

富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金  
2024 年中期报告

2024 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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。本中期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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 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>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 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	34
7.6 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	35

7.7 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 .....	35
7.8 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 .....	35
7.9 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 .....	35
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	35
7.11 投资组合报告附注 .....	35
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>36</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	36
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	36
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 .....	36
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>36</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>36</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	36
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 .....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	37
10.4 基金投资策略的改变 .....	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	37
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 .....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	37
10.8 其他重大事件 .....	38
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>38</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 .....	38
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	39
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>39</b>
12.1 备查文件目录 .....	39
12.2 存放地点 .....	39
12.3 查阅方式 .....	39

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金
基金简称	国富恒博 63 个月定期开放债券
基金主代码	010468
交易代码	010468
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020 年 11 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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,079,087,443.81 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期初，将视债券、银行存款、债券回购等大类资产的市场环境进行封闭期组合构建。在封闭期内，本基金严格采用买入并持有到期策略构建投资组合，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资资产到期日（或回售日）不得晚于封闭期结束日，力求基金资产在开放前完全变现。</p> <p>本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。</p> <p>封闭期内，基金管理人可以基于持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置。因法律法规或监管要求变化导致本基金的投资标的不符合本合同约定的估值方式，基金管理人有权根据法律法规或监管要求调整估值方式。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产较高的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p>
业绩比较基准	中国人民银行公布的银行三年期定期存款利率（税后）+ 1.0%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金，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	招商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	储丽莉	张姗
	联系电话	021-3855 5555	400-61-95555
	电子邮箱	service@ftsfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555	400-61-95555	
传真	021-6888 3050	0755-8319 5201	
注册地址	南宁高新区中国-东盟企业总部基地三期综合楼 A 座 17 层 1707 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
邮政编码	200120	518040	
法定代表人	吴显玲	缪建民	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金中期报告备置地点	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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	157,564,518.45
本期利润	157,564,518.45
加权平均基金份额本期利润	0.0195
本期加权平均净值利润率	1.93%
本期基金份额净值增长率	1.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	113,004,667.54
期末可供分配基金份额利润	0.0140
期末基金资产净值	8,192,092,111.35
期末基金份额净值	1.0140
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	14.62%

注：1. 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一第 1 号《主要财务指标的计算及披露》。

2. 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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 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）。

4. 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。

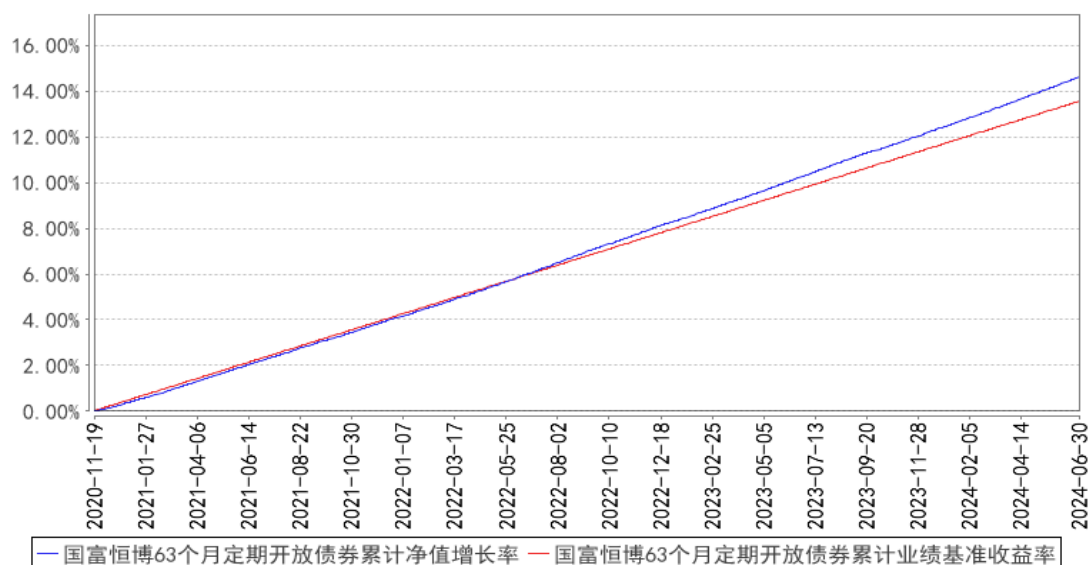
## 3.2 基金净值表现

### 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

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
过去一个月	0.32%	0.01%	0.27%	0.01%	0.05%	0.00%
过去三个月	0.99%	0.01%	0.83%	0.01%	0.16%	0.00%
过去六个月	1.95%	0.01%	1.67%	0.01%	0.28%	0.00%
过去一年	3.90%	0.01%	3.42%	0.01%	0.48%	0.00%
过去三年	12.16%	0.01%	11.01%	0.01%	1.15%	0.00%
自基金合同生效起至今	14.62%	0.01%	13.56%	0.01%	1.06%	0.00%

### 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

国富恒博63个月定期开放债券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 2020 年 11 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，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 76 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 2024 年 6 月末，公司旗下合计管理 47 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，国富新趋势混合基金、国富恒博 63 个月定期开放债券基金、国富鑫颐收益混合基金、国富安颐稳健 6 个月持有期混合基金及国富中债绿色普惠金融债券指	2020 年 11 月 19 日	-	14 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，国海富兰克林基金管理有限公司国富恒嘉短债债券基金及国富恒裕 6 个月定期开放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固定收益投资副总监，国富新趋势混合基金、国富恒博 63 个月定期开放债券基金、国富鑫颐收益混合基金、国富安颐稳健 6 个月持有期混合基金及国富中债绿色普惠金融债券指数基金的基金经理。



	数基金的 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《富兰克林国海恒博 63 个月定期开放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

2024 年上半年外部环境复杂严峻，世界经济增长动能不强，通胀出现高位回落趋势但仍具粘性，主要经济体的经济增长和货币政策有所分化。国内经济高质量发展扎实推进，但仍面临有效需求不足、社会预期偏弱等挑战。

上半年国内债市收益率呈现牛市行情，其中中债总指数上涨 3.88%，中债国债指数上涨 4.38%，中债信用债总指数上涨 2.61%。

从关键经济数据来看，1-5 月份，全国规模以上工业增加值同比累计增长 6.2%；固定资产投

资累计同比增长 4%，其中制造业同比增长 9.6%；基建投资同比增长 5.7%；房地产投资增速同比下降 10.1%；进出口贸易总额累计同比增长 2.8%，其中出口增长 2.7%；进口增长 2.9%。社会消费品零售总额累计同比增长 4.1%。1-6 月份，全国居民消费价格累计同比增长 0.1%；全国工业生产者出厂价格累计同比下降 2.1%。

市场风险偏好有待提升。央行在一季度进行了降准、下调 LPR 等宽松的货币政策以引导经济平稳运行，调节风险偏好。二季度贷款、社融等金融需求仍需提振，贷款环比下降较为明显，4-6 月份银行限制手工计息，又使得存款流出较为突出，银行间资金呈现宽松格局。人民币汇率压力仍大。

账户以投资利率债为主要品种。基金在报告期内持续平稳运作，并结合适当的融资期限，将融资成本保持在合理水平。运作过程中结合市场资金面情况，精细操作，竭力控制融资成本，提高账户收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 06 月 30 日，本基金份额净值为 1.0140 元，报告期内份额净值上涨 1.95%，同期业绩比较基准上涨 1.67%，跑赢业绩比较基准 0.28%。

#### 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。二是地产周期下行，各地因城施策，政策力度仍有发力空间；三是世界经济环境复杂严峻，主要经济体的经济增长和货币政策有所分化，一定程度上给出口企业的需求和预期造成波动。

二、中期金融市场及利率走势呈现震荡格局

一方面风险偏好的回升需要时间；另一方面国内财政、货币、产业等政策的出台及力度效果，需要时间检验，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。随着积极的财政政策持续推进，资金面周期更迭，给金融市场以及利率带来一定波动。

三、未来信用风险爆发仍不可小觑，投资品种料将继续向高等级、好资质集中，利率债品种信用风险较低，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。高等级优质信用品种的信用风险相对可控，流动性较好，市场机构配置需求持续，信用利差持续收缩。

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，争取未来取得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《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

本基金的基金管理人于 2024 年 03 月 01 日宣告分红，向截至 2024 年 03 月 05 日止在本基金注册登记人国海富兰克林基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.130 元。

本基金本报告期所实现的利润分配情况符合基金合同要求。

#### 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，招商银行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	558,947.10	577,979.01
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	13,161,162,104.98	13,114,274,790.87
其中：债券投资		13,161,162,104.98	13,114,274,790.87
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		13,161,721,052.08	13,114,852,769.88
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		4,967,990,703.54	4,982,988,260.28
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		1,005,595.70	1,034,182.02
应付托管费		335,198.55	344,727.38
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	297,442.94	407,759.23
负债合计		4,969,628,940.73	4,984,774,928.91
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	8,079,087,443.81	8,069,743,180.33
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	113,004,667.54	60,334,660.64
净资产合计		8,192,092,111.35	8,130,077,840.97
负债和净资产总计		13,161,721,052.08	13,114,852,769.88

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0140 元，基金份额总额 8,079,087,443.81 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		215,391,105.85	214,551,142.21
1. 利息收入		215,391,105.85	214,551,142.21
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,791.74	47,413.06
债券利息收入		215,385,314.11	214,503,729.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-	-
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		57,826,587.40	61,169,492.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,076,556.04	6,046,509.43
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,025,518.65	2,015,503.22
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		49,599,790.27	52,982,620.10
其中：卖出回购金融资产支出		49,599,790.27	52,982,620.10
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	124,722.44	124,859.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		157,564,518.45	153,381,650.05
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		157,564,518.45	153,381,650.05
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		157,564,518.45	153,381,650.05

### 6.3 净资产变动表

会计主体：富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	8,069,743,180. 33	-	60,334,660.64	8,130,077,840.9 7
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	8,069,743,180.33	-	60,334,660.64	8,130,077,840.97
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	9,344,263.48	-	52,670,006.90	62,014,270.38
(一)、综合收益总额	-	-	157,564,518.45	157,564,518.45
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	9,344,263.48	-	12,147.52	9,356,411.00
其中：1. 基金申购款	9,344,263.48	-	12,147.52	9,356,411.00
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-104,906,659.07	-104,906,659.07
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	8,079,087,443.81	-	113,004,667.54	8,192,092,111.35
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	8,042,783,383.91	-	63,895,296.31	8,106,678,680.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	8,042,783,383.91	-	63,895,296.31	8,106,678,680.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	7,732,666.09	-	63,328,769.40	71,061,435.49
(一)、综合收益总额	-	-	153,381,650.05	153,381,650.05
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	7,732,666.09	-	26,291.03	7,758,957.12
其中：1. 基金申购款	7,732,666.09	-	26,291.03	7,758,957.12
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-90,079,171.68	-90,079,171.68
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	8,050,516,050.00	-	127,224,065.71	8,177,740,115.71

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：

徐荔蓉

于意

肖燕

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

富兰克林国海恒博 63 个月定期开放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[2020]2543 号《关于准予富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》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《富兰克林国海恒博 63 个月定期开放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、定期开放式基金，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 7,995,025,458.88 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(2020)第 0993 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 7,995,043,632.56 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,173.68 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金自基金合同生效后，每 63 个月开放一次申购和赎回。封闭期内，投资者不能申购和赎回基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海恒博 63 个月定期开放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金融工具，包括国内依法发行上市的债券(包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易债券的纯债部分等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资股票、可转换债券和可交换债券，但可以投资可分离交易债券的纯债部分。本基金的投资组合比例为：本基金投资债券资产的比例不低于基金资产的 80%(每个开放期开始前 3 个月、开放期及开放期结束后 3 个月的期间内不受前述比例限制)。在开放期内，本基金持有的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应付申购款等)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%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的银行三年定期存款利率(税后)+1.0%。

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 2024 年 8 月 31 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《富兰克林国海恒博 63 个月定期开放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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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的说明

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》、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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	558,947.10
等于：本金	558,797.49
加：应计利息	149.61
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	558,947.10

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

无。

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

###### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

###### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 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

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目		本期末 2024年6月30日				
		初始成本	利息调整	应计利息	减：减值准备	账面价值
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	12,870,000 ,000.00	25,139,41 0.99	266,022,69 3.99	-	13,161,162, 104.98
	小计	12,870,000 ,000.00	25,139,41 0.99	266,022,69 3.99	-	13,161,162, 104.98
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		12,870,000 ,000.00	25,139,41 0.99	266,022,69 3.99	-	13,161,162, 104.98

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	178,570.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	178,570.50
应付利息	-
审计费用	54,700.10
信息披露费	59,672.34
债券账户维护费	4,500.00
合计	297,442.94

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,069,743,180.33	8,069,743,180.33
本期申购	9,344,263.48	9,344,263.48
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	8,079,087,443.81	8,079,087,443.81

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金本报告期内封闭运作。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

目			
上年度末	60,334,660.64	-	60,334,660.64
本期期初	60,334,660.64	-	60,334,660.64
本期利润	157,564,518.45	-	157,564,518.45
本期基金份额交易产生的变动数	12,147.52	-	12,147.52
其中：基金申购款	12,147.52	-	12,147.52
金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-104,906,659.07	-	-104,906,659.07
本期末	113,004,667.54	-	113,004,667.54

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,791.74
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	-
其他	-
合计	5,791.74

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

无。

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	54,700.10
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
债券账户维护费	9,000.00
银行汇划费用	1,350.00
合计	124,722.44

## 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

无。

## 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、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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

无。

## 6.4.10.1.2 权证交易

无。

## 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

## 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,076,556.04	6,046,509.43
其中：应支付销售机构的客户维护费	891,591.46	890,281.77
应支付基金管理人的净管理费	5,184,964.58	5,156,227.66

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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,025,518.65	2,015,503.22

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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 × 0.05% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

- 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。
- 本报告期和上年度可比期间（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）基金管理人未运用固

有资金投资本基金。

#### 6.4.10.5.2 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 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例 (%)
招商银行股份有限公司	3,949,999,000.00	48.89	3,949,999,000.00	48.95
邓普顿国际股份 有限公司 (Templeton International, Inc.)	-	-	-	-
国海证券股份有 限公司	-	-	-	-
国海富兰克林资 产管理(上海) 有限公司	-	-	-	-

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。

#### 6.4.10.6 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 2024年1月1日至2024年6月30 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
招商银行	558,947.10	5,791.74	593,091.92	47,413.06

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记 日	除息日		每 10 份基 金份	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配合 计	备注
		场内	场外					

				额分 红数				
1	2024 年 3 月 5 日	-	2024 年 3 月 5 日	0.130	95,550,248.07	9,356,411.00	104,906,659.07	-
合计	-	-	-	0.130	95,550,248.07	9,356,411.00	104,906,659.07	-

#### 6.4.12 期末（2024 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 2024 年 06 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 4,967,990,703.54 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
160303	16 进出 03	2024 年 7 月 1 日	101.05	3,854,000	389,444,499.83
160405	16 农发 05	2024 年 7 月 1 日	101.71	20,068,000	2,041,023,832.15
180411	18 农发 11	2024 年 7 月 1 日	103.34	5,264,000	544,007,357.68
200315	20 进出 15	2024 年 7 月 1 日	102.44	12,633,000	1,294,140,666.80
200315	20 进出 15	2024 年 7 月 2 日	102.44	5,264,000	539,250,888.15
160303	16 进出 03	2024 年 7 月 3 日	101.05	5,264,000	531,924,194.90
合计				52,347,000	5,339,791,439.51

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。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“风险和收益相匹配”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，主要是发掘各类风险的风险点，判断风险发生的频度和损失，对风险实行分级管理。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，日常的分析报告，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时对各种风险进行监控和评估，并通过风险处置流程，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人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格、合格境外机构投资者托管人资格或其他经管理人评估资质良好的商业银行，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。

新金融工具准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金在参考历史违约率、

市场信息及行业实践的基础上，选取隐含评级 AA 级为低信用风险阈值，并将减值阶段划分如下：在资产负债表日，若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级不低于初始确认隐含评级，或不低于低信用风险阈值，则处于第一阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级低于初始确认隐含评级，且低于低信用风险阈值，则处于第二阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体中债市场隐含评级下调至 C，或出现其他认定为违约的情形时，则处于第三阶段。

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。

#### 6.4.13.2.1 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	13,161,162,104.98	13,114,274,790.87
合计	13,161,162,104.98	13,114,274,790.87

注：1. 本基金债券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。

2. 未评级债券为期限大于一年的国债、政策银行债、央行票据及未有第三方机构评级的信用债。

3. 债券投资以全价列示。

4. 本基金持有的按长期信用评级列示的债券投资均处于减值第一阶段。

#### 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。本基金所投金融资产到期日（或回售日）不得晚于封闭期结束日，因此基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额对基金组合产生的流动性风险相对较低。本基金可通过开展正回购业务融入资金，流动性风险来源于融入资金通过买入债券进行投资时，无法在债券到期或回售前随时通过卖出债券偿付正回购到期款项。

针对正回购资金到期带来的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金正回购余额进行严密监控和管理，并对资金市场进行持续跟踪和分析，通过适当配置正回购期限确保基金组合流动性充足稳定。

于本期末，除卖出回购金融资产款将在 1 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（净资

产)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》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%。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日,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%。于本期末,本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内,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。于本期末,本基金确认的净赎回申请未超过 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。

#### 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。

本基金对投资组合采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。本基金的基金管理人主要通

过合理配置投资组合的到期期限，管理利率波动带来的再投资风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	558,947.10	-	-	-	558,947.10
债权投资	-	13,161,162,104.98	-	-	13,161,162,104.98
资产总计	558,947.10	13,161,162,104.98	-	-	13,161,721,052.08
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,005,595.70	1,005,595.70
应付托管费	-	-	-	335,198.55	335,198.55
卖出回购金融资产款	4,967,990,703.54	-	-	-	4,967,990,703.54
其他负债	-	-	-	297,442.94	297,442.94
负债总计	4,967,990,703.54	-	-	1,638,237.19	4,969,628,940.73
利率敏感度缺口	-4,967,431,756.44	13,161,162,104.98	-	-1,638,237.19	8,192,092,111.35
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	577,979.01	-	-	-	577,979.01
债权投资	-	13,114,274,790.87	-	-	13,114,274,790.87
资产总计	577,979.01	13,114,274,790.87	-	-	13,114,852,769.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,034,182.02	1,034,182.02
应付托管费	-	-	-	344,727.38	344,727.38
卖出回购金融资产款	4,982,988,260.28	-	-	-	4,982,988,260.28
其他负债	-	-	-	407,759.23	407,759.23
负债总计	4,982,988,260.28	-	-	1,786,668.63	4,984,774,928.91
利率敏感度缺口	-4,982,410,281.27	13,114,274,790.87	-	-1,786,668.63	8,130,077,840.97

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

于本期末，本基金持有至到期的债券投资均为固定利率类的债券品种，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 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。本基金持有的证券所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于本期末，本基金无交易性权益类投资(上年度末：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具(2023 年 12 月 31 日：同)。

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 06 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(2023 年 12 月 31 日：同)。



#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项、债权投资和其他金融负债等。

除债权投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有债权投资为 13,161,162,104.98 元，按公允价值估值金额为 13,436,078,693.99 元（于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有债权投资为 13,114,274,790.87 元，按公允价值估值金额为 13,361,096,761.51 元）。

债权投资按如下原则确定公允价值：(i) 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。(ii) 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。(iii) 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。

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》及中基协字[2022]566号《关于固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，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。于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,161,162,104.98	100.00
	其中：债券	13,161,162,104.98	100.00
	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	-	-
	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	558,947.10	0.00
8	其他各项资产	-	-
9	合计	13,161,721,052.08	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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。

### 7.2.2 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。

## 7.3 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。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

## 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,161,162,104.98	160.66
	其中：政策性金融债	13,161,162,104.98	160.66
4	企业债券	-	-
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	13,161,162,104.98	160.66

### 7.6 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	200315	20 进出 15	57,000,000	5,839,152,854.24	71.28
2	160405	16 农发 05	31,600,000	3,213,890,427.34	39.23
3	160303	16 进出 03	19,000,000	1,919,939,153.31	23.44
4	180214	18 国开 14	15,800,000	1,640,451,897.35	20.02
5	180411	18 农发 11	5,300,000	547,727,772.74	6.69

### 7.7 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。

### 7.8 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。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

#### 7.10.2 本期国债期货投资评价

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.11.4 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换债券。

### 7.11.5 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。

## § 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

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 (%)
256	31,558,935.33	8,079,051,953.30	100.00	35,490.51	0.00

注：鉴于个人投资者持有份额占基金总份额的比例过于微小，四舍五入后无法通过小数点后两位数数据加以列示，故标注为“0.00%”。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	462.00	0.000006

### 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020 年 11 月 19 日) 基金份额总额	7,995,043,632.56
本报告期期初基金份额总额	8,069,743,180.33
本报告期基金总申购份额	9,344,263.48
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	8,079,087,443.81

## § 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

本报告期内，本基金基金管理人无重大人事变动。

### (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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 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

### 10.6.1 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监管部门稽查或处罚。

### 10.6.2 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监管部门稽查或处罚。

## 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	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券		回购成交总		证

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
国海证 券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 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	国海富兰克林基金管理有限公司关于住所变更的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 1 月 20 日
2	富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 1 月 22 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	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 1 月 22 日
4	富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金分红公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 3 月 1 日
5	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 3 月 30 日
6	富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 3 月 30 日
7	富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 4 月 22 日
8	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	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 4 月 22 日
9	关于增加招商银行股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 5 月 8 日
10	国海富兰克林基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 6 月 15 日
11	富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 6 月 26 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	期初 份额	申购 份额	赎回 份额	持有份额	份额 占比

		超过 20%的时间区间					(%)
机构	1	20240101-20240630	3,949,999,000.00	-	-	3,949,999,000.00	48.89

#### 产品特有风险

##### 1. 流动性风险

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。

本基金可通过开展正回购业务融入资金，融入资金通过买入债券进行投资时，可能无法在债券到期或回售前随时通过卖出债券偿付正回购到期款项，从而导致流动性风险。

##### 2. 估值风险

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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1. 本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，确认利息收入并评估减值准备。本报告中投资组合报告公允价值部分均以摊余成本列示。

2. 本基金本报告期内未计提减值准备。

## § 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恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海恒博 63 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海恒博 63 个月定期开放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

2024 年 8 月 31 日