

富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金  
2021 年中期报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 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 2021 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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</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.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
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.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	39
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	40

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	41
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	44
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	44
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	44
7.11 投资组合报告附注.....	45
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	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.....	48
10.8 其他重大事件.....	53
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>55</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.....	55
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金
基金简称	国富美元债定期债券（QDII）
基金主代码	003972
交易代码	003972
基金运作方式	契约型定期开放
基金合同生效日	2017 年 1 月 25 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	210,378,136.00 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下，力争总回报最大化，以谋求长期保值增值。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过研究全球市场经济运行趋势，深入分析不同国家和地区财政及货币政策对经济运行的影响，结合对中长期利率走势、通货膨胀及各类债券的收益率、波动性的预期，自上而下地决定债券组合久期，对投资组合类属资产的比例进行最优化配置和动态调整。</p> <p>2、债券投资策略：包括久期策略、信用债券投资策略、收益率曲线策略、券种配置策略和衍生工具投资。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，并可能适度提高现金比例，减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	95%×巴克莱资本美国综合债券指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	储丽莉
	联系电话	021-38555555
	电子邮箱	service@ftsfund.com
		李申
		021-60637102
		lishen.zh@ccb.com

客户服务电话	400-700-4518、9510-5680 和 021-38789555	021-60637111
传真	021-68883050	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	吴显玲	田国立

#### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	JP Morgan Chase Bank, National Association
	中文	-	摩根大通银行
注册地址		-	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH, USA
办公地址		-	270 Park Avenue, New York, New York, USA
邮政编码		-	10017

#### 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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

#### 2.6 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(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	5,612,423.10
本期利润	9,109,114.33
加权平均基金份额本期利润	0.0456
本期加权平均净值利润率	4.37%
本期基金份额净值增长率	4.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	7,731,620.72
期末可供分配基金份额利润	0.0368
期末基金资产净值	224,648,669.63
期末基金份额净值	1.0678
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	12.25%

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。

5. 上述“期末基金份额净值”为人民币份额的基金份额净值，报告期末美元份额的基金份额净值为0.1653美元。

#### 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

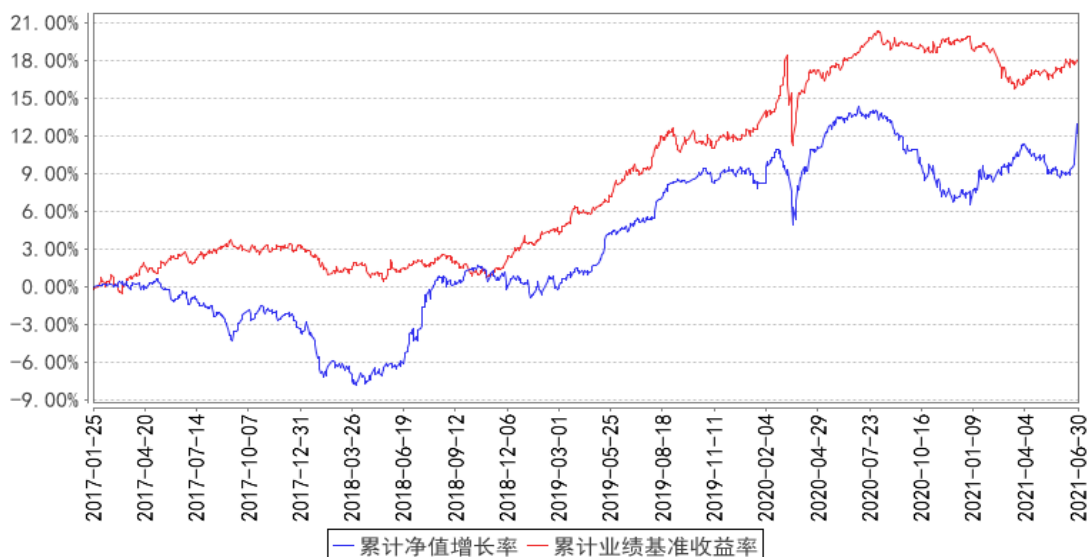
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去一个月	3.23%	0.59%	0.67%	0.20%	2.56%	0.39%
过去三个月	0.86%	0.40%	1.74%	0.18%	-0.88%	0.22%
过去六个月	4.53%	0.38%	-1.51%	0.21%	6.04%	0.17%
过去一年	-1.30%	0.32%	-0.30%	0.18%	-1.00%	0.14%
过去三年	16.55%	0.28%	16.07%	0.23%	0.48%	0.05%
自基金合同生效起至今	12.25%	0.26%	18.11%	0.21%	-5.86%	0.05%

注：上述“净值增长率”为人民币份额的净值增长率，基金合同生效以来美元份额净值增长率为 19.22%，净值增长率标准差为 0.18%。

### 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

国富美元债定期债券（QDII）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：上述对比图展示的是人民币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，本基金的基金合同生效日为 2017 年 1 月 25 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 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 2021 年 6 月末，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		
徐成	公司 QDII 投资总监，国富亚洲机会股票(QDII)基金、国富大中华精选混合(QDII)基金、国富美元债定期债券(QDII)基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金、国富全球科技互联混合(QDII)基金及国富港股通远见价值混合基金的基金经理	2017 年 1 月 25 日	-	15 年	徐成先生，CFA，朴茨茅斯大学（英国）金融决策分析硕士。历任永丰金证券（亚洲）有限公司上海办事处研究员，新加坡东京海上国际资产管理有限公司上海办事处研究员、高级研究员、首席代表，国海富兰克林基金管理有限公司 QDII 投资副总监。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司 QDII 投资总监，国富亚洲机会股票(QDII)基金、国富大中华精选混合(QDII)基金、国富美元债定期债券(QDII)基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金、国富全球科技互联混合(QDII)基金及国富港股通远见价值混合基金的基金经理。

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《富兰克林国海美元债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

上半年，10 年期美国国债收益率大幅上行约 55 个基点至 1.47%，3 月底一度上行至 1.75%。投资级债券信用利差收窄 12 个基点，4 月受到中国华融 2020 年年报推迟发布消息影响，华融美元债价格大幅下跌，其次级永续债价格一度跌破 50 美元。由于华融国际美元债存量大于

200 亿美元，占整个中资美元债存量的 3%不到，受其债券价格大幅下跌影响，中资投资级美元债指数出现急跌，回调幅度超过 1.7%。弱国企，投资级 AMC 债券价格也出现不同程度的下跌。年初高收益债券受华夏幸福违约事件影响，市场信用表现分化，3 月底由于一些地产年报业绩暴雷，信用分化进一步加剧，5 月以来蓝光违约，恒大商票兑付逾期，融创拿地激进被约谈等信用事件扰动，整体市场赚钱效应低。

上半年，本基金总体维持了合理的久期配置，积极参与一级市场债券新发。行业配置中，金融、美国国债、房地产等配置相对较多，投资上加大风险排查力度，以及控制好组合久期。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金人民币份额净值 1.0678 元，本报告期份额净值上涨 4.53%，业绩比较基准下跌 1.51%，跑赢业绩基准 6.04%；美元份额净值 0.1653 美元，本报告期份额净值上涨 5.58%，业绩比较基准下跌 1.51%，跑赢业绩基准 7.09%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

5 月下旬以来，恒大美元债价格持续下跌，我们认为只要恒大的信用风险未靴子落地，整体高收益债的表现将持续分化，BB 级债券收益率维持在相对低位，B 级债券收益率超过双位数。叠加华融的信用风险尚未得到妥善解决，我们预计下半年整体市场仍以震荡为主。

#### 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 2021 年 2 月 3 日宣告分红，向截至 2021 年 2 月 5 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基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.180 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金实施利润分配的金额为 3,565,190.37 元。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	9,860,704.81	11,655,781.33
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	210,831,595.65	190,132,804.64
其中：股票投资		14,413,048.45	17,813,226.44
基金投资		-	-
债券投资		196,418,547.20	172,319,578.20
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	-	-
应收证券清算款		7,984,436.63	1,376,634.92
应收利息	6.4.7.5	3,283,961.47	2,676,981.85
应收股利		272,777.49	99,664.49
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	7,976,148.65	1,374,992.83
资产总计		240,209,624.70	207,316,860.06
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		7,250,294.91	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		162,033.80	156,469.22
应付托管费		45,009.38	43,463.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		24,960.80	26,895.26

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	8,078,656.18	1,576,634.92
负债合计		15,560,955.07	1,803,463.05
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	210,378,136.00	197,740,861.73
未分配利润	6.4.7.10	14,270,533.63	7,772,535.28
所有者权益合计		224,648,669.63	205,513,397.01
负债和所有者权益总计		240,209,624.70	207,316,860.06

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 210,378,136.00 份，其中国富美元债定期债券基金人民币份额 157,945,333.86 份，份额净值人民币 1.0678 元；国富美元债定期债券基金美元现汇份额 52,432,802.14 份，份额净值美元 0.1653 元。

## 6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		10,611,443.18	11,289,446.23
1. 利息收入		4,247,626.96	5,016,535.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,843.23	14,293.49
债券利息收入		4,241,783.73	5,002,242.44
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）		3,802,071.33	3,712,051.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,812,499.86	1,992,961.36
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-6,291,112.51	1,481,919.01
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	280,683.98	237,170.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,496,691.23	2,592,220.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-934,946.34	-31,361.87
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	0.66

减：二、费用		1,502,328.85	1,447,824.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	930,681.30	905,040.40
2. 托管费	6.4.10.2.2	258,522.51	251,400.14
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	193,484.78	164,457.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		15,270.46	18,008.05
7. 其他费用	6.4.7.20	104,369.80	108,918.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,109,114.33	9,841,621.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,109,114.33	9,841,621.59

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	197,740,861.73	7,772,535.28	205,513,397.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	9,109,114.33	9,109,114.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	12,637,274.27	954,074.39	13,591,348.66
其中：1. 基金申购款	68,702,106.44	3,809,844.11	72,511,950.55
2. 基金赎回款	-56,064,832.17	-2,855,769.72	-58,920,601.89
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）	-	-3,565,190.37	-3,565,190.37



列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	210,378,136.00	14,270,533.63	224,648,669.63
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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)	172,935,503.28	15,607,107.79	188,542,611.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	9,841,621.59	9,841,621.59
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)	24,384,811.39	1,069,842.56	25,454,653.95
其中：1. 基金申购款	61,606,295.63	3,972,513.19	65,578,808.82
2. 基金赎回款	-37,221,484.24	-2,902,670.63	-40,124,154.87
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)	-	-3,116,432.35	-3,116,432.35
五、期末所有者权益(基金净值)	197,320,314.67	23,402,139.59	220,722,454.26

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

于意

主管会计工作负责人

肖燕

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海美元债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[2016]第 2737 号《关于准予富兰克林国海美元债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《富兰克林国海美元债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 684,614,710.34 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 045 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 684,878,198.01 份基金份额，其中认购资金利息折合 263,487.67 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外托管人为摩根大通银行。

根据《富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购、申购、赎回所使用货币的不同，将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额类别，称为人民币份额；以美元计价并进行认购、申购、赎回的份额类别，称为美元份额。本基金的封闭期为自基金合同生效之日(含)起或自每一开放期结束之日次日(含)起一年的期间。自封闭期结束之后第一个工作日(含)起进入开放期，每个开放期原则上不少于五个工作日且不超过十五个工作日，开放期的具体时间以基金管理人公告为准。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海美元债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政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于美元债券的比例不低于非现金基金资产的 80%，但在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内，每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，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不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受前述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为：95%×巴克莱资本美国综

合债券指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率。

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 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》、《富兰克林国海美元债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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 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》及其他相关境内外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股票、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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	9,860,704.81
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-

合计	9,860,704.81
----	--------------

注：于 2021 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 369,997.48 元，美元活期存款 1,469,127.00 元(折合人民币 9,490,707.33 元)。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	15,507,077.32	14,413,048.45	-1,094,028.87
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	198,949,408.25	196,418,547.20
	合计	198,949,408.25	196,418,547.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	214,456,485.57	210,831,595.65	-3,624,889.92

注：银行间市场债券均为境外柜台交易市场交易债券，参照做市商或其他权威价格提供机构的报价估值。

#### 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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	14.41
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	3,283,947.06
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	3,283,961.47

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	7,976,148.65
待摊费用	-
合计	7,976,148.65

#### 6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末未持有应付交易费用。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付未起息外汇交易	7,984,436.63
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
合计	8,078,656.18

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	197,740,861.73	197,740,861.73
本期申购	68,702,106.44	68,702,106.44
本期赎回（以“-”号填列）	-56,064,832.17	-56,064,832.17
本期末	210,378,136.00	210,378,136.00

注：

1. 根据本基金《基金合同》、《招募说明书》的规定，本基金的封闭期为自本基金《基金合同》生效之日起（包括该日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）1 年的期间。本基金

办理申购与赎回业务的开放期为本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）原则上不少于 5 个工作日且不超过 15 个工作日的期间。本基金的第四个封闭期为自第三个开放期结束之日次日起（包括该日）1 年的期间，即 2020 年 3 月 21 日至 2021 年 3 月 20 日，但由于 2021 年 3 月 21 日为非工作日，因此，本公司于 2021 年 3 月 22 日起（含该日）开放 15 个工作日办理本基金的申购业务，同时开放 5 个工作日办理本基金的赎回业务，即申购期间为 2021 年 3 月 22 日起（含该日）至 2021 年 4 月 12 日（含该日），赎回期间为 2021 年 3 月 22 日起（含该日）至 2021 年 3 月 26 日（含该日）。

2. 本基金自 2021 年 4 月 13 日起进入下一封闭期，封闭期内不办理申购与赎回业务。
3. 申购含红利再投份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,548,959.90	2,223,575.38	7,772,535.28
本期利润	5,612,423.10	3,496,691.23	9,109,114.33
本期基金份额交易产生的变动数	148,637.16	805,437.23	954,074.39
其中：基金申购款	1,146,383.34	2,663,460.77	3,809,844.11
基金赎回款	-997,746.18	-1,858,023.54	-2,855,769.72
本期已分配利润	-3,565,190.37		-3,565,190.37
本期末	7,744,829.79	6,525,703.84	14,270,533.63

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,668.06
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	1,175.17
合计	5,843.23

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	46,992,171.51

减：卖出股票成本总额	37,179,671.65
买卖股票差价收入	9,812,499.86

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021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	-6,291,112.51
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	-6,291,112.51

##### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	152,561,513.09
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	156,330,402.23
减：应收利息总额	2,522,223.37
买卖债券差价收入	-6,291,112.51

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	280,683.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	280,683.98



## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,496,691.23
股票投资	-277,979.77
债券投资	3,774,671.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
合计	3,496,691.23

## 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	193,484.78
银行间市场交易费用	-
合计	193,484.78

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
银行汇划费	9,545.46
其他费用	604.79
合计	104,369.80

## 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

本基金的基金管理人于 2021 年 08 月 04 日宣告 2021 年度第 2 次分红，向截至 2021 年 08 月 06 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 0.180 元。

#### 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、基金销售机构、基金登记机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
摩根大通银行 (JPMorgan Chase Bank, National Association)	基金境外资产托管人
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：关联方与基金进行的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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	930,681.30	905,040.40
其中：支付销售机构的客户维护费	161,677.42	177,664.18

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 0.90% 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 × 0.90% ÷ 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	258,522.51	251,400.14

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% ÷ 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

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

#### 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自有资金投资本基金的情况

1. 基金管理人运用自有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
2. 本报告期和上年度可比期间（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 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（2020 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
摩根大通银行	9,446,360.62	-	9,380,904.57	4,224.67
中国建设银行	414,344.19	4,668.06	550,475.15	9,865.87

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人摩根大通银行保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 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须作说明的其他关联交易事项。

#### 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 基金份额 分红数	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					
1	2021 年 02 月 05 日	-	2021 年 2 月 4 日	0.1800	3,094,604.15	470,586.22	3,565,190.37	-
合计	-	-	-	0.1800	3,094,604.15	470,586.22	3,565,190.37	-

#### 6.4.12 期末(2021 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

本基金本报告期末无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

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。

### 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，主要为固定收益证券品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。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平衡型基金，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。

#### 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行和境外托管人摩根大通银行，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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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。

本基金债券投资的信用评级情况按债券评级机构标准普尔、穆迪、惠誉等公司设定的标准统计及汇总。

#### 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
AAA	27,010,906.81	6,062,039.91
A+至 A-	63,999,991.05	3,286,494.26
BBB+至 BBB-	9,500,636.50	21,169,026.68
BB+至 BB-	89,246,649.74	104,345,182.92
B+至 B-	6,660,363.10	31,503,417.79
未评级	-	5,953,416.64
合计	196,418,547.20	172,319,578.20

#### 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于约定开放日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于开放期内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 2021 年 6 月 30 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，因此账面余额即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》且于基金开放期内按照《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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，于开放期内，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上述比例限制）。

本基金所持大部分证券在场外市场交易，因此均能以合理价格适时变现。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 2021 年 6 月 30 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。

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。

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。

本基金主要投资于场外市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	9,860,704.81	-	-	-	9,860,704.81
交易性金融资产	66,041,774.59	120,517,141.89	9,859,630.72	14,413,048.45	210,831,595.65
应收利息	-	-	-	3,283,961.47	3,283,961.47
应收股利	-	-	-	272,777.49	272,777.49
应收证券清算款	-	-	-	7,984,436.63	7,984,436.63
其他资产	-	-	-	7,976,148.65	7,976,148.65
<b>资产总计</b>	<b>75,902,479.40</b>	<b>120,517,141.89</b>	<b>9,859,630.72</b>	<b>33,930,372.69</b>	<b>240,209,624.70</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	162,033.80	162,033.80
应付托管费	-	-	-	45,009.38	45,009.38
应付证券清算款	-	-	-	7,250,294.91	7,250,294.91
应交税费	-	-	-	24,960.80	24,960.80
其他负债	-	-	-	8,078,656.18	8,078,656.18
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>15,560,955.07</b>	<b>15,560,955.07</b>
利率敏感度缺口	75,902,479.40	120,517,141.89	9,859,630.72	18,369,417.62	224,648,669.63
<b>上年度末</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>



2020 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	11,655,781.33	-	-	-	11,655,781.33
交易性金融资产	67,547,213.33	98,710,324.96	6,062,039.91	17,813,226.44	190,132,804.64
应收证券清算款	-	-	-	1,376,634.92	1,376,634.92
应收利息	-	-	-	2,676,981.85	2,676,981.85
应收股利	-	-	-	99,664.49	99,664.49
其他资产	-	-	-	1,374,992.83	1,374,992.83
资产总计	79,202,994.66	98,710,324.96	6,062,039.91	23,341,500.53	207,316,860.06
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	156,469.22	156,469.22
应付托管费	-	-	-	43,463.65	43,463.65
应交税费	-	-	-	26,895.26	26,895.26
其他负债	-	-	-	1,576,634.92	1,576,634.92
负债总计	-	-	-	1,803,463.05	1,803,463.05
利率敏感度缺口	79,202,994.66	98,710,324.96	6,062,039.91	21,538,037.48	205,513,397.01

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		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	市场利率下降 25 个基点	增加约 110	增加约 47
	市场利率上升 25 个基点	减少约 110	减少约 47

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

## 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	9,490,707 .33	-	-	9,490,707.33
交易性金融资 产	196,418,5 47.20	14,413,048.45	-	210,831,595.65
应收股利	-	272,777.49	-	272,777.49
应收利息	3,283,947 .45	-	-	3,283,947.45
应收证券清算 款	-	7,984,436.63	-	7,984,436.63
其它资产	7,976,148 .65	-	-	7,976,148.65
资产合计	217,169,3 50.63	22,670,262.57	-	239,839,613.20
以外币计价的 负债				
应付证券清算 款	7,250,294 .91	-	-	7,250,294.91
其他负债	-	7,984,436.63	-	7,984,436.63
负债合计	7,250,294 .91	7,984,436.63	-	15,234,731.54
资产负债表外 汇风险敞口净 额	209,919,0 55.72	14,685,825.94	-	224,604,881.66
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元 折合人民	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计

	币元			
以外币计价的资产				
银行存款	11,406,942.35	-	-	11,406,942.35
交易性金融资产	172,319,578.20	17,813,226.44	-	190,132,804.64
应收股利	-	99,664.49	-	99,664.49
应收利息	2,676,974.12	-	-	2,676,974.12
应收证券清算款	-	1,376,634.92	-	1,376,634.92
其它资产	1,374,992.83	-	-	1,374,992.83
资产合计	187,778,487.50	19,289,525.85	-	207,068,013.35
以外币计价的负债				
其他负债	-	1,376,634.92	-	1,376,634.92
负债合计	-	1,376,634.92	-	1,376,634.92
资产负债表外汇风险敞口净额	187,778,487.50	17,912,890.93	-	205,691,378.43

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）	
分析	所有外币相对人民币升值 5%	增加约 1,196	增加约 1,028
	所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 1,196	减少约 1,028

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票和场外市场交易的债券，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，采用“自上而下”的策略，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。本基金投资组合中债券资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于美元债券的比例不低于非现金基金资产的 80%，但在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内，每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，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不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受前述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	14,413,048.45	6.42	17,813,226.44	8.67
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	14,413,048.45	6.42	17,813,226.44	8.67

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 6.42% (2020 年 12 月 31 日：8.67%)，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 (2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 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 2021 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一层次的余额为 19,345,870.98 元，属于第二层次的余额为 191,485,724.67 元，无属于第三层次的余额 (2020 年 12 月 31 日：第一层次 17,813,226.44 元，第二层次 172,319,578.20 元，无第三层次)。

##### (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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃 (包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不

会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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 2021 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(2020 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	权益投资	14,413,048.45	6.00
	其中：普通股	14,413,048.45	6.00
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	196,418,547.20	81.77
	其中：债券	196,418,547.20	81.77
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,860,704.81	4.11
8	其他各项资产	19,517,324.24	8.13
9	合计	240,209,624.70	100.00

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	14,413,048.45	6.42
合计	14,413,048.45	6.42

注：以上国家（地区）均按照股票及存托凭证上市交易地点进行统计。

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
电信业务	1,554,991.10	0.69
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-

医疗保健	-	-
工业	4,483,496.66	2.00
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	8,374,560.69	3.73
公共事业	-	-
合计	14,413,048.45	6.42

注：以上分类采用 GICS 行业分类标准。

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Excellence Commercial Property & Facilities Management	卓越商企服务	6989 HK	香港联合交易所	中国香港	347,000	2,445,558.01	1.09
2	Greentown Service Group Co Ltd	绿城服务集团	2869 HK	香港联合交易所	中国香港	176,000	1,766,139.72	0.79
3	China Overseas Property Holdings Limited	中海物业	2669 HK	香港联合交易所	中国香港	250,000	1,726,566.00	0.77
4	Logan Group Company Limited	龙光集团有限公司	3380 HK	香港联合交易所	中国香港	166,000	1,605,015.75	0.71
5	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	3,200	1,554,991.10	0.69
6	Country Garden Services Holdings Company Limited	碧桂园服务	6098 HK	香港联合交易所	中国香港	21,000	1,466,041.75	0.65
7	KWG Group Holdings Limited	合景泰富	1813 HK	香港联合交易所	中国香港	155,000	1,341,312.96	0.60
8	China Resources Land Limited	华润置地	1109 HK	香港联合交易所	中国香港	48,000	1,256,107.97	0.56
9	Ever Sunshine Lifestyle Services Group Limited	永升生活服务	1995 HK	香港联合交易所	中国香港	78,000	1,251,315.19	0.56

注：上述表格“所属国家（地区）”均按照股票及存托凭证上市交易地点统计。



## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

## 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	China Resources Land Limited	1109 HK	5,152,100.31	2.51
2	Morimatsu International Holdings Company Limited	2155 HK	2,917,714.66	1.42
3	Xinyi Glass Holdings Limited	868 HK	2,855,182.46	1.39
4	Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Limited	6989 HK	2,692,056.95	1.31
5	China Taiping Insurance Holdings Company Limited	966 HK	2,391,144.63	1.16
6	Tencent Holdings Ltd	700 HK	2,277,679.10	1.11
7	Cifi Ever Sunshine Services Group Limited	1995 HK	2,242,181.05	1.09
8	S-Enjoy Service Group Co., Limited	1755 HK	2,159,897.34	1.05
9	Greentown Service Group Co. Ltd.	2869 HK	1,834,893.18	0.89
10	Logan Group Company Limited	3380 HK	1,734,443.19	0.84
11	Longfor Group Holdings Limited	960 HK	1,556,831.00	0.76
12	Midea Real Estate Holding Limited	3990 HK	1,120,178.62	0.55
13	Hope Education Group Co., Ltd.	1765 HK	935,924.05	0.46
14	Country Garden Services Holding	6098 HK	839,138.36	0.41

	gs Company Limited			
15	Rlx Technology Inc.	RLX US	705,617.64	0.34
16	Sunac China Holdings Limited	1918 HK	703,250.49	0.34
17	Greentree Hospitality Group Ltd	GHG US	662,110.00	0.32
18	Remegen Co., Ltd.	9995 HK	638,783.24	0.31
19	Kwg Group Holdings Limited	1813 HK	452,620.66	0.22
20	Everest Medicines Limited	1952 HK	137,615.56	0.07

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Morimatsu International Holdings Company Limited	2155 HK	7,998,748.12	3.89
2	Cifi Ever Sunshine Services Group Limited	1995 HK	4,968,370.53	2.42
3	Tencent Holdings Ltd	700 HK	4,485,991.06	2.18
4	China Resources Land Limited	1109 HK	4,062,541.48	1.98
5	Xinyi Glass Holdings Limited	868 HK	3,093,302.93	1.51
6	Yum China Holdings, Inc.	9987 HK	2,593,166.60	1.26
7	China Taiping Insurance Holdings Company Limited	966 HK	2,439,566.33	1.19
8	S-Enjoy Service Group Co., Limited	1755 HK	2,264,248.49	1.10
9	Country Garden Services Holding	6098 HK	2,220,419.76	1.08

	s Company Limited			
10	Midea Real Estate Holding Limited	3990 HK	1,954,158.51	0.95
11	Sunac China Holdings Limited	1918 HK	1,892,721.41	0.92
12	Longfor Group Holdings Limited	960 HK	1,778,242.07	0.87
13	Rlx Technology Inc.	RLX US	1,733,731.04	0.84
14	Jinke Smart Services Group Co., Ltd.	9666 HK	1,682,881.04	0.82
15	Kwg Group Holdings Limited	1813 HK	1,617,367.35	0.79
16	Hope Education Group Co., Ltd.	1765 HK	924,681.93	0.45
17	Remegen Co., Ltd.	9995 HK	605,188.06	0.29
18	Greentree Hospitality Group Ltd.	GHG US	502,919.47	0.24
19	Everest Medicines Limited	1952 HK	130,860.00	0.06
20	Joinn Laboratories (China) Co., Ltd.	6127 HK	21,715.24	0.01

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	34,057,473.43
卖出收入（成交）总额	46,992,171.51

注：“买入股票成本总额”及“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
AA+至 AA-	27,010,906.81	12.02
A+至 A-	46,985,486.26	20.92

BBB+至 BBB-	16,237,939.39	7.23
BB+至 BB-	99,523,851.64	44.3
B+至 B-	6,660,363.10	2.96

注：上述债券投资组合主要适用标准普尔、穆迪、惠誉等国际权威机构评级。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	XS1513700127	CIFIHG 5 1/2 01/23/22	10,336,160	10,484,793.98	4.67
2	XS2238561281	BOCOM 3.8 PERP	10,013,155	10,383,541.60	4.62
3	XS1684793018	POSABK 4 1/2 PERP	10,013,155	10,277,201.90	4.57
4	US912828YA22	T 1 1/2 08/15/22	9,690,150	9,841,937.09	4.38
5	XS1541978851	LOGPH 5 3/4 01/03/22	9,690,150	9,814,862.23	4.37

注：1. 债券代码为 ISIN 码。

2. 数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金资产。

## 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

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	7,984,436.63
3	应收股利	272,777.49
4	应收利息	3,283,961.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	7,976,148.65
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,517,324.24

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	XS1655583596	SHPORT 0 08/09/22	2,825,311.81	1.26
2	XS2333569056	MEITUA 0 04/27/28	2,107,510.72	0.94

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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 (%)
475	442,901.34	164,336,487.62	78.11	46,041,648.38	21.89

### 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	4,140.82	0.001968

### 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（2017 年 1 月 25 日） 基金份额总额	684,878,198.01
本报告期期初基金份额总额	197,740,861.73
本报告期基金总申购份额	68,702,106.44
减：本报告期基金总赎回份额	56,064,832.17
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	210,378,136.00

## § 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为普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### (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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----



	元数量	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	
Goldman Sachs (Asia) LLC	2	6,665,151.82	8.22%	8,188.71	7.33%	-
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	2	4,900,661.16	6.05%	4,900.67	4.39%	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	2	10,115,138.87	12.48%	10,115.15	9.06%	-
Daiw Capital Markets Hongkong Limited	2	3,454,731.29	4.26%	3,529.07	3.16%	-
Haitong International Securities Company Limited	2	20,208,831.80	24.93%	34,870.15	31.22%	-
CLSA Limited	1	6,262,560.05	7.73%	9,685.28	8.67%	-
JP.Morgan Securities plc	1	8,415,340.34	10.38%	12,623.01	11.30%	-
Jefferies Hongkong Limited	1	8,216,946.48	10.14%	12,657.08	11.33%	-
Macquarie Capital Asia Limited	1	6,243,977.45	7.7%	6,243.97	5.59%	-
China Everbright Securities (HK) Securities	1	1,426,294.60	1.76%	3,428.12	3.07%	-
BOCI Securities Limited	1	4,420,568.65	5.45%	5,304.68	4.75%	-
China Renaissance Securities (HK)	1	705,617.64	0.87%	-	-	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	2	13,824.78	0.02%	138.25	0.12%	-
Bank of China (HK)	1	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities	1	-	-	-	-	-

(Hong Kong) Limited						
Zhongtai International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	1	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International plc	1	-	-	-	-	-
BOCOM International Holdings Company Limited	1	-	-	-	-	-
CMB International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Core Pacific-Yamaichi International (H.K.) Ltd.	1	-	-	-	-	-
BNP Paribas	1	-	-	-	-	-
BOC International	1	-	-	-	-	-
Nomura International Plc	1	-	-	-	-	-
Bank of America Merrill Lynch	1	-	-	-	-	-
China Securities International	1	-	-	-	-	-
Guosen Securities (HK)	1	-	-	-	-	-
JP Morgan Chase & Co.	1	-	-	-	-	-
Southwest International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein (HK) Limited	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

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，本基金新增国海证券深圳交易单元 1 个。

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Goldman Sachs (Asia) LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong kong) Limited	3,266,105.63	1.18%	-	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	37,286,018.31	13.53%	-	-	-	-	-	-
Daiw Capital Markets Hongkong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
JP.Morgan Securities plc	-	-	-	-	-	-	-	-
Jefferies Hongkong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Macquarie Capital Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China Everbright Securities(HK) Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China Renaissance Securities(HK)	-	-	-	-	-	-	-	-

China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	10,257,230.81	3.72%	-	-	-	-	-	-	-
Bank of China (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	39,335,787.03	14.27%	-	-	-	-	-	-	-
Zhongtai International Securities Limited	5,226,974.09	1.9%	-	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	1,316,315.68	0.48%	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International plc	25,814,733.98	9.36%	-	-	-	-	-	-	-
BOCOM International Holdings Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CMB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Core Pacific-Yamaichi International (H.K.) Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas	26,970,762.97	9.78%	-	-	-	-	-	-	-
BOC International	9,049,359.09	3.28%	-	-	-	-	-	-	-
Nomura International Plc	88,868,999.21	32.24%	-	-	-	-	-	-	-
Bank of America Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-	-
China Securities International	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Guosen Securi	-	-	-	-	-	-	-	-	-

ties (HK)								
JP Morgan Chase & Co.	28,264,083.20	10.25%	-	-	-	-	-	-
Southwest International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
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	2021-01-22
2	富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-01-22
3	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加奕丰基金销售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	2021-01-26
4	富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-02-03
5	国海富兰克林基金关于与通联支付合作开通招商银行借记卡支付并实施申购和定期定额投资费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-03-09
6	富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金开放申购及赎回业务公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-03-15
7	关于增加中国国际金融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、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-03-22
8	国海富兰克林基金管理有限公司 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-03-31
9	富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-03-31
10	关于增加中国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	2021-04-01
11	关于增加爱建证券有限责任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业务、定	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-04-21

	期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告		
12	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	2021-04-21
13	富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-04-21
14	关于增加海通期货有限责任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	2021-05-18
15	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中信建投证券股份有限公司申购、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	2021-05-21
16	关于增加上海中欧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	2021-05-22
17	国海富兰克林基金管理有限公司关于调整个人账户开户证件类型类型的公告	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-06-15
18	富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金更新招募说明书（2021 年 1 号）	中国证监会指定报刊及指定网站	2021-06-30

## § 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	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	78,068,565.00	-	-	78,068,565.00	37.11
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。</p> <p>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><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美元债定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海美元债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

2021 年 8 月 31 日