富兰克林国海安享货币市场基金
2021年第2季度报告

2021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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2021年7月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富安享货币
基金主代码	004120
交易代码	004120
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 5 月 22 日
报告期末基金份额总额	5,243,126,939.49 份
投资目标	在严格控制风险并保持资产流动性的基础上，力争实现超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金主要为投资人提供现金管理工具，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。 本基金也可进行资产支持证券投资。
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，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金及债券型基金，属于低风险稳定收益特征的证券投资基金。
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2021 年 4 月 1 日 － 2021 年 6 月 30 日 ）
1．本期已实现收益	31,078,875.57
2．本期利润	31,078,875.57
3．期末基金资产净值	5,243,126,939.49

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。

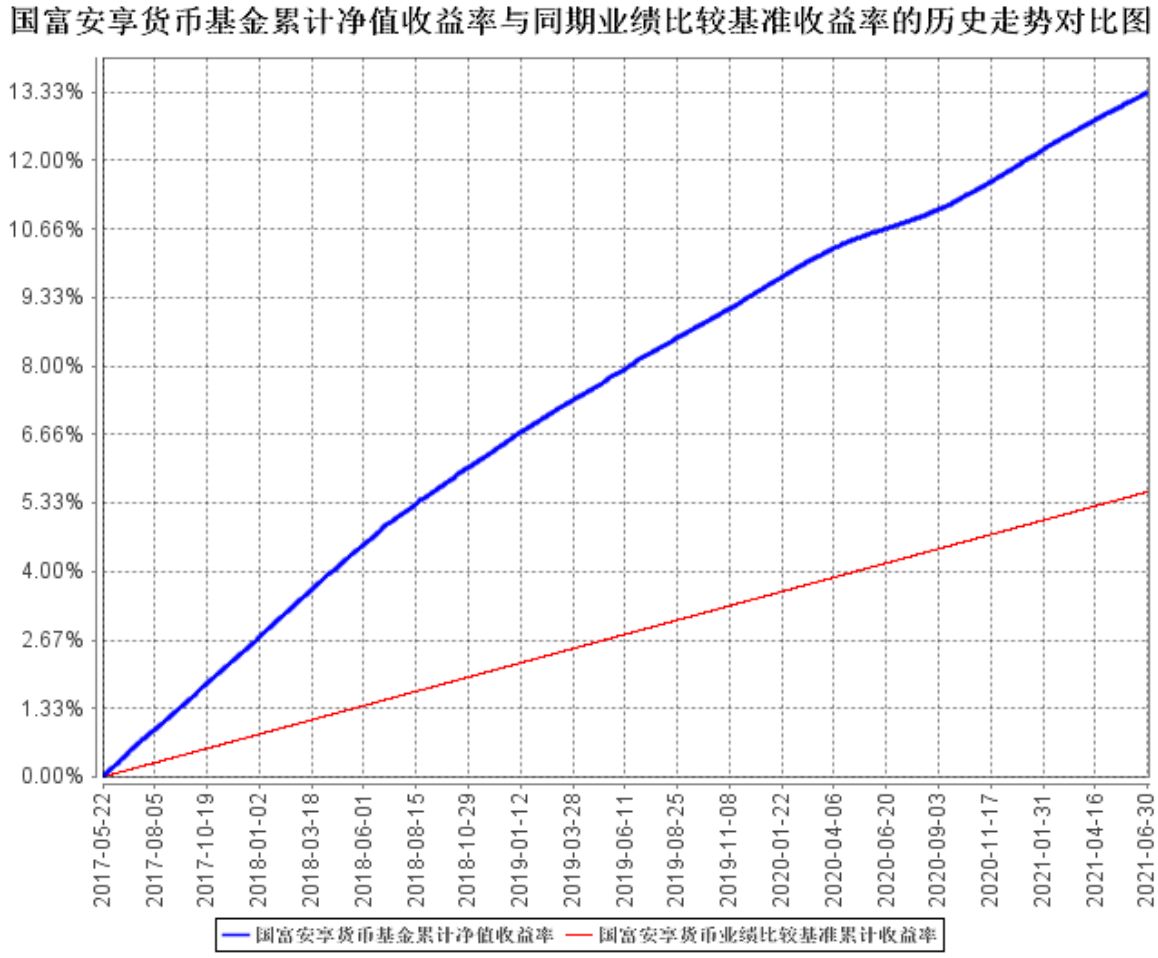
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.5839%	0.0015%	0.3199%	0.0000%	0.2640%	0.0015%
过去六个月	1.2324%	0.0014%	0.6383%	0.0000%	0.5941%	0.0014%
过去一年	2.3608%	0.0016%	1.2956%	0.0000%	1.0652%	0.0016%
过去三年	8.0613%	0.0024%	3.9939%	0.0000%	4.0674%	0.0024%
自基金合同生效起至今	13.3274%	0.0030%	5.5516%	0.0000%	7.7758%	0.0030%

注：本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：本基金的基金合同生效日为 2017 年 5 月 22 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 基金经理（或基金经理小组）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		
王莉	国富日日收益货币基金、国富安享货币基金、国富恒丰定期债券基金、国富新机遇混合基金及国富天颐混合基金的基金经理	2017 年 5 月 22 日	-	11 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、国富日鑫月益 30 天理财债券基金的基金经理。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、国富恒丰定期债券基金、国富新机遇混合基金及国富天颐混合基金的基金经理。
严婧璧	国富日日收益货币基金及国富安享货币基金的基金经理	2019 年 7 月 27 日	-	13 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，国海富兰克林基金管理有限公司交易员、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、国富日鑫月益 30 天理财债券基金的基金经理。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及国富安享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《富兰克林国海安享货币市场基金基金合同》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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配、信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》，严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度的债市整体下行，主要原因系资金面宽松超预期和一级供给不足。宏观经济方面，PMI 依旧在 50 以上，但有逐月降低趋势，社融和 M2 数据符合预期。从结构上来看，长期贷款占比较高，数据质量不差，房地产销售依旧火爆，供给在集中供地政策推出后波动比较明显；基建受制于项目审批和地方债发行影响维持不温不火；消费持续低于预期，全球大宗商品价格的大幅波动，通胀一度成为二季度宏观最大的利空，5 月 PPI 达到 9%的高位，但市场普遍预期 PPI 已到顶且对 CPI 的传导并不通畅，不会成为制约经济的最主要矛盾。海外发达国家经济恢复明显带动了其需求，由于新冠病毒变种在发展中国家肆虐，国内的进出口始终维持较强的势头，总体宏观经济利空债市。但二季度资金面超预期宽松，央行维持了合理充裕，稳健中性的政策基调。每日公开市

场基本维持 100 亿净投放，仅在跨季阶段将投放量提高至每日 300 亿。即使如此，市场大部分时间依旧非常宽松，加上财政政策此次发力较晚，地方债从 5 月份起才逐渐起量，市场欠配情绪较为明显。

二季度虽没有新的主体的信用风险事件出现，但永煤造成的影响还是让投资者对河南及一些煤企较为谨慎。中国华融、恒大地产等负面信息不断传出，整体信用市场发行缩量明显，结构分化严重，在此背景下，本基金不断地提高对债券及存单品种的信用挖掘能力，全面排查债券潜在风险，力求将估值风险降到最低。

报告期内，本基金致力于择时配置和利差择期配置，在下行过程中通过判断未来利差走势选择性价比较高的期限配置，保持短期流动性并力求锁定一部分长期资产的收益率。投资品种上选择高评级同业存单为配置主力品种，通过杠杆和久期调整合理配置资产，进一步做好投资决策。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值上涨 0.5839%，同期业绩基准上涨 0.3199%，本基金跑赢业绩比较基准 0.2640%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	3,359,014,497.67	59.94
	其中：债券	3,359,014,497.67	59.94
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,590,306,383.16	28.38
	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	591,100,871.50	10.55
4	其他资产	63,863,308.69	1.14
5	合计	5,604,285,061.02	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	5.08	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	359,469,294.65	6.86
	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

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	53

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	64
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

5.3.2 报告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	41.18	6.86
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	22.21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	25.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	3.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天（含）	13.31	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		105.68	6.86

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	99,640,875.94	1.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	270,675,312.90	5.16
	其中：政策性金融债	270,675,312.90	5.16
4	企业债券	66,581,298.27	1.27
5	企业短期融资券	1,080,191,974.63	20.60

6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,841,925,035.93	35.13
8	其他	-	-
9	合计	3,359,014,497.67	64.07
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，附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。

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	012101310	21 广州地铁 SCP002	2,000,000	200,095,666.50	3.82
2	012100734	21 中油股 SCP002	2,000,000	200,077,594.15	3.82
3	112106123	21 交通银行 CD123	2,000,000	199,705,578.86	3.81
4	112115127	21 民生银行 CD127	2,000,000	199,652,307.59	3.81
5	112112061	21 北京银行 CD061	2,000,000	199,599,645.12	3.81
6	112116110	21 上海银行 CD110	2,000,000	198,784,526.45	3.79
7	180212	18 国开 12	1,800,000	180,470,651.97	3.44
8	012102133	21 华能集 SCP007	1,400,000	139,944,910.94	2.67
9	072100085	21 招商证券 CP005BC	1,300,000	130,013,204.02	2.48
10	012100699	21 首钢 SCP003	1,000,000	100,006,964.59	1.91

5.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0535%

报告期内偏离度的最低值	0.0261%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0439%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内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

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 本基金本期投资的前十名证券中，无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

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	19,566,743.69
4	应收申购款	44,296,560.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	63,863,308.69

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	6,041,552,674.14
报告期期间基金总申购份额	4,816,002,826.21
报告期期间基金总赎回份额	5,614,428,560.86
报告期期末基金份额总额	5,243,126,939.49

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2021 年 4 月 7 日	24,000,000.00	24,000,000.00	0.00%
2	申购	2021 年 5 月 11 日	48,000,000.00	48,000,000.00	0.00%
3	赎回	2021 年 5 月 24 日	-9,800,000.00	-9,800,000.00	0.00%
4	赎回	2021 年 5 月 26 日	-85,500,000.00	-85,500,000.00	0.00%
5	申购	2021 年 6 月 7 日	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00%
6	赎回	2021 年 6 月 11 日	-24,000,000.00	-24,000,000.00	0.00%
7	申购	2021 年 6 月 25 日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
合计			12,700,000.00	12,700,000.00	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富兰克林国海安享货币市场基金设立的文件；

2、《富兰克林国海安享货币市场基金基金合同》；

3、《富兰克林国海安享货币市场基金招募说明书》；

4、《富兰克林国海安享货币市场基金托管协议》；

5、中国证监会要求的其他文件。

8.2 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。

8.3 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　查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

2021 年 7 月 21 日