

富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金  
2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 28 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 2019 年 8 月 26 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 债券回购融资情况.....	40
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	41
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.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	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.....	43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....	43
7.9 投资组合报告附注.....	43
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
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的情况.....	46
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>47</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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稽查或处罚等情况.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	49
10.9 其他重大事件.....	49
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</b>
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.....	51
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53

12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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	2,442,001,668.17 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	112,955,420.78 份	2,329,046,247.39 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

	<p>(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。</p> <p>5、现金流管理策略</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，在保证基金资产流动性的基础上，获取稳定的收益。</p>
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
注册地址		广西南宁市西乡塘区总部路 1 号中国-东盟科技企业孵化基地一期 A-13 栋三层 306 号房	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 9 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		吴显玲	刘连舸

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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公司	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 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

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( 2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日 )	报告期( 2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	2,605,389.15	49,211,133.60
本期利润	2,605,389.15	49,211,133.60
本期净值收益率	1.4274%	1.5588%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2019 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	112,955,420.78	2,329,046,247.39
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( 2019 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	7.7747%	8.3482%

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，由于本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	0.2178%	0.0046%	0.1081%	0.0000%	0.1097%	0.0046%
过去三个月	0.6590%	0.0045%	0.3287%	0.0000%	0.3303%	0.0045%
过去六个月	1.4274%	0.0037%	0.6558%	0.0000%	0.7716%	0.0037%
过去一年	3.2236%	0.0040%	1.3314%	0.0000%	1.8922%	0.0040%
自基金合同生效起至今	7.7747%	0.0034%	2.7444%	0.0000%	5.0303%	0.0034%

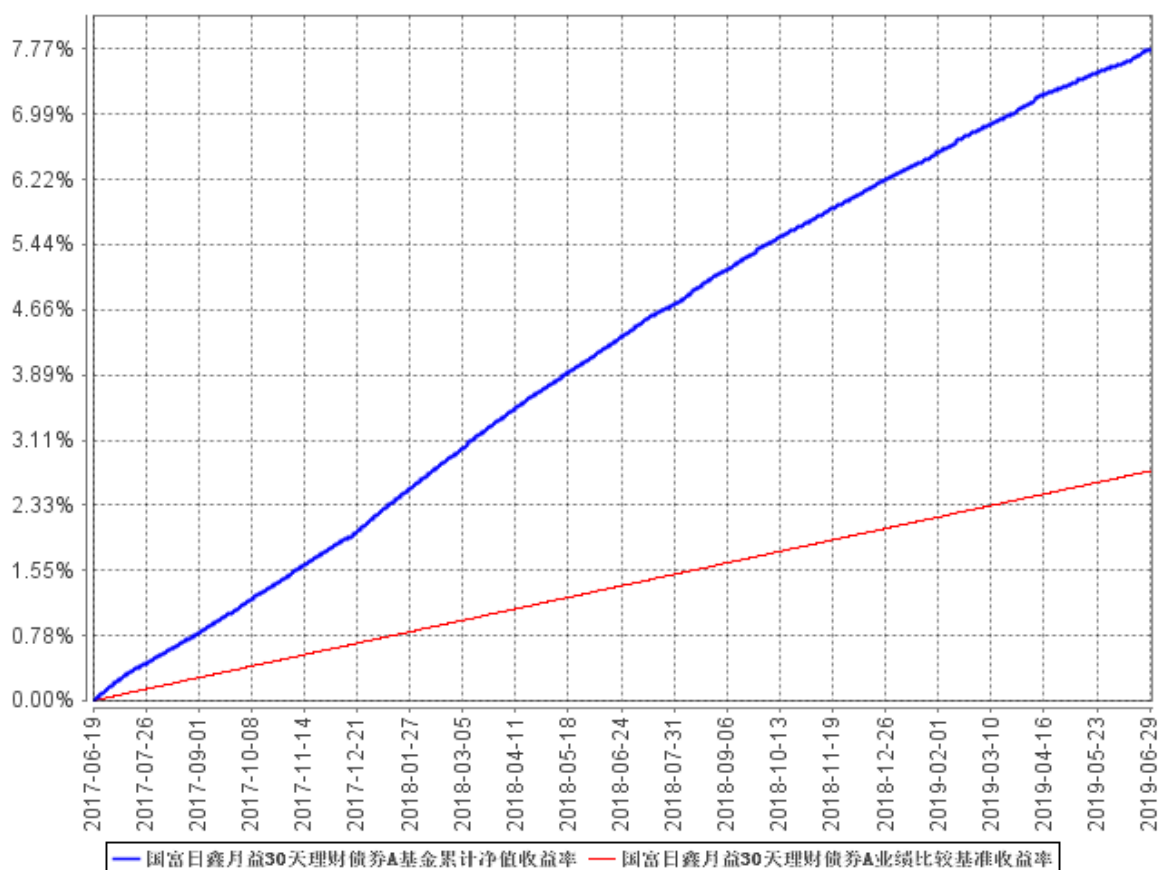
国富日鑫月益 30 天理财债券 B

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

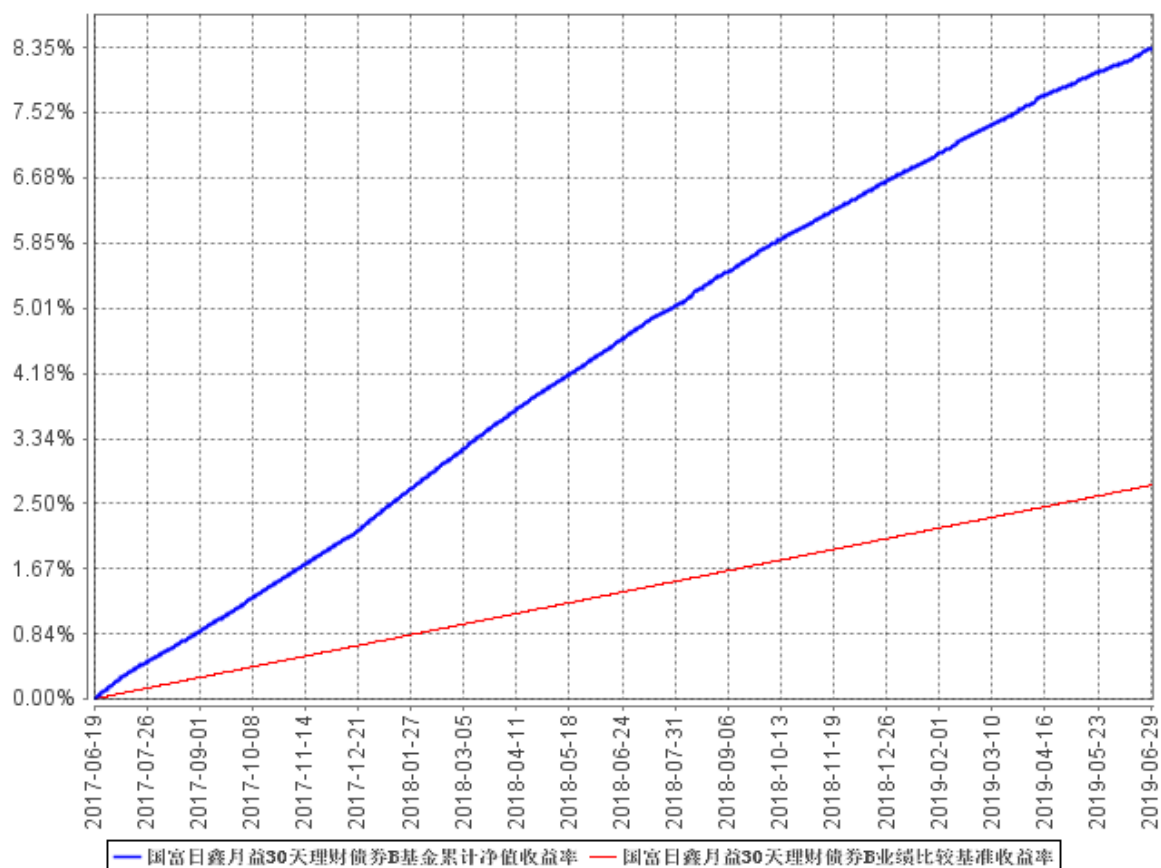
		准差②	率③	准差④		
过去一个月	0.2392%	0.0046%	0.1081%	0.0000%	0.1311%	0.0046%
过去三个月	0.7244%	0.0045%	0.3287%	0.0000%	0.3957%	0.0045%
过去六个月	1.5588%	0.0037%	0.6558%	0.0000%	0.9030%	0.0037%
过去一年	3.4922%	0.0040%	1.3314%	0.0000%	2.1608%	0.0040%
自基金合同生效起至今	8.3482%	0.0034%	2.7444%	0.0000%	5.6038%	0.0034%

### 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

国富日鑫月益30天理财债券A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



国富日鑫月益30天理财债券B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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，本公司旗下运作 32 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	-	9 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	2018 年 2 月 5 日	-	11 年	严婧璧女士，CFA，FRM 持证人，中国人民大学金融学硕士。历任太平资产管理有限公司交易员及国海富兰克

	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			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。
3. 严婧璧女士于 2019 年 7 月 27 日开始任国富日鑫月益 30 天理财债券基金的基金经理。

#### 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

2019 年上半年宏观经济总体平稳，韧性超出市场预期，而 2018 年后不断发酵的信用风险在 5 月底蔓延到了银行系统。另一方面，海外市场二季度以来贸易摩擦一度升级，市场阴云笼罩，全球经济状况不佳，多国进入降息周期。上半年央行通过定向降准，中期借贷便利、公开市场操作等丰富的货币市场工具维持了稳健中性的政策基调，在包商事件发生后更是积极应对，市场资金面整体平稳，但波动加大。在此复杂矛盾的背景下，长端利率走势比较纠结，整体收益率先上后下；短端与高评级信用品种二季度收益率有一波上行，但最终受益于流动性宽裕，再次进入下行通道；低评级债券特别是存单利差在 5 月底之后大幅扩大，流动性骤然缺失。

目前信用事件继续蔓延，做好信用风险控制是管理好流动性不可忽视的一步，需仔细筛选流动性尚佳且风险较小的信用品种。整体来看，各项资质良好的高评级存单及信用债受到挤出效应影响流动性不断提升，风险整体可控，是配置上比较理想的品种之一。

报告期内，本基金致力于做好品种切换和择时，选择在合适时机切换配置，以高评级同业存单为主力品种，间或投资性价比高且资质优良的 AAA 评级超短融，精细判断收益率曲线变化选择不同久期，在保持短期流动性的前提下力求锁定一部分长期资产的收益率，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 1.4274%，同期业绩比较基准增长 0.6558%，本基金跑赢业绩比较基准 0.7716%；本基金 B 类份额净值增长 1.5588%，同期业绩比较基准增长 0.6558%，本基金跑赢业绩比较基准 0.9030%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，海外市场进入降息周期，贸易冲突虽然继续反复但后果已经逐渐被市场所消化，中国宏观经济对于各条线的刺激政策的效果有待证实。目前整体信用事件仍在不断出现，预计市场流动性仍会较为宽裕，但央行的态度也明确表明不会大水漫灌，下半年依旧会处在较大的波动率中，且中低评级债券的分化继续。目前市场还有向下空间，但需时刻保持警惕预期差带来的市

场反弹，以流动性为优先。

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投资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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,138,038.22	829,045,684.68
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,538,439,740.43	3,932,191,994.42
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,538,439,740.43	3,932,191,994.42
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	-	791,192,106.78
应收证券清算款		40,000,000.00	-
应收利息	6.4.7.5	8,620,231.94	28,892,125.01
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,588,198,010.59	5,581,321,910.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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		141,759,509.16	420,333,729.50
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		621,829.14	1,238,794.01
应付托管费		177,665.43	353,941.17
应付销售服务费		47,499.20	127,666.64
应付交易费用	6.4.7.7	37,949.99	41,163.97

应交税费		28,528.15	34,171.09
应付利息		60,548.38	407,373.45
应付利润		3,345,580.68	6,412,484.96
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	117,232.29	379,000.00
负债合计		146,196,342.42	429,328,324.79
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,442,001,668.17	5,151,993,586.10
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,442,001,668.17	5,151,993,586.10
负债和所有者权益总计		2,588,198,010.59	5,581,321,910.89

注：报告截止日 2019 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 112,955,420.78 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 2,329,046,247.39 份。国富日鑫月益 30 天理财债券份额总额合计为 2,442,001,668.17 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至2019 年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年6月30日
<b>一、收入</b>		61,398,254.88	97,714,515.86
1.利息收入		56,637,995.12	95,445,183.86
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,836,063.24	29,174,836.06
债券利息收入		48,801,043.79	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		2,000,888.09	10,219,103.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,760,259.76	2,269,332.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,760,259.76	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	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-	-
<b>减: 二、费用</b>		9,581,732.13	15,422,064.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,677,787.42	5,078,729.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,336,510.64	1,451,065.64
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	400,784.66	572,108.70
4. 交易费用	6.4.7.18	486.20	389.85
5. 利息支出		3,005,484.48	8,077,886.55
其中: 卖出回购金融资产支出		3,005,484.48	8,077,886.55
6. 税金及附加		22,946.98	11,902.79
7. 其他费用	6.4.7.19	137,731.75	229,981.65
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		51,816,522.75	82,292,451.16
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		51,816,522.75	82,292,451.16

### 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: 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	5,151,993,586.10	-	5,151,993,586.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	51,816,522.75	51,816,522.75
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)	-2,709,991,917.93	-	-2,709,991,917.93
其中: 1. 基金申购款	49,246,451.23	-	49,246,451.23
2. 基金赎回款	-2,759,238,369.16	-	-2,759,238,369.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-51,816,522.75	-51,816,522.75

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	2,442,001,668.17	-	2,442,001,668.17
项目	上年度可比期间 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

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 \_\_\_\_\_

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_ 林勇 \_\_\_\_\_

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_ 龚黎 \_\_\_\_\_

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 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用，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 2019 年 8 月 28 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 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**

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### **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》及其他相关财税法规和实务操作,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) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	1,138,038.22
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,138,038.22

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

单位：人民币元

项目		本期末 2019 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	2,538,439,740.43	2,541,900,900.00	3,461,159.57	0.1417%
	合计	2,538,439,740.43	2,541,900,900.00	3,461,159.57	0.1417%
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	2,538,439,740.43	2,541,900,900.00	3,461,159.57	0.1417%

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	366.81
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	8,619,865.13
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	8,620,231.94

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。



**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2019 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	37,949.99
合计	37,949.99

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
审计费	49,588.57
账户维护费	9,000.00
信息披露费	58,643.72
合计	117,232.29

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

国富日鑫月益 30 天理财债券 A		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	328,698,009.04	328,698,009.04
本期申购	2,783,903.05	2,783,903.05
本期赎回(以“-”号填列)	-218,526,491.31	-218,526,491.31
本期末	112,955,420.78	112,955,420.78

金额单位：人民币元

国富日鑫月益 30 天理财债券 B		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,823,295,577.06	4,823,295,577.06
本期申购	46,462,548.18	46,462,548.18

本期赎回(以“-”号填列)	-2,540,711,877.85	-2,540,711,877.85
本期末	2,329,046,247.39	2,329,046,247.39

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

单位：人民币元

国富日鑫月益 30 天理财债券 A			
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	2,605,389.15	-	2,605,389.15
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	-2,605,389.15	-	-2,605,389.15
本期末	-	-	-

单位：人民币元

国富日鑫月益 30 天理财债券 B			
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	49,211,133.60	-	49,211,133.60
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	-49,211,133.60	-	-49,211,133.60
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	10,291.25
定期存款利息收入	5,824,709.51
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,062.48
其他	-
合计	5,836,063.24

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	4,760,259.76
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	4,760,259.76

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,006,055,671.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,970,230,845.27
减：应收利息总额	31,064,566.49
买卖债券差价收入	4,760,259.76

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	486.20
合计	486.20

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	58,643.72
账户维护费	18,000.00
银行汇划费用	10,899.46
其他手续费	600.00
合计	137,731.75

#### 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

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 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、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。

## 6.4.10 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

#### 6.4.10.1.1 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。

#### 6.4.10.1.2 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。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,677,787.42	5,078,729.52
其中：支付销售机构的客户维护费	111,524.94	241,686.20

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,336,510.64	1,451,065.64

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。

#### 6.4.10.2.3 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
国海证券	11.46	-	11.46
国海富兰克林基金管理有 限公司	205.01	158,064.85	158,269.86
中国银行	9,497.05	-	9,497.05
合计	9,713.52	158,064.85	167,778.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日					
	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	-	124,551,044.94	-	-	-	-
银行间市场交	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

易的各关联方名称	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	-	-	-	-	-	-

#### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	-	-

项目	上年度可比期间 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	-	-

注：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。

##### 6.4.10.4.2 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

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（2018 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。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	1,138,038.22	10,291.25	2,024,571.14	41,737.46

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**

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。

**6.4.10.7 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。

**6.4.11 利润分配情况**

金额单位：人民币元

## 国富日鑫月益30天理财债券A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
2,440,033.21	545,068.06	-379,712.12	2,605,389.15	-

## 国富日鑫月益30天理财债券B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
46,462,548.18	5,435,777.58	-2,687,192.16	49,211,133.60	-

**6.4.12 期末（2019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**

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。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。



### 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 2019 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 141,759,509.16 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
199918	19 贴现国债 18	2019 年 7 月 1 日	99.75	100,000	9,974,621.29
199922	19 贴现国债 22	2019 年 7 月 1 日	99.60	920,000	91,629,468.38
011900707	19 皖能源 SCP001	2019 年 7 月 1 日	100.00	440,000	44,001,873.34
合计				1,460,000	145,605,963.01

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只短期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。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，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 级以下或长期信用评级在 AAA 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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	115,004,320.88	20,068,625.59
A-1 以下	-	-
未评级	545,837,650.99	580,198,393.17
合计	660,841,971.87	600,267,018.76

注：未评级部分为到期日在一年以内的国债、政策性金融债、同业存单和短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	100,791,470.81	8,038,301.29
AAA 以下	-	-

未评级	-	130,163,684.48
合计	100,791,470.81	138,201,985.77

注：未评级部分为国债和政策性金融债。

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	1,678,122,366.84	2,695,093,470.59
AAA 以下	98,683,930.91	498,629,519.30
未评级	-	-
合计	1,776,806,297.75	3,193,722,989.89

#### 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。

于 2019 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 141,759,509.16 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行

持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### **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，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

单位：人民币元

本期末 2019 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	1,138,038.22	-	-	-	-	1,138,038.22
交易性金融资产	2,380,461,580.81	157,978,159.62	-	-	-	2,538,439,740.43
应收证券清算款	-	-	-	-	40,000,000.00	40,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	8,620,231.94	8,620,231.94
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,381,599,619.03	157,978,159.62	-	-	48,620,231.94	2,588,198,010.59
负债						
卖出回购金融资产款	141,759,509.16	-	-	-	-	141,759,509.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	621,829.14	621,829.14
应付托管费	-	-	-	-	177,665.43	177,665.43
应付销售服务费	-	-	-	-	47,499.20	47,499.20
应付交易费用	-	-	-	-	37,949.99	37,949.99
应付利息	-	-	-	-	60,548.38	60,548.38
应交税费	-	-	-	-	28,528.15	28,528.15
应付利润	-	-	-	-	3,345,580.68	3,345,580.68
其他负债	-	-	-	-	117,232.29	117,232.29
负债总计	141,759,509.16	-	-	-	4,436,833.26	146,196,342.42
利率敏感度缺口	2,239,840,109.87	157,978,159.62	-	-	-44,183,398.68	2,442,001,668.17
上年度末 2018 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	804,045,684.68	25,000,000.00	-	-	-	829,045,684.68
交易性金融资产	3,223,932,364.75	708,259,629.67	-	-	-	3,932,191,994.42
买入返售金融资产	791,192,106.78	-	-	-	-	791,192,106.78
应收利息	-	-	-	-	28,892,125.01	28,892,125.01
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,819,170,156.21	733,259,629.67	-	-	28,892,125.01	5,581,321,910.89
负债						
卖出回购金融资产款	420,333,729.50	-	-	-	-	420,333,729.50

应付管理人报酬	-	-	-	-	1,238,794.01	1,238,794.01
应付托管费	-	-	-	-	353,941.17	353,941.17
应付销售服务费	-	-	-	-	127,666.64	127,666.64
应付交易费用	-	-	-	-	41,163.97	41,163.97
应付利息	-	-	-	-	407,373.45	407,373.45
应交税费	-	-	-	-	34,171.09	34,171.09
应付利润	-	-	-	-	6,412,484.96	6,412,484.96
其他负债	-	-	-	-	379,000.00	379,000.00
负债总计	420,333,729.50	-	-	-	8,994,595.29	429,328,324.79
利率敏感度缺口	4,398,836,426.71	733,259,629.67	-	-	-19,897,529.72	5,151,993,586.10

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 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（单位：人民币万元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	增加约 130	增加约 246
2. 市场利率上升 25 个基点	减少约 130	减少约 246	

#### 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 2019 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 2,538,439,740.43 元，无属于第一层次和第三层次的余额。(2018 年 12 月 31 日：第二层次:3,932,191,994.42 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。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 2019 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(2018 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	2,538,439,740.43	98.08
	其中：债券	2,538,439,740.43	98.08
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,138,038.22	0.04
4	其他各项资产	48,620,231.94	1.88
5	合计	2,588,198,010.59	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	7.06	
	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	141,759,509.16	5.81
	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	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	97
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	60

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金合同约定：“本基金将投资组合的平均剩余期限控制在 150 天以内”。本报告期内，未发生投资组合的平均剩余期限违反基金合同的情况。

### 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	30.33	5.81
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	32.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	11.92	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	4.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	26.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		105.63	5.81

### 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	111,604,089.67	4.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	23,997,959.52	0.98
	其中：政策性金融债	23,997,959.52	0.98
4	企业债券	100,791,470.81	4.13
5	企业短期融资券	525,239,922.68	21.51
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,776,806,297.75	72.76
8	其他	-	-
9	合计	2,538,439,740.43	103.95
10	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	111810369	18 兴业银行 CD369	3,000,000	299,226,061.08	12.25
2	111807147	18 招商银行 CD147	2,000,000	199,735,844.08	8.18
3	111815512	18 民生银行 CD512	1,500,000	149,901,770.54	6.14
4	111920060	19 广发银行 CD060	1,500,000	149,462,004.12	6.12
5	111809369	18 浦发银行 CD369	1,500,000	148,408,965.34	6.08
6	111808265	18 中信银行 CD265	1,400,000	139,739,086.03	5.72
7	011802049	18 南航股 SCP004	1,300,000	130,215,532.11	5.33
8	111809230	18 浦发银行 CD230	1,200,000	119,696,001.00	4.90
9	0980165	09 铁道 09	1,000,000	100,791,470.81	4.13

10	011900709	19 中 铝 SCP004	1,000,000	99,963,057.74	4.09
----	-----------	------------------	-----------	---------------	------

## 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	0.2451%
报告期内偏离度的最低值	0.0364%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1300%

### 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名的前十名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：

中国民生银行股份有限公司 2018 年 12 月 7 日受到中国银行保险监督管理委员会公开处罚，违规行为：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）同业投资违规接受担保；（三）同业投资，

理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；(四)本行理财产品之间风险隔离不到位；(五)个人理财资金违规投资；(六)票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；(七)为非保本理财产品提供保本承诺。为此，中国银保监会对中国民生银行股份有限公司做出罚款人民币 3,160 万元的行政公开处罚。

中国民生银行股份有限公司于 2018 年 12 月 8 日受到中国银行保险监督管理委员会公开处罚违规行为：贷款业务严重违反审慎经营规则。为此，中国银保监会对中国民生银行股份有限公司做出罚款人民币 200 万元的行政公开处罚。

本基金对民生银行投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件仅对民生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民生银行长期发展，因此买入民生银行。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	-
2	应收证券清算款	40,000,000.00
3	应收利息	8,620,231.94
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	48,620,231.94

## § 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	4,151	27,211.62	345,255.19	0.31%	112,610,165.59	99.69%
国富日鑫月益 30 天理财债券 B	6	388,174,374.57	2,329,046,247.39	100.00%	-	-
合计	4,157	587,443.27	2,329,391,502.58	95.39%	112,610,165.59	4.61%

**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	54,046.05	0.047847%
	国富日鑫月益 30 天理财债券 B	-	-
	合计	54,046.05	0.002213%

**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	328,698,009.04	4,823,295,577.06
本报告期期间基金总申购份额	2,783,903.05	46,462,548.18
减：本报告期期间基金总赎回份额	218,526,491.31	2,540,711,877.85
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	112,955,420.78	2,329,046,247.39

## § 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

经国海富兰克林基金管理有限公司第五届董事会第十七次会议审议通过，自 2019 年 6 月 24 日起，王雷先生不再担任公司副总经理。相关公告已于 2019 年 6 月 26 日在《中国证券报》和公司网站披露。

#### （二）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。



## 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：管理人对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其他相关因素后决定的。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	-	-	219,000,000.00	100.00%	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

无。

## 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 1 月 18 日
2	富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金更新招募说明书（2019 年第 1 号）	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 2 月 1 日
3	富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2019 年第 1 号）	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 2 月 1 日
4	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金在部分销售机构开通转	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 2 月 23 日

	换业务的公告		
5	富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金 2018 年年度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 3 月 29 日
6	富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金 2018 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 3 月 29 日
7	富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 4 月 22 日
8	国海富兰克林基金管理有限公司 关于开通直销网上交易快捷支付业务并进行费用优惠以及电话交易业务费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 5 月 20 日
9	国海富兰克林基金管理有限公司 关于提请投资者及时更新客户身份基本信息的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2019 年 6 月 19 日

## § 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	2019 年 6 月 18 日至 2019 年 6 月 30 日	494,820,308.48	7,719,993.46	-	502,540,301.94	20.58 %
	2	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月	2,080,479,880.56	24,356,328.60	515,147,045.34	1,589,689,163.82	65.10 %

	30 日				
产品特有风险					
<p><b>1. 流动性风险</b></p> <p>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成现金，产生流动性风险。</p> <p>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。</p> <p>该基金投资者集中度较高，管理人将积极通过持续营销优化持有人结构，审慎办理大额申购和赎回。同时，根据《中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》要求，管理人将严格控制该基金整体规模，并在过渡期内有序压缩递减。</p> <p><b>2. 估值风险</b></p> <p>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。</p>					

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《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》；
- 3、《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》；
- 4、《富兰克林国海日鑫月益 30 天理财债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 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)。

### 12.3 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

2019 年 8 月 28 日