144,339.45 |
| 本期末           | 294,888,899.03         | 294,888,899.03    |

**6.4.7.9.2 国富日日收益货币B**

金额单位：人民币元

| 项目(B级) | 本期2016年1月1日-2016年6月30日 |                   |
|--------|------------------------|-------------------|
|        | 基金份额(份)                | 账面金额              |
| 上年度末   | 7,263,396,790.73       | 7,263,396,790.73  |
| 本期申购   | 15,256,480,872.16      | 15,256,480,872.16 |

|               |                    |                    |
|---------------|--------------------|--------------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -13,705,308,119.68 | -13,705,308,119.68 |
| 本期末           | 8,814,569,543.21   | 8,814,569,543.21   |

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 国富日日收益货币A

金额单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分 | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末           | —             | —     | —             |
| 本期利润           | 2,316,499.43  | —     | 2,316,499.43  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | —             | —     | —             |
| 其中：基金申购款       | —             | —     | —             |
| 基金赎回款          | —             | —     | —             |
| 本期已分配利润        | -2,316,499.43 | —     | -2,316,499.43 |
| 本期末            | —             | —     | —             |

##### 6.4.7.10.2 国富日日收益货币B

金额单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分 | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 上年度末           | —              | —     | —              |
| 本期利润           | 63,601,157.90  | —     | 63,601,157.90  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | —              | —     | —              |
| 其中：基金申购款       | —              | —     | —              |
| 基金赎回款          | —              | —     | —              |
| 本期已分配利润        | -63,601,157.90 | —     | -63,601,157.90 |
| 本期末            | —              | —     | —              |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

金额单位：人民币元

|    |                        |
|----|------------------------|
| 项目 | 本期2016年1月1日-2016年6月30日 |
|----|------------------------|

|           |               |
|-----------|---------------|
| 活期存款利息收入  | 57,260.88     |
| 定期存款利息收入  | 44,630,421.07 |
| 其他存款利息收入  | —             |
| 结算备付金利息收入 | 17,942.22     |
| 其他        | —             |
| 合计        | 44,705,624.17 |

#### 6.4.7.11 股票投资收益

无。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

金额单位：人民币元

| 项目                               | 本期<br>2016年1月1日-2016年6月30日 |
|----------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券<br>(债转股及债券到期兑付)差价收入 | 4,092,296.73               |
| 债券投资收益——赎回差价收入                   | —                          |
| 债券投资收益——申购差价收入                   | —                          |
| 合计                               | 4,092,296.73               |

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

金额单位：人民币元

| 项目                          | 本期<br>2016年1月1日-2016年6月30日 |
|-----------------------------|----------------------------|
| 卖出债券(债转股及债券到期<br>兑付)成交总额    | 3,982,937,881.50           |
| 减: 卖出债券(债转股及债券<br>到期兑付)成本总额 | 3,933,742,740.25           |
| 减: 应收利息总额                   | 45,102,844.52              |

|          |              |
|----------|--------------|
| 买卖债券差价收入 | 4,092,296.73 |
|----------|--------------|

**6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.13 贵金属投资收益****6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.14 股利收益**

无。

**6.4.7.15 交易费用**

金额单位：人民币元

| 项目        | 本期2016年1月1日-2016年6月30日 |
|-----------|------------------------|
| 交易所市场交易费用 | —                      |
| 银行间市场交易费用 | 320.00                 |
| 合计        | 320.00                 |

**6.4.7.16 其他费用**

金额单位：人民币元

| 项目      | 本期2016年1月1日-2016年6月30日 |
|---------|------------------------|
| 审计费用    | 40,278.42              |
| 信息披露费   | 39,781.56              |
| 银行汇划费用  | 73,663.03              |
| 债券账户维护费 | 18,000.00              |
| 回购手续费   | —                      |
| 其他手续费   | 500.00                 |
| 合计      | 172,223.01             |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 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。

**6.4.9.2 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、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、基金代销机构        |
| 国海证券股份有限公司 ("国海证券") | 基金管理人的股东、基金代销机构     |
| 国海富兰克林资产管理(上海)有限公司  | 基金管理人的全资子公司         |

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。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

金额单位：人民币元

| 项目               | 本期2016年1月1日-2016年6月30日 | 上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日 |
|------------------|------------------------|--------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 8,547,981.62           | 1,456,924.90                   |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 218,018.25             | 298,534.66                     |

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0.33%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 0.33% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

金额单位：人民币元

| 项目             | 本期2016年1月1日-2016年6月30日 | 上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日 |
|----------------|------------------------|--------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,590,297.36           | 441,492.48                     |

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0.10%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 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日-2016年6月30日     |               |            |
|----------------|--------------------------------|---------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费               |               |            |
|                | 国富日日收益货币<br>A                  | 国富日日收益货币<br>B | 合计         |
| 国海富兰克林基金管理有限公司 | 29,549.97                      | 232,535.49    | 262,085.46 |
| 中国银行           | 27,811.57                      | 1,453.54      | 29,265.11  |
| 国海证券           | 30,720.10                      | 1,786.65      | 32,506.75  |
| 合计             | 88,081.64                      | 235,775.68    | 323,857.32 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日 |               |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费               |               |            |
|                | 国富日日收益货币<br>A                  | 国富日日收益货币<br>B | 合计         |
| 国海富兰克林基金管理有限公司 | 23,407.07                      | 23,486.66     | 46,893.73  |
| 中国银行           | 60,052.70                      | 5,453.39      | 65,506.09  |
| 国海证券           | 23,055.94                      | 230.91        | 23,286.85  |
| 合计             | 106,515.71                     | 29,170.96     | 135,686.67 |

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0.25%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 × 约定年费率 / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

金额单位：人民币元

| 本期2016年1月1日-2016年6月30日             |               |      |       |      |                   |            |
|------------------------------------|---------------|------|-------|------|-------------------|------------|
| 银行间市场交易的各关联方名称                     | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购             |            |
|                                    | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额              | 利息支出       |
| 中国银行                               | 99,954,143.33 | —    | —     | —    | 10,848,941,000.00 | 793,994.93 |
| 上年度可比期间<br>2015年01月01日-2015年06月30日 |               |      |       |      |                   |            |
| 银行间市场交易的各关联方名称                     | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购             |            |
|                                    | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额              | 利息支出       |
| 中国银行                               | —             | —    | —     | —    | 1,508,300,000.00  | 62,622.37  |

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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2016年1月1日-2016年6月30日 |                | 上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日 |               |
|--------------|------------------------|----------------|--------------------------------|---------------|
|              | 国富日日收益货币A              | 国富日日收益货币B      | 国富日日收益货币A                      | 国富日日收益货币B     |
| 期初持有的基金份额    | —                      | 181,669,680.70 | —                              | 66,751,179.40 |
| 期间申购/买入总份额   | —                      | 97,890,401.52  | —                              | 86,592,609.37 |
| 期间因拆分变动份额    | —                      | —              | —                              | —             |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | —                      | 77,970,000.00  | —                              | 57,000,000.00 |



|                   |   |                |   |               |
|-------------------|---|----------------|---|---------------|
| 期末持有的基金份额         | — | 201,590,082.22 | — | 96,343,788.77 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | — | 2.29%          | — | 13.79%        |

注：基金管理人运用自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。

#### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

| 关联方名称             |  | 本期末<br>2016年6月30日 |                              | 上年度末<br>2015年12月31日 |                              |
|-------------------|--|-------------------|------------------------------|---------------------|------------------------------|
|                   |  | 持有的<br>基金份额       | 持有的基金<br>份额<br>占基金总份<br>额的比例 | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金<br>份额<br>占基金总份<br>额的比例 |
| 国富日日<br>收益货币<br>A | 国海证券股<br>份有限公司   | —                 | —                            | —                   | —                            |
| 国富日日<br>收益货币<br>A | 邓普顿国际<br>股份有限公<br>司<br>(Templeton<br>International,<br>Inc.) | —                 | —                            | —                   | —                            |
| 国富日日<br>收益货币<br>A | 中国银行股<br>份有限公司   | —                 | —                            | —                   | —                            |
| 国富日日<br>收益货币<br>A | 国海富兰克<br>林资产管理<br>(上海)有限<br>公司                               | —                 | —                            | 2,268,457.83        | 0.19%                        |
| 国富日日<br>收益货币<br>B | 国海证券股<br>份有限公司   | —                 | —                            | —                   | —                            |
| 国富日日              | 邓普顿国际  | —                 | —                            | —                   | —                            |

|                   |   |                   |       |   |   |
|-------------------|---|-------------------|-------|---|---|
| 收益货币<br>B         | 股份有限公<br>司<br>(Templeton<br>International,<br>Inc.) |                   |       |   |   |
| 国富日日<br>收益货币<br>B | 中国银行股<br>份有限公司                                      | —                 | —     | — | — |
| 国富日日<br>收益货币<br>B | 国海富兰克<br>林资产管理<br>(上海)有限<br>公司                      | 19,205,203.9<br>8 | 0.22% | — | — |

注：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。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期2016年1月1日-2016年6月30<br>日 |              | 上年度可比期间2015年01月01日<br>-2015年06月30日 |              |
|----------------|----------------------------|--------------|------------------------------------|--------------|
|                | 期末<br>余额                   | 当期<br>存款利息收入 | 期末<br>余额                           | 当期<br>存款利息收入 |
| 中国银行股份<br>有限公司 | 45,497,442.75              | 57,260.88    | 930,590.47                         | 8,929.94     |

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>实收基金(A级) | 直接通过应付<br>赎回款转出金<br>额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|----------------------|-----------------------|--------------|----------|----|
|                      |                       |              |          |    |

|                      |                       |               |               |    |
|----------------------|-----------------------|---------------|---------------|----|
| 5,107,768.25         | 514,128.47            | -3,305,397.29 | 2,316,499.43  |    |
| 已按再投资形式转<br>实收基金(B级) | 直接通过应付<br>赎回款转出金<br>额 | 应付利润<br>本年变动  | 本期利润分配合计      | 备注 |
| 48,566,914.19        | 8,143,663.93          | 6,890,579.78  | 63,601,157.90 |    |

#### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016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401,799,599.10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         |
|--------|------------|------------|--------|------------------|----------------|
| 150222 | 15国开<br>22 | 2016-07-01 | 100.00 | 1,000,000.0<br>0 | 99,999,007.24  |
| 150417 | 15农发<br>17 | 2016-07-01 | 100.80 | 700,000.00       | 70,560,026.86  |
| 150419 | 15农发<br>19 | 2016-07-01 | 100.03 | 600,000.00       | 60,015,417.14  |
| 160204 | 16国开<br>04 | 2016-07-01 | 99.86  | 550,000.00       | 54,921,602.38  |
| 160211 | 16国开<br>11 | 2016-07-01 | 99.97  | 300,000.00       | 29,989,545.60  |
| 150215 | 15国开<br>15 | 2016-07-01 | 100.00 | 1,500,000.0<br>0 | 150,004,597.34 |
| 合计     |            |            |        | 4,650,000.0<br>0 | 465,490,196.56 |

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险控制部负责投资风险管理与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，其他定期存款存放在兴业银行股份有限公司、光大银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、民生银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、南京银行股份有限公司以及上海农村商业银行股份有限公司等银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在A-1级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2016年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为17.84%(2015年12月31日：14.88%)。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资于一家公司发行的短期企业债券的比例不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的20%。

于2016年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响

的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

| 本期末2016年6月30日 | 6个月以内            | 6个月-1年         | 1-5年          | 5年以上 | 不计息            | 合计               |
|---------------|------------------|----------------|---------------|------|----------------|------------------|
| 资产            |                  |                |               |      |                |                  |
| 银行存款          | 4,515,197,442.75 | 30,000,000.00  | —             | —    | —              | 4,545,197,442.75 |
| 交易性金融资产       | 1,637,357,741.51 | 461,621,715.83 | 70,560,026.86 | —    | —              | 2,169,539,484.20 |
| 买入返售金融资产      | 2,546,777,240.16 | —              | —             | —    | —              | 2,546,777,240.16 |
| 应收利息          | —                | —              | —             | —    | 37,873,405.77  | 37,873,405.77    |
| 应收申购款         | —                | —              | —             | —    | 264,463,081.18 | 264,463,081.18   |
| 资产总计          | 8,699,332,424.42 | 491,621,715.83 | 70,560,026.86 | —    | 302,336,486.95 | 9,563,850,654.06 |
| 负债            |                  |                |               |      |                |                  |
| 卖出回购金融资产款     | 401,799,599.10   | —              | —             | —    | —              | 401,799,599.10   |
| 应付证券清算款       | —                | —              | —             | —    | 39,899,818.42  | 39,899,818.42    |
| 应付赎回款         | —                | —              | —             | —    | 80,019.82      | 80,019.82        |
| 应付管理人报酬       | —                | —              | —             | —    | 1,496,273.10   | 1,496,273.10     |
| 应付托管费         | —                | —              | —             | —    | 453,416.07     | 453,416.07       |

|                 |                  |                |               |      |                |                  |
|-----------------|------------------|----------------|---------------|------|----------------|------------------|
| 应付销售服务费         | —                | —              | —             | —    | 67,562.08      | 67,562.08        |
| 应付交易费用          | —                | —              | —             | —    | 88,122.36      | 88,122.36        |
| 应付利息            | —                | —              | —             | —    | 22,016.44      | 22,016.44        |
| 应付利润            | —                | —              | —             | —    | 10,405,204.76  | 10,405,204.76    |
| 其他负债            | —                | —              | —             | —    | 80,179.67      | 80,179.67        |
| 负债总计            | 401,799,599.10   | —              | —             | —    | 52,592,612.72  | 454,392,211.82   |
| 利率敏感度缺口         | 8,297,532,825.32 | 491,621,715.83 | 70,560,026.86 | —    | 249,743,874.23 | 9,109,458,442.24 |
| 上年度末2015年12月31日 | 6个月以内            | 6个月-1年         | 1-5年          | 5年以上 | 不计息            | 合计               |
| 资产              |                  |                |               |      |                |                  |
| 银行存款            | 4,142,024,147.37 | —              | —             | —    | —              | 4,142,024,147.37 |
| 交易性金融资产         | 905,587,827.92   | 861,446,022.36 | —             | —    | —              | 1,767,033,850.28 |
| 买入返售金融资产        | 2,475,404,543.10 | —              | —             | —    | —              | 2,475,404,543.10 |
| 应收利息            | —                | —              | —             | —    | 28,245,320.28  | 28,245,320.28    |
| 应收申购款           | —                | —              | —             | —    | 41,533,866.52  | 41,533,866.52    |
| 资产总计            | 7,523,016,518.39 | 861,446,022.36 | —             | —    | 69,779,186.80  | 8,454,241,727.55 |
| 负债              |                  |                |               |      |                |                  |
| 应付赎回款           | —                | —              | —             | —    | 170,519.87     | 170,519.87       |
| 应付管理人报酬         | —                | —              | —             | —    | 669,625.28     | 669,625.28       |
| 应付托管费           | —                | —              | —             | —    | 202,916.7      | 202,916.7        |

|         |                  |                |   |   |               |                  |
|---------|------------------|----------------|---|---|---------------|------------------|
|         |                  |                |   |   | 5             | 5                |
| 应付销售服务费 | —                | —              | — | — | 93,946.46     | 93,946.46        |
| 应付交易费用  | —                | —              | — | — | 34,613.07     | 34,613.07        |
| 应付利润    | —                | —              | — | — | 6,820,022.27  | 6,820,022.27     |
| 其他负债    | —                | —              | — | — | 161,256.03    | 161,256.03       |
| 负债总计    | —                | —              | — | — | 8,152,899.73  | 8,152,899.73     |
| 利率敏感度缺口 | 7,523,016,518.39 | 861,446,022.36 | — | — | 61,626,287.07 | 8,446,088,827.82 |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                               |                     |
|----|--------------------|-------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（金额单位：人民币元） |                     |
|    |                    | 本期末<br>2016年6月30日             | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|    | 市场利率下降25个基点        | 增加约33万元                       | 增加约40万元             |
|    | 市场利率上升25个基点        | 减少约32万元                       | 减少约-40万元            |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 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2016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无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为2,169,539,484.20元，无属于第三层次的余额(2015年12月31日：第二层次1,767,033,850.28元，无第一及第三层次)。于2016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负债均属于第一层次(2015年12月31日：同)。

**(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**

无。

**(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具**

于2016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(2015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 | 2,169,539,484.20 | 22.68         |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 其中：债券             | 2,169,539,484.20 | 22.68  |
|   | 资产支持证券            | —                | —      |
| 2 | 买入返售金融资产          | 2,546,777,240.16 | 26.63  |
|   | 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      | 4,545,197,442.75 | 47.52  |
| 4 | 其他各项资产            | 302,336,486.95   | 3.16   |
| 5 | 合计                | 9,563,850,654.06 | 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 | 6.80           |               |
|    | 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 | 401,799,599.10 | 4.41          |
|    | 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

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

## 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    | 64 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 94 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 44 |

## 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过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                | 48.69               | 4.85                |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | —                   | —                   |
| 2  | 30天(含)—60天           | 13.15               | —                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | —                   | —                   |
| 3  | 60天(含)—90天           | 16.09               | —                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | —                   | —                   |
| 4  | 90天(含)—120天          | 3.89                | —                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | —                   | —                   |
| 5  | 120天(含)—397天(含)      | 19.84               | —                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | —                   | —                   |
|    | 合计                   | 101.66              | 4.85                |

## 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

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过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      | 545,466,654.35 | 5.99          |
|    | 其中：政策性金融债 | 545,466,654.35 | 5.99          |
| 4  | 企业债券      | —              | —             |

|   |                    |                  |       |
|---|--------------------|------------------|-------|
| 5 | 企业短期融资券            | 1,030,708,727.40 | 11.31 |
| 6 | 中期票据               | —                | —     |
| 7 | 同业存单               | 593,364,102.45   | 6.51  |
| 8 | 合计                 | 2,169,539,484.20 | 23.82 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | —                | —     |

注：上表中，付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。

### 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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<br>(张) | 摊余成本           | 占基金资产净值<br>比例(%) |
|----|-----------|-------------|-------------|----------------|------------------|
| 1  | 150215    | 15国开15      | 1,500,000   | 150,004,597.34 | 1.65             |
| 2  | 150222    | 15国开22      | 1,000,000   | 99,999,007.24  | 1.10             |
| 3  | 111618172 | 16华夏CD172   | 1,000,000   | 99,289,441.10  | 1.09             |
| 4  | 111691669 | 16南京银行CD032 | 1,000,000   | 97,814,226.10  | 1.07             |
| 5  | 011599905 | 15京汽SCP001  | 800,000     | 80,320,384.12  | 0.88             |
| 6  | 011699482 | 16商飞SCP001  | 800,000     | 79,978,150.13  | 0.88             |
| 7  | 150417    | 15农发17      | 700,000     | 70,560,026.86  | 0.77             |
| 8  | 071608004 | 16东方证券CP004 | 600,000     | 60,065,805.48  | 0.66             |
| 9  | 150419    | 15农发19      | 600,000     | 60,015,417.14  | 0.66             |
| 10 | 160401    | 16农发01      | 600,000     | 59,995,855.16  | 0.66             |

### 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                  | 0.0945% |

|                        |         |
|------------------------|---------|
| 报告期内偏离度的最低值            | 0.0071% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0464% |

### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本报告期内本货币市场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

注：本报告期内本货币市场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名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在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：

南京银行股份有限公司（以下简称“南京银行”）2016年4月8日发布关于收到中国证券监督管理委员会江苏监管局行政监管措施决定书公告。中国证券监督管理委员会江苏监管局（以下简称“江苏证监局”）对南京银行基金销售业务进行了现场检查。随后，南京银行收到江苏证监局《关于对南京银行股份有限公司采取责令改正措施的决定》（【2016】3号）。决定针对南京银行个别支行基金宣传推介材料存在违规情形、未出具年度监察稽核报告、两项关于基金销售的管理制度未报备、基金销售业务规范执行不到位等问题，对南京银行采取出具责令改正的行政监管措施。

南京银行将依据《证券投资基金销售管理办法》等相关监管规定，进一步加强基金代销业务的合规管理工作，积极做好上述问题的整改工作。

本基金对南京银行投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，上述《决定》是江苏证监局对南京银行采取的行政监管措施，上述事件仅对南京银行短期经营有一定影响，不改变南京银行长期投资价值。同时由于本基金看好南京银行经营体制灵活，估值较为合理，因此买入南京银行。本基金管理人对该股票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

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额             |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | —              |
| 2  | 应收证券清算款 | —              |
| 3  | 应收利息    | 37,873,405.77  |
| 4  | 应收申购款   | 264,463,081.18 |
| 5  | 其他应收款   | —              |
| 6  | 待摊费用    | —              |
| 7  | 其他      | —              |
| 8  | 合计      | 302,336,486.95 |

## §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<br>级别          | 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额     | 持有人结构                |                |                    |                |
|-------------------|--------------|-------------------|----------------------|----------------|--------------------|----------------|
|                   |              |                   | 机构投资者                |                | 个人投资者              |                |
|                   |              |                   | 持有<br>份额             | 占总份<br>额<br>比例 | 持有<br>份额           | 占总份<br>额<br>比例 |
| 国富日<br>日收益<br>货币A | 13,108       | 22,496.86         | 13,733,582.<br>57    | 4.66%          | 281,155,316<br>.46 | 95.34%         |
| 国富日<br>日收益<br>货币B | 101          | 87,272,965.<br>77 | 8,729,069,4<br>03.60 | 99.03%         | 85,500,139.<br>61  | 0.97%          |
| 合计                | 13,209       | 689,640.28        | 8,742,802,9<br>86.17 | 95.98%         | 366,655,456<br>.07 | 4.02%          |

## 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  |
|-------------|-------|--------------|-----------|
| 基金管理公司所有从业人 | 国富日日收 | 2,453,428.02 | 0.831984% |

|        |           |              |           |
|--------|-----------|--------------|-----------|
| 员持有本基金 | 益货币A      |              |           |
|        | 国富日日收益货币B | —            | —         |
|        | 合计        | 2,453,428.02 | 0.026933% |

### 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 | 国富日日收益货币A | >100              |
|                                | 国富日日收益货币B | 0                 |
|                                | 合计        | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 国富日日收益货币A | 10~50             |
|                                | 国富日日收益货币B | 0                 |
|                                | 合计        | 10~50             |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                           | 国富日日收益货币A        | 国富日日收益货币B         |
|---------------------------|------------------|-------------------|
| 基金合同生效日(2013年7月24日)基金份额总额 | 794,113,507.89   | 995,702,966.48    |
| 本报告期期初基金份额总额              | 1,182,692,037.09 | 7,263,396,790.73  |
| 本报告期基金总申购份额               | 389,341,201.39   | 15,256,480,872.16 |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 1,277,144,339.45 | 13,705,308,119.68 |
| 本报告期基金拆分变动份额              | —                | —                 |
| 本报告期期末基金份额总额              | 294,888,899.03   | 8,814,569,543.21  |

## §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

1、经国海富兰克林基金管理有限公司2015年股东会第八次会议审议通过，自2016年1月4日起，吴显玲女士不再担任公司董事长，由Gregory E. McGowan先生担任公司董事长。相关公告已于2016年1月9日在《中国证券报》和公司网站披露。

2、经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第二十二次会议审议通过，自2016年1月7日起，吴显玲女士担任公司总经理，全面主持经营管理工作。相关公告已于2016年1月9日在《中国证券报》和公司网站披露。

3、经公司决定，同意增聘王莉女士为富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金的基金经理，与现任基金经理胡永燕女士共同管理该基金。公司已办理完成上述基金经理的变更手续。详情请参阅2016年1月22日相关公告。

### （二）基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 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为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监管部门稽查或处罚的情况

### （一）基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚。

### （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 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元



| 券商名称 | 交易单元数量 | 债券成交金额 | 债券交易占当期成交总额的比例 | 债券回购成交金额         | 债券回购交易占当期成交总额的比例 | 权证交易成交金额 | 权证交易占当期成交总额的比例 | 应付券商的佣金 | 应付券商的佣金占当期佣金总量的比例 | 备注 |
|------|--------|--------|----------------|------------------|------------------|----------|----------------|---------|-------------------|----|
| 国海证券 | 2      | —      | —              | 3,058,300,000.00 | 100.00%          | —        | —              | —       | —                 | —  |

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：

- A 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；
- B 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；
- C 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；
- D 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；
- E 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：

- A 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；
- B 具有数量研究和开发能力；
- C 能有效组织上市公司调研；
- D 能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；
- E 上门路演和电话会议的质量；
- F 与我公司投资和研究人员的信息交流和沟通能力；
- G 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，本基金无交易单元变更。

## 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内未存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

## 10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 信息披露方式         | 披露日期       |
|----|--|----------------|------------|
| 1  | 国海富兰克林基金管理有限公司关于因交易所发生指数熔断至收市调整旗下部分基金交易申请时间的公告 | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-01-05 |
| 2  | 国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告    | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-01-06 |
| 3  | 国海富兰克林基金管理有限公司关于因交易所发生指数熔断至收市调整旗下部分基金交易申请时间的公告 | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-01-08 |
| 4  | 国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告二则                     | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-01-09 |
| 5  | 富兰克林日日收益货币市场证券投资基金2015年第4季度报告                  | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-01-20 |
| 6  | 富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金基金经理变更公告                   | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-01-22 |
| 7  | 国海富兰克林基金管理有限公司关于基金经理因休产假暂停履行职务                 | 中国证监会指定报刊及公    | 2016-01-28 |

|    | 的公告   | 司网站            |            |
|----|---|----------------|------------|
| 8  | 富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金2016年“春节”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告         | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-02-02 |
| 9  | 日日收益货币市场基金2015年4季报数据更正公告                                      | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-02-06 |
| 10 | 富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金更新招募说明书(2016年第1号)                         | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-03-08 |
| 11 | 富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要(2016年第1号)                       | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-03-08 |
| 12 | 富兰克林日日收益货币市场证券投资基金2015年年度报告                                   | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-03-28 |
| 13 | 关于增加东方证券为富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金代销机构的公告                          | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-04-14 |
| 14 | 富兰克林日日收益货币市场证券投资基金2016年第1季度报告                                 | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-04-22 |
| 15 | 富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金2016年“劳动节”假期前暂停代销机构大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告 | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-04-27 |
| 16 | 关于基金经理结束产假恢复履行职务的公告   | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-05-24 |
| 17 | 富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金托管协议                                      | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-05-25 |
| 18 | 富兰克林国海日日收益货币市场基金的基金合同   | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-05-25 |
| 19 | 关于富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金修订基金合同和托管协议的公告                          | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-05-25 |
| 20 | 富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金2016年“端午节”假期                              | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2016-06-04 |

|  |                           |  |  |
|--|---------------------------|--|--|
|  | 前暂停大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告 |  |  |
|--|---------------------------|--|--|

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金托管协议》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站：[www.ftsfund.com](http://www.ftsfund.com)。

### 11.3 查阅方式

- 1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件；
- 2、登陆基金管理人网站[www.ftsfund.com](http://www.ftsfund.com) 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日