

富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金  
2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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：2021 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 29 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。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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>5</b>
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<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.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	50
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	50

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	50
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	50
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
8.11 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
9.3 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 .....	53
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>55</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
11.2 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 .....	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
11.4 基金投资策略的改变 .....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
11.8 其他重大事件 .....	56
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</b>
12.1 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 .....	60
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
13.1 备查文件目录 .....	61
13.2 存放地点 .....	61
13.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金	
基金简称	国富恒嘉短债债券	
基金主代码	006702	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 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	868,509.56 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国富恒嘉短债债券 A	国富恒嘉短债债券 C
下属分级基金的交易代码:	006702	006703
报告期末下属分级基金的份额总额	198,172.10 份	670,337.46 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过重点投资短期债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	主要投资策略包括：1、组合久期配置：本基金将通过对宏观经济变量、债券市场整体收益率曲线变化、申购赎回现金流情况等因素的综合分析和判断；2、类属资产配置：根据不同债券品种收益与风险的估计和判断，确定不同债券种类的配置比例；3、息差策略：本基金将通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，适当运用杠杆息差方式来获取主动管理回报，选取具有较好流动性的债券作为杠杆买入品种，灵活控制杠杆组合仓位，降低组合波动率；4、在个券选择过程中，本基金将根据市场收益率曲线的定位情况和个券的市场收益率情况，综合判断个券的投资价值，选择风险收益特征最匹配的品种，构建具体的个券组合；5. 由于法律法规限制和开放式基金正常运作的需要，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。 本基金也可进行资产支持证券投资。
业绩比较基准	中债综合财富(1 年以下)指数收益率*80%+中国人民银行公布的 1 年期定期存款利率(税后)* 20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于较低风险收益特征的证券投资基金。

### 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	许俊

	联系电话	021-3855 5555	010-66594319
	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	010-66594942
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网 址	www.ftsfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊 普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企 业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年		2019 年		2018 年 12 月 19 日 (基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日	
	国富恒嘉短债债券 A	国富恒嘉短债债券 C	国富恒嘉短债债券 A	国富恒嘉短债债券 C	国富恒嘉短债债券 A	国富恒嘉短债债券 C
本期已实现收益	10,014.06	1,375.37	1,317,211.68	193,197.19	320,368.95	57,682.87
本期利润	5,879.72	918.44	1,287,634.02	196,306.34	344,513.70	62,438.12
加权平均基金份额本期利润	0.0045	0.0012	0.0257	0.0227	0.0014	0.0013
本期加权平均净值利润率	0.44%	0.12%	2.55%	2.26%	0.12%	0.11%
本期基金份额净值增长率	1.14%	0.80%	1.95%	1.65%	0.12%	0.11%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末可供分配利润	5,123.57	12,961.21	75,680.15	20,743.25	320,368.95	57,682.87
期末可供分配基金份额利润	0.0259	0.0193	0.0174	0.0142	0.0012	0.0011
期末基金资产净值	204,563.22	687,566.47	4,438,843.68	1,482,925.37	278,830,492.72	54,911,722.96
期末基金份额净值	1.0323	1.0257	1.0207	1.0176	1.0012	1.0011
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基金份额累计净值增长率	3.23%	2.57%	2.07%	1.76%	0.12%	0.11%

注：

1. 本基金合同生效日为 2018 年 12 月 19 日。本基金 2018 年度主要财务指标的计算期间为 2018 年 12 月 19 日-2018 年 12 月 31 日。
2. 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则—第 1 号《主要财务指标的计算及披露》。
3. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。
5. 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国富恒嘉短债债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去三个月	1.12%	0.04%	0.67%	0.01%	0.45%	0.03%
过去六个月	1.27%	0.04%	1.13%	0.01%	0.14%	0.03%
过去一年	1.14%	0.03%	2.28%	0.02%	-1.14%	0.01%
自基金合同生效起至今	3.23%	0.04%	5.46%	0.01%	-2.23%	0.03%

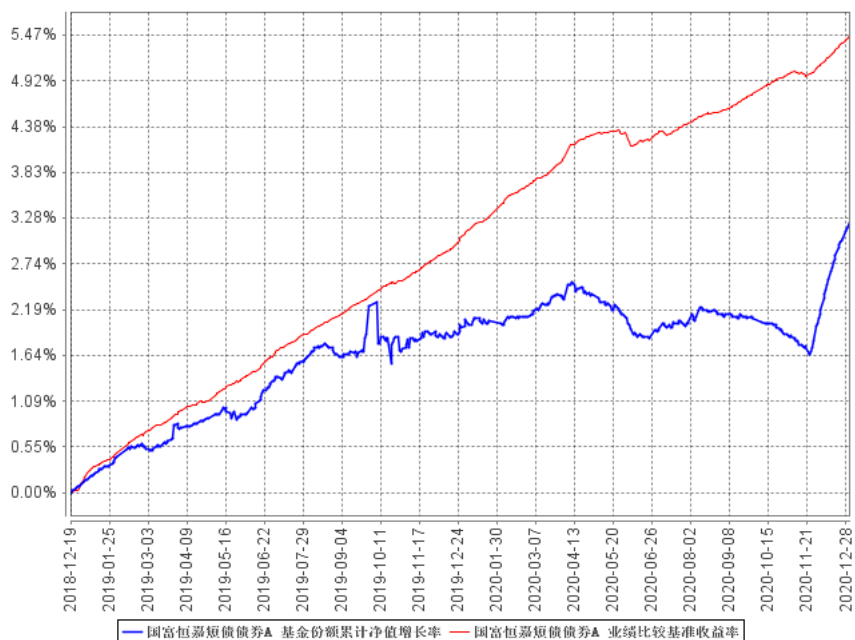
国富恒嘉短债债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去三个月	1.02%	0.04%	0.67%	0.01%	0.35%	0.03%
过去六个月	1.08%	0.04%	1.13%	0.01%	-0.05%	0.03%
过去一年	0.80%	0.03%	2.28%	0.02%	-1.48%	0.01%
自基金合同生效起至今	2.57%	0.04%	5.46%	0.01%	-2.89%	0.03%

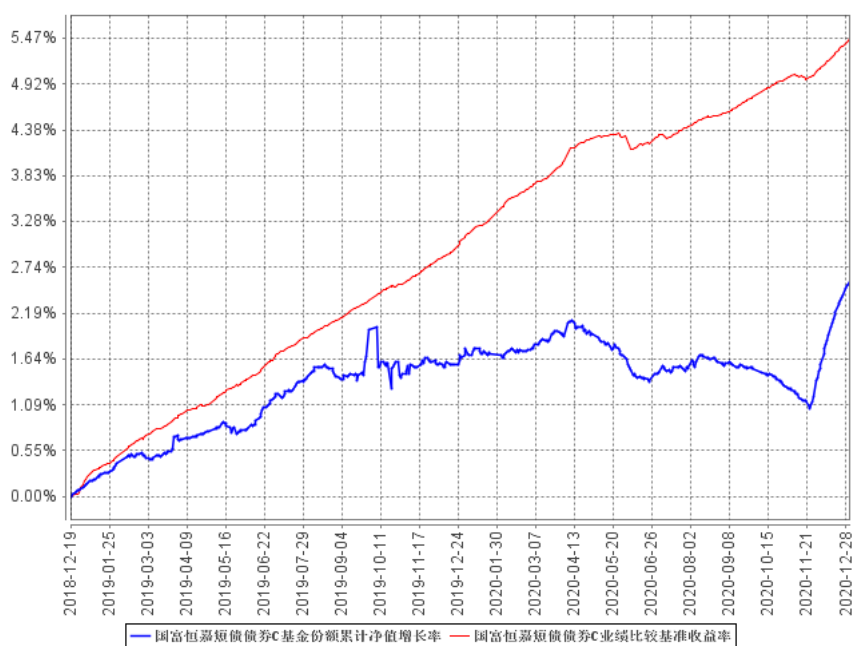


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国富恒嘉短债债券A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



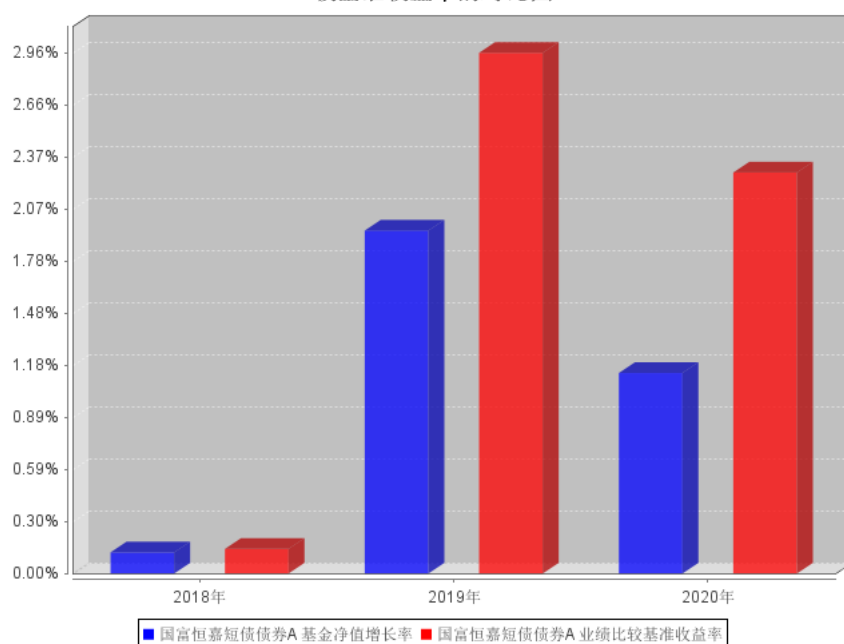
国富恒嘉短债债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



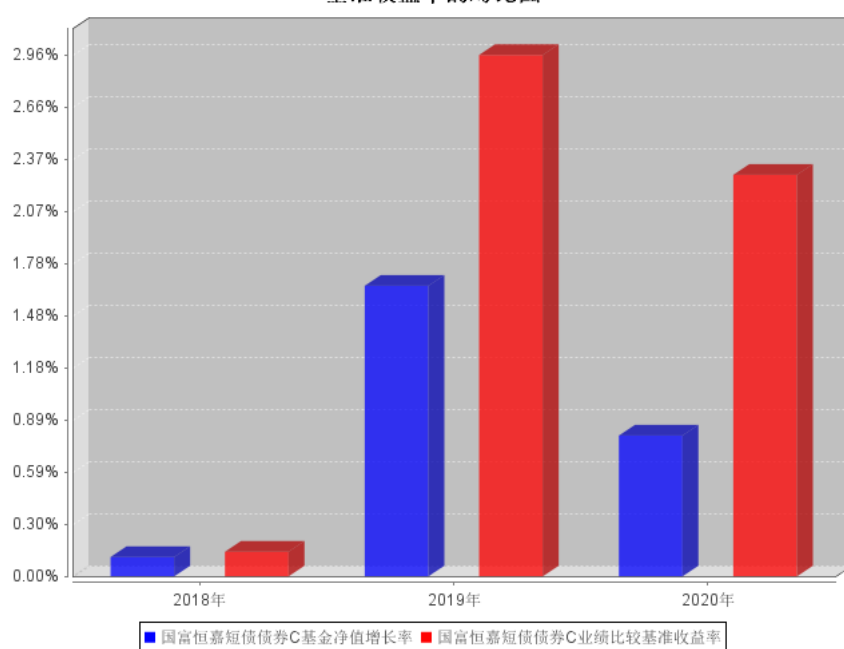
注：本基金的基金合同生效日为 2018 年 12 月 19 日，本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

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

国富恒嘉短债债券A 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



国富恒嘉短债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金成立于 2018 年 12 月 19 日，故 2018 年业绩为成立日至年底而非全年的业绩。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

国富恒嘉短债债券 A					
年度	每 10 份基金	现金形式发放总额	再投资形式发放	年度利润分配合	备注

	份额分红数		总额	计	
2020	-	-	-	-	
2019	-	-	-	-	
2018	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

单位：人民币元

国富恒嘉短债债券 C					
年度	每 10 份基金 份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配合 计	备注
2020	-	-	-	-	
2019	-	-	-	-	
2018	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

注：本基金于 2018 年 12 月 19 日成立。

## § 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，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。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，在全球市场具备超过 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。

国海富兰克林基金管理有限公司具有丰富的基金管理经验，截至 2020 年末，公司旗下合计管理 36 只公募基金产品。

#### 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		
沈竹熙	公司固定收益投资副总监，国富恒裕 6 个月定期开放债券基金、国富新趋势混合基金、国富恒嘉短债债券基金及国富恒博 63 个月定期开放债券基金的基金经理	2018 年 12 月 19 日	-	10 年	沈竹熙女士，长沙理工大学金融学学士。历任平安银行股份有限公司交易员，华融湘江银行股份有限公司交易员及平安证券股份有限公司金融市场部固定收益团队执行副总经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司固定收益投资副总监，国富恒裕 6 个月定期开放债券基金、国富新趋势混合基金、国富恒嘉短债债券基金及国富恒博 63 个月定期开放债

					券基金的基金经理。
--	--	--	--	--	-----------

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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，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 公平交易制度和控制方法

公司建立了《公平交易管理制度》，确保公司旗下投资组合能够得到公平对待，避免各种投资组合之间的利益输送行为。我们主要从如下几个方面对公平交易进行控制：

1. 在研究信息共享方面，投资研究等部门通过定期的例会沟通机制，就相关议题进行讨论；公司建立了统一的研究平台，研究报告信息通过研究平台进行发布。
2. 建立投资对象备选库，股票及债券的入库需要由研究报告支持作为依据，并经过相关领导审批；建立研究报告的定期更新机制。
3. 在投资决策方面，公司在各类资产管理业务之间建立防火墙，确保业务隔离及人员隔离，同时各投资组合经理投资决策保持独立。
4. 公司对所有投资组合的交易指令实行集中交易，公司在交易系统中设置公平交易功能，按照时间优先、价格优先的原则执行各账户所有指令；公司建立和完善了对债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易分配制度，以确保相关投资组合能够得到公平对待。
5. 公司建立了《同日反向交易管理办法》，通过事前审批来对反向交易进行事前控制。公司每季度对不同时间窗下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。
6. 公司定期对公平交易执行情况进行监察稽核，并在监察稽核定期报告中做专项说明。公司也会在各投资组合的定期报告中，披露公平交易制度执行情况及异常交易行为专项说明。

### 4.3.2 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。

报告期末，公司共管理了三十六只公募基金及六只专户产品。统计所有投资组合分投资类别（股票、债券）过去连续 4 个季度内在不同时间窗口（T=1、T=3 和 T=5）存在同向交易价差的样本，并对差价率均值、交易价格占优比率、t 值、贡献率等指标进行分析，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。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司按照《异常交易监控与报告制度》，系统划分了异常交易的类型、异常交易的界定标准、异常交易的识别程序，制订了异常交易的监控办法，并规范了异常交易的分析、报告制度。

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未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，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

2020 年债市整体呈现小幅上涨态势，区间波动较大。全年中债总指数上涨 3.12%，中债国债指数上涨 2.73%，中债信用债总指数上涨 3.27%。10 年期利率债收益率波动幅度超 80bp，10 年国开债收益率波动幅度接近 100bp，高评级优质信用债收益率波动幅度接近 150bp。2020 年债市收益率拐点出现在 4-6 月、10-11 月。

2020 年全年 GDP 同比增长 2.3%，规模以上工业增加值累计增长 2.8%，固定资产投资累计增长 2.9%，制造业投资累计下降 2.2%，基础建设投资增长 0.9%，房地产开发投资增长 7.0%，社会消费品零售总额下降 3.9%，CPI 累计增长 2.5%，PPI 累计下降 1.8%。经济指标体现出我国经济率先从疫情中恢复过来，实现较为强劲的工业生产势头，基建、地产、出口成为拉动经济的主要引擎，居民消费逐步修复。2020 年中国实现了经济逐步向上，物价水平稳步下降的良性状态。

央行货币政策也根据基本面的变化，从疫情中的中性偏宽松，变为年末的“不急转弯”、“货币、融资增速与经济潜在增速相匹配”的方向。

操作上，本基金主要投资于高等级优质国企信用债及利率品种，始终以防控流动性及信用风险为原则，兼顾风险与收益的平衡。根据规模情况，灵活调整存单持仓比例，以符合投资范围要求，并保证组合配置资产的流动性，同时分散持仓集中度，使得组合运作更加稳健。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.0323 元，本报告期份额净值上涨 1.14%，同期业绩比较基准上涨 2.28%，跑输业绩基准 1.14%；本基金 C 类份额净值为 1.0257 元，本报告期份额净值上涨 0.80%，同期业绩比较基准上涨 2.28%，跑输业绩比较基准 1.48%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一、“L”型经济增长趋势下，中长期利率水平呈现中枢下行态势

一是国内经济新旧动能转换，新的经济增长点需要较长时间培育，经济结构调整转型仍在路上。二是中央“房住不炒”的地产政策态度极为坚定，地产周期一定程度上通过调控手段熨平；三是全球经济景气度仍低，影响实质需求及企业预期。

二、中期金融市场及利率走势呈现高波动特点

一方面国内基本面多空因素交错，叠加国外政治经济政策影响，使得市场参与者较易形成预期差，加速市场波动。国内经济周期朝着疫情缓解，逐步复苏的向好趋势发展，但地产行业受“三道红线”政策影响，对经济的拉动作用势必减弱；中期海外疫情发展存在不确定性，叠加大选、中美贸易判断等因素，预计疫苗大规模上市前后，海外需求不确定性也将加大，使得国内进出口贸易波动也将加大。

另一方面国内货币及融资政策的调整，使得利率呈现震荡走势。中期货币政策将始终发挥逆周期调节效力，提前预判、操作将成为常态。前期受疫情影响，货币政策保持宽松，宏观杠杆率走高，目前随着国内疫情得到控制，货币政策逐步收敛，未来结合基本面不排除新一轮降杠杆政策，货币周期更迭，加速金融市场以及利率波动。

三、在信用风险不断爆发的当下市场，投资品种向高等级、好资质集中成为趋势，政策性金融债信用风险极低，且作为押品被市场资金主要供给方普遍接受认可，质押率较高，品质优异。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，严格开展对基金相关法律文件和对外宣传资料的合规审核，积极加强对各部门、各主要运作环节的风险监控，并通

过定期稽核和专项稽核，及时发现需要完善的业务环节，并落实措施。报告期内，本基金管理人特别关注基金投资研究交易、市场销售以及运营的合法合规和风险控制，对保护投资者利益涉及的各项业务环节以及信息技术安全开展了专项自查和采取控制措施。同时，本基金管理人开展多层次的员工合规教育和日常提示等措施，强化员工风控意识，努力营造合规经营文化。此外，本基金管理人依照规定，及时向董事会报送监察稽核报告。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将继续深入分析和识别市场变化和潜在风险，积极采取措施，加强事前、事中和事后的内部控制，提高监察稽核工作的科学性和有效性。

#### 4.7 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《投资产品估值管理办法》。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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据基金合同和相关法律的规定，本基金无应分配但尚未分配的利润。

#### 4.9 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

报告期内，本基金已连续超过 60 个工作日基金资产净值低于五千万元，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。本报告期内本基金管理人积极开展持续营销，努力落实解决方案。报告期内本基金资产净值较低，可能对投资运作，流动性管理产生潜在负面影响，请投资者关注相关风险。



## § 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”）在对富兰克林国海恒嘉短债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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 21587 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金(以下简称“国富恒嘉短债债券基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了国富恒嘉短债债券基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国富恒嘉短债债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>国富恒嘉短债债券基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估国富恒嘉短债债券基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算国富恒嘉短债债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国富恒嘉短债债券基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。</p>

	<p>同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国富恒嘉短债债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国富恒嘉短债债券基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞   俞伟敏
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 25 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	16,011.45	4,480.85
结算备付金		6,404.86	98,328.41
存出保证金		107.36	1,595.89
交易性金融资产	7.4.7.2	770,642.40	4,821,012.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		770,642.40	4,821,012.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	110,000.00	1,000,000.00
应收证券清算款		100,048.22	1,135,388.95
应收利息	7.4.7.5	16,132.05	107,307.25
应收股利		-	-
应收申购款		2,210.00	399.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,021,556.34	7,168,513.33
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		108,999.52	32,120.62
应付赎回款		111.45	1,016,976.67
应付管理人报酬		136.68	1,603.40
应付托管费		54.65	641.37
应付销售服务费		96.04	402.11
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		28.31	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	20,000.00	195,000.11
负债合计		129,426.65	1,246,744.28
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	868,509.56	5,805,999.34
未分配利润	7.4.7.10	23,620.13	115,769.71
所有者权益合计		892,129.69	5,921,769.05
负债和所有者权益总计		1,021,556.34	7,168,513.33

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 868,509.56 份，其中富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金 A 类基金份额 198,172.10 份，基金份额净值 1.0323 元；富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金 C 类基金份额 670,337.46 份，基金份额净值 1.0257 元。

## 7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		56,835.13	2,078,117.22
1.利息收入		85,365.06	2,196,763.22
其中：存款利息收入	7.4.7.11	485.07	58,204.37
债券利息收入		82,322.74	1,210,858.47
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,557.25	927,700.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-23,966.88	-92,538.83
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-23,966.88	-92,538.83
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-4,591.27	-26,468.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	28.22	361.34

列)			
<b>减：二、费用</b>		50,036.97	594,176.86
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,420.73	151,323.55
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,168.11	60,529.43
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,383.56	26,747.08
4. 交易费用	7.4.7.18	86.04	9,881.20
5. 利息支出		990.83	117,602.19
其中：卖出回购金融资产支出		990.83	117,602.19
6. 税金及附加		127.70	1,654.22
7. 其他费用	7.4.7.19	38,860.00	226,439.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		6,798.16	1,483,940.36
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		6,798.16	1,483,940.36

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	5,805,999.34	115,769.71	5,921,769.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,798.16	6,798.16
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）	-4,937,489.78	-98,947.74	-5,036,437.52
其中：1. 基金申购款	783,354.54	16,673.91	800,028.45
2. 基金赎回款	-5,720,844.32	-115,621.65	-5,836,465.97
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	868,509.56	23,620.13	892,129.69

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	333,335,263.86	406,951.82	333,742,215.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,483,940.36	1,483,940.36
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）	-327,529,264.52	-1,775,122.47	-329,304,386.99
其中：1. 基金申购款	20,590,895.24	189,759.21	20,780,654.45
2. 基金赎回款	-348,120,159.76	-1,964,881.68	-350,085,041.44
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,805,999.34	115,769.71	5,921,769.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_ 林勇 \_\_\_\_\_

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_ 于意 \_\_\_\_\_

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_ 肖燕 \_\_\_\_\_

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2018]195号《关于准予富兰克林国海恒嘉6个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》和证监许可[2018]1701《关于准予富兰克林国海恒嘉6个月定期开放债券型发起式证券投资基金变更注册的批复》的核准,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《富兰克林国海恒嘉短债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 333,287,323.90 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(2018)第 0774 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金基金合同》于 2018 年 12 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 333,335,263.86 份,其中认购资金产生的利息折合 47,939.96 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《富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金基金合同》和《富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购、申购费及销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用、从本类别基金资产中不计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种,包括债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款)、同业存单、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(包括可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券。本基金的投资组合比例为:投资债券的比例不低于基金资产的 80%,其中投资于短期债券的比例不低于非现金资产的 80%,本基金所指的短债债券是指剩余期限不超过 397 天(含)的债券,主要包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债等金融工具。现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:中债综合财富(1 年以下)指数收益率 $\times$ 80%+中国人民银行公布的 1 年期定期存款利率(税后) $\times$ 20%。

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 2021 年 3 月 25 日批准报出。

## 7.4.2 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<年度报告和中期报告>》、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》、《富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2020 年 12 月 31 日,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 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。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 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和资产支持证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变动计入当期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。

### 7.4.4.4 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或资产支持证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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的

金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息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及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 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，本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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》、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	16,011.45	4,480.85
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	16,011.45	4,480.85

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	772,802.18	770,642.40
	银行间市场	-	-
	合计	772,802.18	770,642.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	772,802.18	770,642.40	-2,159.78
项目	上年度末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,818,580.51	4,821,012.00
	银行间市场	-	-
	合计	4,818,580.51	4,821,012.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,818,580.51	4,821,012.00	2,431.49



### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	110,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	110,000.00	-
项目	上年度末 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	4.85	1.84
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	2.90	44.30
应收债券利息	16,160.82	107,260.41
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-36.52	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	0.70
合计	16,132.05	107,307.25

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	0.11
审计费用	20,000.00	66,000.00
债券账户维护费	-	9,000.00
信息披露费	-	120,000.00
合计	20,000.00	195,000.11

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国富恒嘉短债债券 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,348,663.35	4,348,663.35
本期申购	54,066.76	54,066.76
本期赎回（以“-”号填列）	-4,204,558.01	-4,204,558.01
本期末	198,172.10	198,172.10

金额单位：人民币元

国富恒嘉短债债券 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,457,335.99	1,457,335.99
本期申购	729,287.78	729,287.78
本期赎回（以“-”号填列）	-1,516,286.31	-1,516,286.31

本期末	670,337.46	670,337.46
-----	------------	------------

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

国富恒嘉短债债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	75,680.15	14,500.18	90,180.33
本期利润	10,014.06	-4,134.34	5,879.72
本期基金份额交易产生的变动数	-80,570.64	-9,098.29	-89,668.93
其中：基金申购款	1,117.88	225.82	1,343.70
基金赎回款	-81,688.52	-9,324.11	-91,012.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,123.57	1,267.55	6,391.12

单位：人民币元

国富恒嘉短债债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,743.25	4,846.13	25,589.38
本期利润	1,375.37	-456.93	918.44
本期基金份额交易产生的变动数	-9,157.41	-121.40	-9,278.81
其中：基金申购款	11,700.87	3,629.34	15,330.21
基金赎回款	-20,858.28	-3,750.74	-24,609.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,961.21	4,267.80	17,229.01

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	154.84	43,652.68
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	314.94	14,503.75
其他	15.29	47.94
合计	485.07	58,204.37

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31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	-23,966.88	-92,538.83
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	-23,966.88	-92,538.83

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,324,548.77	347,782,616.19
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,066,251.06	342,220,368.88
减：应收利息总额	282,264.59	5,654,786.14
买卖债券差价收入	-23,966.88	-92,538.83

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股利收益。

## 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
1. 交易性金融资产	-4,591.27	-26,468.51
——股票投资	-	-
——债券投资	-4,591.27	-26,468.51
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-4,591.27	-26,468.51

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
基金赎回费收入	28.22	361.34
合计	28.22	361.34

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

## 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
交易所市场交易费用	86.04	281.20
银行间市场交易费用	-	9,600.00
合计	86.04	9,881.20

## 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

审计费用	20,000.00	66,000.00
信息披露费	-	120,000.00
债券账户维护费	15,000.00	33,000.00
银行汇划费用	860.00	6,239.19
其他手续费	800.00	1,200.00
律师费	2,200.00	-
合计	38,860.00	226,439.19

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 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。

## 7.4.9 关联方关系

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
邓普顿国际股份有限公司（Templeton International, Inc.）	基金管理人的股东
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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 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。

#### 7.4.10.1.2 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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,420.73	151,323.55
其中：支付销售机构的客户维护费	2,080.71	65,519.11

注：支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.25% 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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,168.11	60,529.43

注：支付基金托管人中国银行的基金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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

### 7.4.10.2.3 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		
	2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富恒嘉短债债券 A	国富恒嘉短债债券 C	合计
国海富兰克林基金管理有限公司	-	58.56	58.56
中国银行	-	215.07	215.07

国海证券	-	1,972.03	1,972.03
合计	-	2,245.66	2,245.66
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富恒嘉短债债券 A	国富恒嘉短债债券 C	合计
中国银行	-	2,850.58	2,850.58
国海证券	-	23,438.02	23,438.02
合计	-	26,288.60	26,288.60

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值的年费率 0.30% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国海富兰克林基金管理有限公司，再由国海富兰克林基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值  $\times$  0.30%  $\div$  当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

1. 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。
2. 本报告期内和上年度可比期间（2019年1月1日至2019年12月31日）基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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（2019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。

#### 7.4.10.5 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	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31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	16,011.45	154.84	4,480.85	43,652.68

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 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。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于较低风险收益特征的证券投资基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要为固定收益证券品种。本基金在日常投资管理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等。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“风险和收益高于货币型基金而低于混合型和股票型基金，谋求稳定和可持续的长期收益”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。

#### 7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行，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；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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。

本基金固定收益品种投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的

标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	444,861.90	-
合计	444,861.90	-

注：未评级债券为国债。

#### 7.4.13.2.2 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	270,534.00	-
AAA 以下	30,003.00	-
未评级	25,243.50	4,821,012.00
合计	325,780.50	4,821,012.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

#### 7.4.13.3 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 2020 年 12 月 31 日, 本基金所承担的全部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, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 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》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发行的证券不得超过该证券的 10%(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上述比例限制)。

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 7.4.12。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%。于 2020 年 12 月 31 日, 本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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。于 2020 年 12 月 31 日, 本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金的基金管理人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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,011.45	-	-	-	16,011.45
结算备付金	6,404.86	-	-	-	6,404.86
存出保证金	107.36	-	-	-	107.36
交易性金融资产	770,642.40	-	-	-	770,642.40
买入返售金融资产	110,000.00	-	-	-	110,000.00
应收证券清算款	-	-	-	100,048.22	100,048.22
应收利息	-	-	-	16,132.05	16,132.05
应收申购款	-	-	-	2,210.00	2,210.00
资产总计	903,166.07	-	-	118,390.27	1,021,556.34
负债					

应付证券清算款	-	-	-	108,999.52	108,999.52
应付赎回款	-	-	-	111.45	111.45
应付管理人报酬	-	-	-	136.68	136.68
应付托管费	-	-	-	54.65	54.65
应付销售服务费	-	-	-	96.04	96.04
应交税费	-	-	-	28.31	28.31
其他负债	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	129,426.65	129,426.65
利率敏感度缺口	903,166.07	-	-	-11,036.38	892,129.69
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,480.85	-	-	-	4,480.85
结算备付金	98,328.41	-	-	-	98,328.41
存出保证金	1,595.89	-	-	-	1,595.89
交易性金融资产	4,821,012.00	-	-	-	4,821,012.00
买入返售金融资产	1,000,000.00	-	-	-	1,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,135,388.95	1,135,388.95
应收利息	-	-	-	107,307.25	107,307.25
应收申购款	-	-	-	399.98	399.98
资产总计	5,925,417.15	-	-	1,243,096.18	7,168,513.33
负债					
应付证券清算款	-	-	-	32,120.62	32,120.62
应付赎回款	-	-	-	1,016,976.67	1,016,976.67
应付管理人报酬	-	-	-	1,603.40	1,603.40
应付托管费	-	-	-	641.37	641.37
应付销售服务费	-	-	-	402.11	402.11
其他负债	-	-	-	195,000.11	195,000.11
负债总计	-	-	-	1,246,744.28	1,246,744.28
利率敏感度缺口	5,925,417.15	-	-	-3,648.10	5,921,769.05

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	增加约 0.03	增加约 1
市场利率上升 25 个基点	减少约 0.03	减少约 1	

	基点		
--	----	--	--

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或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。

#### 7.4.14 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 2020 年 12 月 31 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 770,642.40 元，无属于第一或第三层次的余额。(2019 年 12 月 31 日：第二层次 4,821,012.00 元，无第一或第三层次)。

##### (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 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 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。



## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	770,642.40	75.44
	其中：债券	770,642.40	75.44
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	110,000.00	10.77
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,416.31	2.19
8	其他各项资产	118,497.63	11.60
9	合计	1,021,556.34	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未通过港股通交易机制投资港股。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期内未投资股票。

### 8.5 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	454,980.90	51.00

2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,124.50	1.70
	其中：政策性金融债	15,124.50	1.70
4	企业债券	300,537.00	33.69
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	770,642.40	86.38

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019627	20 国债 01	3,670	366,963.30	41.13
2	019640	20 国债 10	780	77,898.60	8.73
3	124456	13 闽投债	300	30,183.00	3.38
4	112690	18 广发 01	300	30,153.00	3.38
5	136473	16 中化债	300	30,078.00	3.37

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

## 8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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：

2020 年 7 月 10 号，中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）对广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）在康美药业相关投行业务中的违规行为依法下发行行政监管措施事

先告知书，拟对广发证券采取暂停保荐机构资格 6 个月、暂不受理债券承销业务有关文件 12 个月的监管措施。对 14 名直接责任人及负有管理责任的人员分别采取认定为不适当人选 10 年至 20 年、公开谴责、限制时任相关高管人员领取报酬等监管措施，并责令广发证券对相关责任人员进行内部追责，按公司规定追回相关报酬收入。主要违规行为如下：

广发证券在相关业务风险爆发后，按照证监会强化风险管控要求，已启动全面自查，控制各项业务规模，防止新增风险。证监会同步对广发证券 2014 年以来相关投行业务情况进行全面核查。经查，广发证券及相关人员在相关投行项目执业过程中未能勤勉尽责，存在尽职调查环节基本程序缺失、缺乏应有的执业审慎、内部质量控制流于形式、未按规定履行持续督导义务等重大违规行为。根据违规事实和相关规定，证监会拟对广发证券采取前述暂停业务、实施整改等监管措施，并严肃追责相关责任人员。

本基金对广发证券投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件不改变长期投资价值。同时由于本基金看好广发证券长期发展，因此买入广发证券。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。

**8.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。**

### 8.11.3 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	107.36
2	应收证券清算款	100,048.22
3	应收股利	-
4	应收利息	16,132.05
5	应收申购款	2,210.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	118,497.63

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
国富恒嘉短债债券 A	79	2,508.51	-	-	198,172.10	100.00%
国富恒嘉短债债券 C	151	4,439.32	-	-	670,337.46	100.00%
合计	230	3,776.13	-	-	868,509.56	100.00%

### 9.2 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	国富恒嘉短债债券 A	127.29	0.064232%
	国富恒嘉短债债券 C	137.88	0.020569%
	合计	265.17	0.030532%

### 9.3 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	国富恒嘉短债债券 A	0
	国富恒嘉短债债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国富恒嘉短债债券 A	0
	国富恒嘉短债债券 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富恒嘉短债债券 A	国富恒嘉短债债券 C
基金合同生效日（2018 年 12 月 19 日）基金份额总额	278,485,979.02	54,849,284.84
本报告期期初基金份额总额	4,348,663.35	1,457,335.99
本报告期基金总申购份额	54,066.76	729,287.78
减:本报告期基金总赎回份额	4,204,558.01	1,516,286.31
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	198,172.10	670,337.46

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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第五届董事会第二十二次会议审议通过，自 2020 年 6 月 19 日起，首席信息官丁磊先生担任公司高级管理人员。相关公告已于 2020 年 6 月 20 日在《证券时报》和公司网站披露。

2、经国海富兰克林基金管理有限公司第五届董事会第二十二次会议审议通过，自 2020 年 7 月 22 日起，财务总监李赛兰女士担任公司高级管理人员。相关公告已于 2020 年 7 月 23 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

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人应支付给会计师事务所的审计费用是人民币 20,000.00 元，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(特殊普通合伙)，未曾改聘其他会计师事务所。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### (一) 基金管理人及高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形：

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### (二) 基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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。

### 11.7.2 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	16,688,024.56	100.00%	32,539,000.00	100.00%	-	-

## 11.8 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	关于增加北京创金启富基金销售有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020年1月17日
2	富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020年1月17日
3	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020年1月17日
4	国海富兰克林基金管理有限公司关于做好新型冠状病毒感染的肺炎疫情防控工作的提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020年2月3日
5	公司旗下基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订法律文件的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020年2月28日



6	国海富兰克林基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下 32 只公募基金法律文件的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 28 日
7	富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 28 日
8	富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 28 日
9	富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 28 日
10	富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 2 月 28 日
11	富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金 2019 年年报及摘要	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 3 月 27 日
12	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 3 月 27 日
13	国海富兰克林基金管理有限公司关于中止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 4 月 7 日
14	富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金更新招募说明书（2020 年 2 号）	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 4 月 17 日
15	富兰克林国海恒嘉短债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2020 年 2 号）	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 4 月 17 日
16	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指定网站	2020 年 4 月 20 日
17	公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 4 月 21 日
18	国海富兰克林基金管理有限公司 2020 年第一季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 4 月 21 日
19	国海富兰克林基金管理有限公司关于提醒直销个人投资者完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 4 月 30 日
20	国海富兰克林基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金	中国证监会指定报刊及指定网站	2020 年 6 月 4 日

	销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告		
21	国海富兰克林基金管理 有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020 年 6 月 20 日
22	关于增加大连网金基金销售 有限公司为国海富兰克林基 金旗下部分基金代销机构并 开通转换业务、定期定额投资 业务及相关费率优惠活动的 公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020 年 6 月 22 日
23	关于增加华安证券股份有限 公司为国海富兰克林基金旗 下部分基金代销机构并开通 转换业务、定期定额投资业 务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020 年 6 月 22 日
24	关于增加阳光人寿保险股份 有限公司为国海富兰克林基 金旗下部分基金代销机构并 开通转换业务、定期定额投资 业务及相关费率优惠活动的 公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020 年 6 月 22 日
25	国海富兰克林基金管理有限 公司关于终止上海景谷基金 销售有限公司办理相关销售 业务的公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020 年 7 月 2 日
26	国海富兰克林基金管理有限 公司旗下部分基金参加申万 宏源西部证券有限公司申购 费率优惠活动的公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020 年 7 月 17 日
27	国海富兰克林基金管理有限 公司旗下部分基金参加申万 宏源证券有限公司申购费率 优惠活动的公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020 年 7 月 17 日
28	国海富兰克林基金管理有限 公司旗下全部基金季度报告 提示性公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020 年 7 月 20 日
29	关于网上交易平台和微信服 务号关闭非身份证开端口 的公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020 年 7 月 22 日
30	国海富兰克林基金管理有限 公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020 年 7 月 23 日
31	关于增加喜鹊财富基金销售 有限公司为国海富兰克林基 金旗下部分基金代销机构并	中国证监会指定报 刊及指定网站	2020 年 8 月 19 日

	开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告		
32	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020年8月28日
33	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下基金披露基金产品资料概要(更新)的提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020年8月31日
34	关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020年9月17日
35	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中国银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020年9月17日
36	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加上海证券有限责任公司申购及定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020年10月19日
37	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加招商银行招赢通平台申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020年10月20日
38	关于增加玄元保险代理有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020年11月20日
39	关于在招商银行招赢通平台开通公司旗下部分基金销售业务并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020年11月26日
40	关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2020年12月9日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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
个人	1	2020 年 11 月 27 日至 2020 年 12 月 9 日	100,027.00	-	-	100,027.00	11.52%
	2	2020 年 8 月 31 日至 2020 年 11 月 26 日	200,045.00	-	200,045.00	-	-
	3	2020 年 8 月 31 日至 2020 年 9 月 3 日	200,072.00	-	200,072.00	-	-
	4	2020 年 4 月 15 日至 2020 年 8 月 9 日	598,258.32	-	598,258.32	-	-
	5	2020 年 11 月 27 日至 2020 年 12 月 9 日	99,700.72	-	99,700.72	-	-
	6	2020 年 11 月 27 日至 2020 年 12 月 9 日	99,687.22	-	-	99,687.22	11.48%
	7	2020 年 12 月 23 日至 2020 年 12 月 31 日	-	319,849.28	-	319,849.28	36.83%
产品特有风险							
<p>1. 流动性风险</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。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>2. 估值风险</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>							

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海嘉恒短债债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海嘉恒短债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海嘉恒短债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海嘉恒短债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。

### 13.2 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)。

### 13.3 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

2021 年 3 月 31 日