

富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金  
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 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.....	6
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>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
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	21
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51

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 .....	51
7.10 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录 .....	61
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金	
基金简称	国富强化收益债券	
基金主代码	450005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 10 月 24 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	548,874,562.99 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国富强化收益债券 A	国富强化收益债券 C
下属分级基金的交易代码	450005	450006
报告期末下属分级基金的份额总额	522,704,924.64 份	26,169,638.35 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过主动的资产管理，在严格控制风险、保证资产充分流动性的基础上，力求为投资者创造持续稳定的投资回报。
投资策略	<p><b>固定收益类品种投资策略：</b> 本基金将采取积极主动的投资策略，以中长期利率趋势分析为主，结合经济周期、宏观经济运行中的价格指数、资金供求分析、货币政策、财政政策研判及收益率曲线分析，在保证流动性和风险可控的前提下，实施积极的债券投资组合管理。</p> <p><b>动态收益增强策略：</b> 本基金根据债券市场的动态变化，采取多种灵活的策略，获取超额收益。</p> <p><b>股票投资策略：</b> 本基金主要采用“自下而上”的投资策略，将定量的股票筛选和定性的公司深度研究相结合，精选具有稳定的现金分红能力和持续的盈利增长预期，且估值合理的优质上市公司股票。</p> <p><b>可转债投资策略：</b> 可转换债券（含可交易分离可转债）兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转债的选择结合其债性和股性特征，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券，获取稳健的投资回报。</p> <p><b>权证投资策略：</b> 本基金不直接从二级市场买入权证，可持有股票派发或可分离交易债券所分离的权证。</p>

业绩比较基准	中债总指数（全价）
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	010-66596688
	电子邮箱	service@ftsfund.com	fcib@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	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(2022年01月01日-2022年06月30日)		
	国富强化收益债券 A	国富强化收益债券 C	
本期已实现收益	1,989,158.21	85,556.79	
本期利润	-3,692,471.62	-91,731.63	
加权平均基金份额本期利润	-0.0066	-0.0031	
本期加权平均净值利润率	-0.58%	-0.28%	
本期基金份额净值增长率	-0.02%	-0.18%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)		
	期末可供分配利润	49,902,877.92	2,028,757.48
	期末可供分配基金份额利润	0.0955	0.0775
	期末基金资产净值	593,827,713.83	29,274,206.19
	期末基金份额净值	1.1361	1.1186
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)		
	基金份额累计净值增长率	116.60%	103.31%

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—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

国富强化收益债券 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
过去一个月	1.18%	0.21%	-0.28%	0.05%	1.46%	0.16%
过去三个月	1.34%	0.27%	0.00%	0.06%	1.34%	0.21%
过去六个月	-0.02%	0.29%	-0.29%	0.08%	0.27%	0.21%
过去一年	2.94%	0.23%	1.74%	0.09%	1.20%	0.14%
过去三年	16.74%	0.21%	3.33%	0.11%	13.41%	0.10%
自基金合同生效起至今	116.60%	0.23%	12.63%	0.11%	103.97%	0.12%

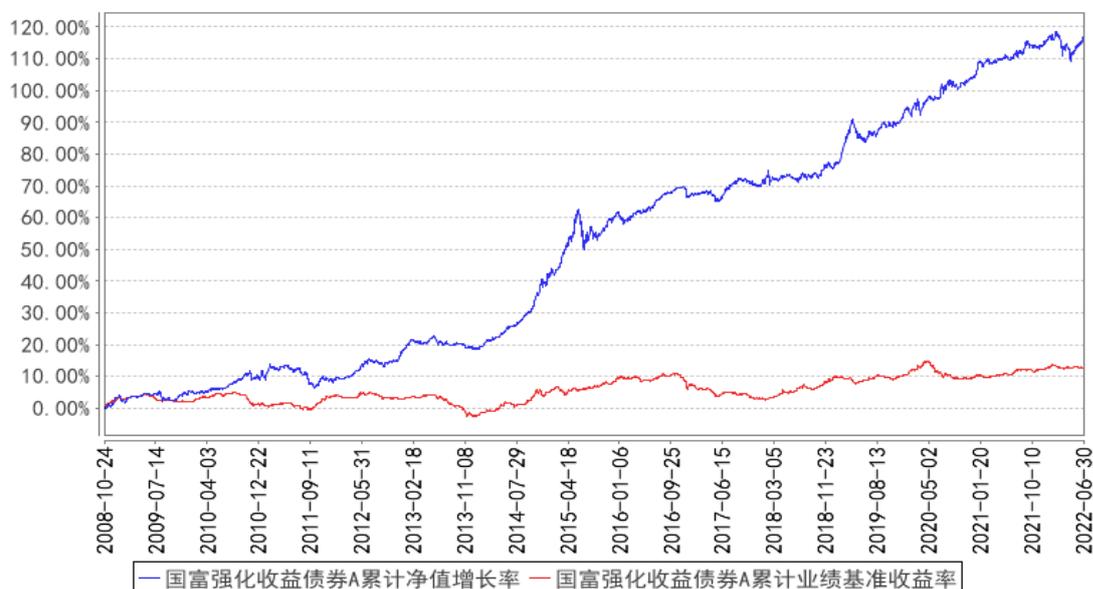
国富强化收益债券 C

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
过去一个月	1.15%	0.21%	-0.28%	0.05%	1.43%	0.16%
过去三个月	1.25%	0.27%	0.00%	0.06%	1.25%	0.21%
过去六个月	-0.18%	0.29%	-0.29%	0.08%	0.11%	0.21%

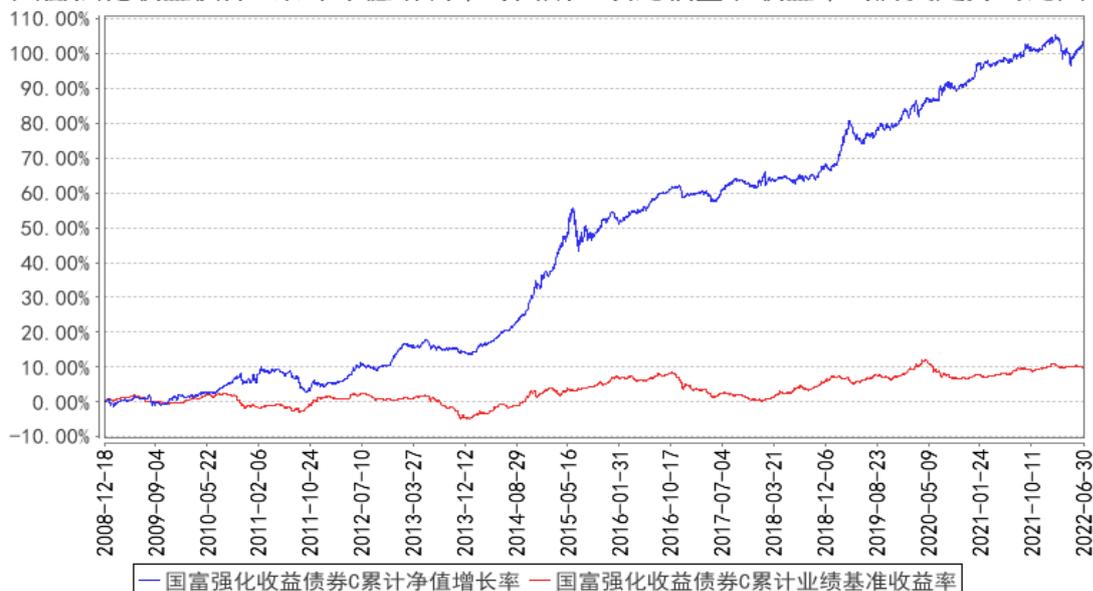
过去一年	2.62%	0.23%	1.74%	0.09%	0.88%	0.14%
过去三年	15.68%	0.21%	3.33%	0.11%	12.35%	0.10%
自基金合同生效起至今	103.31%	0.23%	9.98%	0.11%	93.33%	0.12%

### 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

国富强化收益债券A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



国富强化收益债券C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 2008 年 10 月 24 日，并于 2008 年 12 月 18 日推出 C 类收费模式。

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 75 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 2022 年 6 月末，公司旗下合计管理 40 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		
刘怡敏	公司固定收益投资总监，国富强化收益债券基金、国富恒久信用债券基金、国富恒利债券（LOF）基金及国富焦点驱动混合基金的基金经理	2008 年 10 月 24 日	-	18 年	刘怡敏女士，CFA，四川大学金融学硕士。历任西南证券研究发展中心债券研究员、富国基金管理有限公司债券研究员、国海富兰克林基金管理有限公司国富中国收益混合基金的基金经理。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总监，国富强化收益债券基金、国富恒久信用债券基金、国富恒利债券（LOF）基金及国富焦点驱动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《富兰克林国海强化收益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

上半年，GDP 同比增长 2.5%，经济增长进一步降温。房地产行业风险继续显现，多家房企出现违约和被下调评级，地产债券收益率大幅上行。国内房地产销售、开工、新开工等受影响，大幅走低。1-5 月，全国房地产开发投资同比下降 4%，房地产施工面积同比下降 1%，房地产新开工面积同比下降 30.6%。1—5 月份，商品房销售面积 50738 万平方米，同比下降 23.6%，商品房销售额 48337 亿元，下降 31.5%。二季度，中央银行降低了首套房贷 LPR 上浮水平并降低五年期 LPR15 个基点。各地刺激房地产销售的政策频有推出。截至 6 月末，房地产销售情况有所好转，高频指标显示同比降幅明显缩窄。

上半年，多城采取封控措施应对爆发的新冠疫情，全国范围内物流和货运受到影响，工业生产有所中断。4 月和 5 月工业增加值分别同比下降 2.9% 和上涨 0.7%。消费需求受到冲击，4 月和 5 月，社会消费品零售总额分别同比下降 11.1% 和下降 6.7%。

随着疫情在各地得到控制，进入 6 月后，上海复工复产加快，江浙地区生产恢复有序进行，

珠三角地区经济活动旺盛。从各项高频指标来看，电厂耗煤量快速回升，化工、汽车等行业开工率显著提升。消费方面，随着第三次乘用车减征车辆购置税和汽车下乡政策的推进，6月乘用车批发销量同环比增长 41.3%/37.4%，零售销量 194.3 万辆，同环比增长 22.6%/43.5%。汽车产销量同比环比均有明显提升。经济在 4 月见到低点并触底回升。

海外美联储加息三次，联邦基金利率上升到 1.75%，和国内隔夜利率形成倒挂。美债收益率快速上升并宽幅震荡，中美十年国债利差倒挂。受美联储快速加息影响，美国经济衰退预期上升，国际大宗商品价格见顶回落。随着美元指数走强，人民币兑美元汇率在三季度大幅贬值 5.53%。海外央行紧缩政策对国内货币政策继续降息等政策形成制约。

上半年，A 股市场在先跌后涨，万德全 A 指数下跌 9.53%，中证转债指数下跌 4.07%。债市总体走强，中债综合财富指数上涨 1.83%，中债总财富指数上涨 0.99%，中债信用债总财富指数上涨 1.22%。上半年，基金提高组合久期，增加杠杆，提高在资金利率走低环境下的绝对回报。权益市场先跌后涨，基金抓住时机提高权益仓位，受益于市场回暖，获取了一定的超额回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.1361 元，本报告期份额净值下跌 0.02%，同期业绩比较基准下跌 0.29%，跑赢业绩比较基准 0.27%；本基金 C 类份额净值为 1.1186 元，本报告期份额净值下跌 0.18%，同期业绩比较基准下跌 0.29%，跑赢业绩比较基准 0.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年下半年，经济增长将从二季度的低位向上修复，但受全球经济增速下降以及国内多种因素影响，经济复苏的不确定性较大。在常态化核酸和疫情防控的背景下，我们看到，疫情再次大范围爆发的风险大幅降低。虽然我们认为房地产行业负面事件在下半年大面积铺开并造成系统性的风险的可能性较低，但是地产销售仍将受到较大影响，进而对地产投资和地产产业链的复苏形成负面影响。

三季度，我们需要关注两方面的数据：一是货币政策的变化，7 月初央行将 OMO 从 100 亿缩量到每日 30 亿，资金利率逐步向上修复，当前市场利率持续低于政策利率，资金价格的边际变化尤为重要；二是通胀压力的传导，预期上游通胀压力较为持续之后，涨价因素逐步传导至中下游并带来 CPI 价格上涨的压力，其中最主要的涨价因子是能源相关的油价以及食品相关的猪肉价格，其中既有供需结构的问题，也有成本传导的问题。美联储在下半年估计将加息在 100-125 个基点。海外央行持续加息，带来全球范围需求放缓。

总体来看，债券方面，预计货币政策短期仍将宽松的状态，收益率维持低位状态可能会延长。策略上，低收益环境下将保持灵活操作。权益方面，随着上游能源价格达到较高水平，PPI 开始逐

步传到中下游，我们将配置于供给受限需求回升的行业、受益于成本下降的中下游制造业等。在资金价格逐步回归中性的过程中，权益的配置可能趋向均衡。基金继续按照基金合同及相关法律法规要求，做好行业个股的配置，优选个券，争取未来更好的长期投资收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会（简称“估值委员会”），并已制订了《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 2022 年 3 月 23 日宣告本报告期第一次分红，向截至 2022 年 3 月 25 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 A 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.171 元，C 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.141 元。

本基金的基金管理人于 2022 年 6 月 17 日宣告本报告期第二次分红，向截至 2022 年 6 月 21 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 A 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.171 元，C 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.138 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富兰克林国海强化收益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”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,998,588.52	288,299.36
结算备付金		2,109,221.59	1,446,670.03
存出保证金		24,059.40	23,454.92
交易性金融资产	6.4.7.2	676,517,464.32	630,283,414.22
其中：股票投资		115,600,723.08	104,328,321.62
基金投资		-	-
债券投资		560,916,741.24	525,955,092.60
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	101,011,112.88	5,000,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	4,005,414.79
应收股利		-	-
应收申购款		14,559.54	48,417.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	6,437,219.92
资产总计		783,675,006.25	647,532,891.06
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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		156,013,618.30	10,999,863.50
应付清算款		3,007,030.74	-
应付赎回款		115,927.33	55,861.84

应付管理人报酬		306,785.70	313,000.31
应付托管费		102,261.92	104,333.43
应付销售服务费		7,188.71	5,660.11
应付投资顾问费		-	-
应交税费		844,576.89	841,758.65
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	175,696.64	281,832.79
负债合计		160,573,086.23	12,602,310.63
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	548,874,562.99	542,903,242.34
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	74,227,357.03	92,027,338.09
净资产合计		623,101,920.02	634,930,580.43
负债和净资产总计		783,675,006.25	647,532,891.06

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，国富强化收益债券 A 基金份额净值 1.1361 元，基金份额总额 522,704,924.64 份；国富强化收益债券 C 基金份额净值 1.1186 元，基金份额总额 26,169,638.35 份。国富强化收益债券份额总额合计为 548,874,562.99 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-669,230.98	17,521,577.11
1. 利息收入		139,720.02	9,280,533.80
其中：存款利息收入	6.4.7.9	17,339.45	26,100.86
债券利息收入		-	9,179,855.61
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		122,380.57	74,577.33
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,020,874.28	22,384,773.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,049,907.70	18,833,155.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	7,892,140.68	2,394,295.61

资产支持证券投资 收益			-	-
贵金属投资收益			-	-
衍生工具收益	6.4.7.12		-	-
股利收益	6.4.7.13		1,178,641.30	1,157,323.31
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）	6.4.7.14		-5,858,918.25	-14,155,563.44
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）			-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.15		29,092.97	11,832.81
<b>减：二、营业总支出</b>			<b>3,114,972.27</b>	<b>3,756,006.06</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1		2,005,437.60	2,055,811.64
2. 托管费	6.4.10.2.2		668,479.25	685,270.54
3. 销售服务费	6.4.10.2.3		49,807.97	41,183.10
4. 投资顾问费			-	-
5. 利息支出			267,400.34	535,013.99
其中：卖出回购金融资产 支出			267,400.34	535,013.99
6. 信用减值损失	6.4.7.16		-	-
7. 税金及附加			8,768.15	13,186.84
8. 其他费用	6.4.7.17		115,078.96	425,539.95
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>			<b>-3,784,203.25</b>	<b>13,765,571.05</b>
减：所得税费用			-	-
<b>四、净利润（净亏损以 “-”号填列）</b>			<b>-3,784,203.25</b>	<b>13,765,571.05</b>
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>			<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>			<b>-3,784,203.25</b>	<b>13,765,571.05</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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	542,903,242.34	-	92,027,338.09	634,930,580.43

期末净资产（基金净值）				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产（基金净值）	542,903,242.34	-	92,027,338.09	634,930,580.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,971,320.65	-	-17,799,981.06	-11,828,660.41
（一）、综合收益总额	-	-	-3,784,203.25	-3,784,203.25
（二）、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）	5,971,320.65	-	5,935,337.35	11,906,658.00
其中：1. 基金申购款	114,162,044.73	-	19,553,213.95	133,715,258.68
2. 基金赎回款	-108,190,724.08	-	-13,617,876.60	-121,808,600.68
（三）、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	-	-	-19,951,115.16	-19,951,115.16

列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	548,874,562.99	-	74,227,357.03	623,101,920.02
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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(基金净值)	534,325,117.57	-	97,306,077.32	631,631,194.89
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	534,325,117.57	-	97,306,077.32	631,631,194.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	77,191,199.21	-	7,261,516.11	84,452,715.32
(一)、综合收益总额	-	-	13,765,571.05	13,765,571.05
(二)、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)	77,191,199.21	-	14,438,300.35	91,629,499.56
其中:1.基金申购	129,996,887.42	-	24,943,155.38	154,940,042.80

款				
2. 基金赎回款	-52,805,688.21	-	-10,504,855.03	-63,310,543.24
(三)、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)	-	-	-20,942,355.29	-20,942,355.29
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	611,516,316.78	-	104,567,593.43	716,083,910.21

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

富兰克林国海强化收益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[2008]第 1049 号《关于核准富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金募集的批复》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《富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,074,710,139.32 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 155 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金基金合同》于 2008 年 10 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,074,835,078.73 份基

基金份额，其中认购资金利息折合 124,939.41 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《富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金基金合同》和《关于富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金基金合同修改的公告》并报中国证监会备案，自 2008 年 12 月 18 日起，本基金根据费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的，称为 A 类；不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海强化收益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国内依法公开发行、上市的债券、股票、权证及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；投资于股票等非固定收益类证券的比例不高于基金资产的 20%。本基金的业绩比较基准为：中债总指数(全价)。

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 2022 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》、《富兰克林国海强化收益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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 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估计与最近一期年度报告相一致，所采用的会计政策发生变更。

#### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

##### 1. 新金融工具准则(2022 年 1 月 1 日起适用的新金融工具准则)

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

## 2. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

### (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股票投资和债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。

## 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

### 1. 新金融工具准则(2022 年 1 月 1 日起适用的新金融工具准则)

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,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起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债,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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

于每个资产负债表日,本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。

金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

## 2. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

##### 1. 新金融工具准则(2022 年 1 月 1 日起适用的新金融工具准则)

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率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投资收益。

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扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，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。

##### 2. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。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。

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。

## 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 288,299.36 元、1,446,670.03 元、23,454.92 元、5,000,000.00 元、6,437,219.92 元、4,005,414.79 元和 48,417.82 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 288,751.98 元、1,447,321.03 元、23,465.42 元、4,995,938.91 元、0.00 元、4,005,414.79 元和 48,417.82 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 630,283,414.22 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 636,723,581.11 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-应付赎回费，金额分别为 10,999,863.50 元、55,861.84 元、313,000.31 元、104,333.43 元、5,660.11 元、77,441.92 元、5,349.30 元和 41.57 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产

款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-应付赎回费，金额分别为 11,005,212.80 元、55,861.84 元、313,000.31 元、104,333.43 元、5,660.11 元、77,441.92 元、0.00 元和 41.57 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额（若有）均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税

的，不再缴纳；已缴纳增值的，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)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	3,998,588.52
等于：本金	3,998,481.53
加：应计利息	106.99
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	3,998,588.52

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	118,308,506.18	-	115,600,723.08	-2,707,783.10	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	264,985,590.21	2,519,687.18	273,472,541.98	5,967,264.59
	银行间市场	281,943,292.14	2,705,199.26	287,444,199.26	2,795,707.86
	合计	546,928,882.35	5,224,886.44	560,916,741.24	8,762,972.45
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	665,237,388.53	5,224,886.44	676,517,464.32	6,055,189.35	

#### 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

##### 6.4.7.4.1 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 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,000,000.00	-
银行间市场	97,011,112.88	-
合计	101,011,112.88	-

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	58.01
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	80,352.31

其中：交易所市场	75,495.96
银行间市场	4,856.35
应付利息	-
信息披露费	59,507.37
审计费用	26,778.95
债券账户维护费	9,000.00
合计	175,696.64

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 国富强化收益债券 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	509,760,565.30	509,760,565.30
本期申购	105,452,085.35	105,452,085.35
本期赎回（以“-”号填列）	-92,507,726.01	-92,507,726.01
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	522,704,924.64	522,704,924.64

##### 国富强化收益债券 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,142,677.04	33,142,677.04
本期申购	8,709,959.38	8,709,959.38
本期赎回（以“-”号填列）	-15,682,998.07	-15,682,998.07
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	26,169,638.35	26,169,638.35

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

##### 国富强化收益债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	64,336,468.98	22,760,276.41	87,096,745.39
本期利润	1,989,158.21	-5,681,629.83	-3,692,471.62
本期基金份额交易产生的变动数	2,786,160.56	4,141,264.69	6,927,425.25

其中：基金申购款	13,314,877.01	4,956,341.02	18,271,218.03
基金赎回款	-10,528,716.45	-815,076.33	-11,343,792.78
本期已分配利润	-19,208,909.83	-	-19,208,909.83
本期末	49,902,877.92	21,219,911.27	71,122,789.19

## 国富强化收益债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,437,800.32	1,492,792.38	4,930,592.70
本期利润	85,556.79	-177,288.42	-91,731.63
本期基金份额交易产生的变动数	-752,394.30	-239,693.60	-992,087.90
其中：基金申购款	903,203.82	378,792.10	1,281,995.92
基金赎回款	-1,655,598.12	-618,485.70	-2,274,083.82
本期已分配利润	-742,205.33	-	-742,205.33
本期末	2,028,757.48	1,075,810.36	3,104,567.84

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	7,934.86
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	9,144.15
其他	260.44
合计	17,339.45

## 6.4.7.10 股票投资收益

## 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,049,907.70
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-4,049,907.70

## 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

卖出股票成交总额	56,624,015.20
减：卖出股票成本总额	60,481,261.11
减：交易费用	192,661.79
买卖股票差价收入	-4,049,907.70

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	7,072,538.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	819,602.64
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	7,892,140.68

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	388,125,083.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	383,141,893.61
减：应计利息总额	4,158,427.43
减：交易费用	5,159.43
买卖债券差价收入	819,602.64

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,178,641.30
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,178,641.30

##### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-5,858,918.25
股票投资	-5,399,138.41
债券投资	-459,779.84
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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-5,858,918.25

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	29,092.95
基金转换费收入	0.02
合计	29,092.97

注：

1. 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。
2. 本基金的转换费由申购费补差和转出基金的赎回费组成，其中不低于转出赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	26,778.95
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	10,192.64
债券账户维护费	18,000.00
其他手续费	600.00
合计	115,078.96

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
国海证券股份有限公司（“国海证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,005,437.60	2,055,811.64
其中：支付销售机构的客户维护 费	82,864.40	24,642.72

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0.6%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 × 0.6% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	668,479.25	685,270.54

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 0.2% 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 × 0.2% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富强化收益债券 A	国富强化收益债券 C	合计
国海富兰克林基金管理有限公司		25,365.78	25,365.78
中国银行		774.69	774.69
国海证券		30.91	30.91
合计		26,171.38	26,171.38
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富强化收益债券 A	国富强化收益债券 C	合计
国海富兰克林基金管理有限公司		34,317.21	34,317.21
中国银行		743.98	743.98
国海证券		209.07	209.07
合计		35,270.26	35,270.26

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.3% 的年费率计提，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：日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金份额对应的资产净值 × 0.3% / 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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	国富强化收益债券 A	国富强化收益债券 C
基金合同生效日（2008 年 10 月 24 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	31,136,176.75	-
报告期间申购/买入总份额	948,342.51	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	32,084,519.26	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.14%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	国富强化收益债券 A	国富强化收益债券 C
基金合同生效日（2008 年 10 月 24 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	29,310,407.84	-
报告期间申购/买入总份额	902,370.43	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	30,212,778.27	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.16%	-

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

## 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

国富强化收益债券 A

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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 (%)
国海富兰克林资产管理 (上海)有限公司	8,404,984.04	1.61	8,156,552.60	1.60
国海证券股份有限公司	-	-	-	-
邓普顿国际股份有限公 司 (Templeton International, Inc.)	-	-	-	-
中国银行股份有限公司	-	-	-	-

注：1. 本报告期末和上年度末（2021年12月31日）除基金管理人之外的其他关联方未投资国富强化收益债券 C 基金。

2. 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。

#### 6.4.10.5 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 2022年1月1日至2022年6月30 日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,998,588.52	7,934.86	689,583.42	8,814.53

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无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

国富强化收益债券 A								
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	2022年3 月25日	-	2022年3 月25日	0.1710	4,994,94 0.91	5,343,517. 68	10,338,4 58.59	-
2	2022年6 月21日	-	2022年6 月21日	0.1710	4,266,73 0.09	4,603,721. 15	8,870,45 1.24	-
合计	-	-	-	0.3420	9,261,67	9,947,238.	19,208,9	-

					1.00	83	09.83	
国富强化收益债券 C								
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	2022 年 3 月 25 日	-	2022 年 3 月 25 日	0.1410	196,505. 81	187,128.07	383,633. 88	-
2	2022 年 6 月 21 日	-	2022 年 6 月 21 日	0.1380	177,381. 46	181,189.99	358,571. 45	-
合计	-	-	-	0.2790	373,887. 27	368,318.06	742,205. 33	-

#### 6.4.12 期末(2022 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

本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 100,005,503.42 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
190305	19 进出 05	2022 年 7 月 1 日	102.65	200,000	20,529,616.44
200008	20 付息国 债 08	2022 年 7 月 1 日	101.11	400,000	40,444,328.77
200013	20 付息国 债 13	2022 年 7 月 1 日	103.75	150,000	15,561,756.17
210403	21 农发 03	2022 年 7 月 1 日	102.86	300,000	30,857,589.04
合计				1,050,000	107,393,290.42

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 56,008,114.88 元，截至 2022 年 7 月 1 日、2022 年 7 月 4 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## 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，包括国内依法发行上市的债券、股票、权证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，其中权证投资仅限于参与可分离转债申购而获得的权证，即本基金不从二级市场购买权证。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于货币市场基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”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分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。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。

本基金固定收益类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。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	50,703,873.20	40,024,000.00
合计	50,703,873.20	40,024,000.00

注：未评级部分为政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	312,123,449.85	306,437,115.50
AAA 以下	1,921,002.45	2,319,182.20
未评级	196,168,415.74	177,174,794.90
合计	510,212,868.04	485,931,092.60

注：未评级部分为国债和政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 155999750.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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%。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）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 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。

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 2022 年 6 月 30 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。

#### 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,998,588.52	-	-	-	3,998,588.52
结算备付金	2,109,221.59	-	-	-	2,109,221.59
存出保证金	24,059.40	-	-	-	24,059.40
交易性金融资产	210,800,066.51	278,145,398.82	71,971,275.91	115,600,723.08	676,517,464.32
买入返售金融资产	101,011,112.88	-	-	-	101,011,112.88
应收申购款	-	-	-	14,559.54	14,559.54
资产总计	317,943,048.90	278,145,398.82	71,971,275.91	115,615,282.62	783,675,006.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	115,927.33	115,927.33
应付管理人报酬	-	-	-	306,785.70	306,785.70
应付托管费	-	-	-	102,261.92	102,261.92
应付清算款	-	-	-	3,007,030.74	3,007,030.74
卖出回购金融资产款	156,013,618.30	-	-	-	156,013,618.30
应付销售服务费	-	-	-	7,188.71	7,188.71
应交税费	-	-	-	844,576.89	844,576.89
其他负债	-	-	-	175,696.64	175,696.64
负债总计	156,013,618.30	-	-	4,559,467.93	160,573,086.23
利率敏感度缺口	161,929,430.60	278,145,398.82	71,971,275.91	111,055,814.69	623,101,920.02
上年度末 2021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	288,299.36	-	-	-	288,299.36
结算备付金	1,446,670.03	-	-	-	1,446,670.03
存出保证金	23,454.92	-	-	-	23,454.92
交易性金融资产	124,868,666.40	284,525,392.70	116,561,033.50	104,328,321.62	630,283,414.22
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	5,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	4,005,414.79	4,005,414.79
应收利息	-	-	-	6,437,219.92	6,437,219.92

应收申购款	-	-	-	48,417.82	48,417.82
资产总计	131,627,090.71	284,525,392.70	116,561,033.50	114,819,374.15	647,532,891.06
负债					
卖出回购金融资产款	10,999,863.50	-	-	-	10,999,863.50
应付赎回款	-	-	-	55,861.84	55,861.84
应付管理人报酬	-	-	-	313,000.31	313,000.31
应付托管费	-	-	-	104,333.43	104,333.43
应付销售服务费	-	-	-	5,660.11	5,660.11
应付交易费用	-	-	-	77,441.92	77,441.92
应付利息	-	-	-	5,349.30	5,349.30
应交税费	-	-	-	841,758.65	841,758.65
其他负债	-	-	-	199,041.57	199,041.57
负债总计	10,999,863.50	-	-	1,602,447.13	12,602,310.63
利率敏感度缺口	120,627,227.21	284,525,392.70	116,561,033.50	113,216,927.02	634,930,580.43

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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 市场利率下降25个基点	增加约 216	增加约 226
	市场利率上升 25个基点	减少约 213	减少约 222

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，固定收益类资产以外的其它资产(包括股票、权证等)的比例不超过基金资产的 20%。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 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	115,600,723.08	18.55	104,328,321.62	16.43
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	115,600,723.08	18.55	104,328,321.62	16.43

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2022 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 18.55%(2021 年 12 月 31 日：16.43%)，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(2021 年 12 月 31 日：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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	260,957,674.18	187,528,947.22
第二层次	415,559,790.14	442,754,467.00
第三层次	-	-
合计	676,517,464.32	630,283,414.22

##### 6.4.14.2.2 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；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。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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（2021 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和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 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	115,600,723.08	14.75
	其中：股票	115,600,723.08	14.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	560,916,741.24	71.58
	其中：债券	560,916,741.24	71.58
	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	101,011,112.88	12.89
	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	6,107,810.11	0.78
8	其他各项资产	38,618.94	0.00
9	合计	783,675,006.25	100.00

注：鉴于部分资产占基金资产净值的比例过于微小，四舍五入后无法通过小数点后两位数据加以列示，故标注为“0.00”。

### 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	76,303,537.91	12.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,560,640.00	2.18
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	19,438,167.00	3.12
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,533,685.14	0.89
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	764,693.03	0.12
S	综合	-	-
	合计	115,600,723.08	18.55

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	003816	中国广核	4,270,500	11,957,400.00	1.92
2	601677	明泰铝业	343,980	8,186,724.00	1.31
3	601318	中国平安	145,500	6,793,395.00	1.09
4	601688	华泰证券	447,300	6,351,660.00	1.02
5	603588	高能环境	479,938	5,533,685.14	0.89
6	002271	东方雨虹	104,300	5,368,321.00	0.86
7	002032	苏泊尔	88,300	4,974,822.00	0.80
8	600519	贵州茅台	2,200	4,499,000.00	0.72
9	002959	小熊电器	70,400	4,388,032.00	0.70
10	002353	杰瑞股份	107,900	4,348,370.00	0.70
11	600426	华鲁恒升	146,100	4,266,120.00	0.68
12	300772	运达股份	160,840	4,091,769.60	0.66
13	000403	派林生物	149,500	3,283,020.00	0.53
14	002236	大华股份	197,900	3,249,518.00	0.52
15	000001	平安银行	210,100	3,147,298.00	0.51
16	002648	卫星化学	113,447	2,932,604.95	0.47
17	300415	伊之密	154,600	2,818,358.00	0.45
18	600438	通威股份	45,900	2,747,574.00	0.44
19	002472	双环传动	78,200	2,489,888.00	0.40
20	600690	海尔智家	87,400	2,400,004.00	0.39
21	600150	中国船舶	123,800	2,349,724.00	0.38
22	000933	神火股份	165,600	2,166,048.00	0.35
23	600580	卧龙电驱	148,800	2,145,696.00	0.34
24	300735	光弘科技	175,500	1,833,975.00	0.29
25	600674	川投能源	134,500	1,603,240.00	0.26
26	601166	兴业银行	79,100	1,574,090.00	0.25
27	601658	邮储银行	291,600	1,571,724.00	0.25

28	002064	华峰化学	146,100	1,233,084.00	0.20
29	600276	恒瑞医药	30,200	1,120,118.00	0.18
30	601238	广汽集团	62,039	945,474.36	0.15
31	300003	乐普医疗	43,000	798,510.00	0.13
32	300251	光线传媒	80,749	764,693.03	0.12
33	300782	卓胜微	4,800	648,000.00	0.10
34	000725	京东方 A	164,400	647,736.00	0.10
35	603298	杭叉集团	41,500	640,345.00	0.10
36	002557	洽洽食品	10,800	614,844.00	0.10
37	603699	纽威股份	69,900	587,859.00	0.09
38	000636	风华高科	28,100	527,999.00	0.08

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601688	华泰证券	7,253,842.00	1.14
2	000001	平安银行	5,126,115.54	0.81
3	002032	苏泊尔	5,054,245.00	0.80
4	603699	纽威股份	4,819,374.00	0.76
5	002271	东方雨虹	4,313,905.00	0.68
6	002959	小熊电器	3,610,401.00	0.57
7	300415	伊之密	3,502,528.00	0.55
8	002472	双环传动	3,024,578.00	0.48
9	600519	贵州茅台	2,916,665.00	0.46
10	600150	中国船舶	2,889,746.42	0.46
11	601166	兴业银行	2,681,622.00	0.42
12	003816	中国广核	2,592,272.00	0.41
13	000933	神火股份	2,219,465.00	0.35
14	600438	通威股份	2,184,468.00	0.34
15	600690	海尔智家	2,166,897.00	0.34
16	600580	卧龙电驱	1,866,940.00	0.29
17	000403	派林生物	1,764,224.00	0.28
18	601658	邮储银行	1,557,144.00	0.25
19	603039	ST 泛微	1,548,396.00	0.24
20	300735	光弘科技	1,518,837.40	0.24

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

##### 7.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	8,518,250.00	1.34

2	003816	中国广核	6,594,059.00	1.04
3	600585	海螺水泥	6,222,815.00	0.98
4	600507	方大特钢	6,141,557.00	0.97
5	002001	新和成	4,583,116.20	0.72
6	000636	风华高科	3,740,259.00	0.59
7	000725	京东方 A	3,266,458.00	0.51
8	603699	纽威股份	2,981,006.00	0.47
9	000001	平安银行	2,286,370.00	0.36
10	300772	运达股份	1,842,396.00	0.29
11	002472	双环传动	1,548,070.00	0.24
12	300415	伊之密	1,388,128.00	0.22
13	603039	ST 泛微	915,261.00	0.14
14	600150	中国船舶	807,444.00	0.13
15	601677	明泰铝业	784,258.00	0.12
16	601238	广汽集团	742,951.00	0.12
17	603588	高能环境	569,403.00	0.09
18	601318	中国平安	491,369.00	0.08
19	601688	华泰证券	437,777.00	0.07
20	002032	苏泊尔	354,445.00	0.06

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	77,152,800.98
卖出股票收入（成交）总额	56,624,015.20

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

#### 7.5 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	96,244,680.94	15.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	110,204,841.97	17.69
	其中：政策性金融债	110,204,841.97	17.69
4	企业债券	127,857,275.99	20.52
5	企业短期融资券	40,422,766.03	6.49
6	中期票据	40,830,225.21	6.55
7	可转债（可交换债）	145,356,951.10	23.33
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	560,916,741.24	90.02

## 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	200008	20 附息国债 08	400,000	40,444,328.77	6.49
2	012280357	22 中石化 SCP004	400,000	40,422,766.03	6.49
3	132015	18 中油 EB	309,490	32,431,541.89	5.20
4	210403	21 农发 03	300,000	30,857,589.04	4.95
5	113044	大秦转债	277,350	30,247,259.10	4.85

## 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 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

## 7.10.3 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	24,059.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,559.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,618.94

## 7.10.4 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	113044	大秦转债	30,247,259.10	4.85

2	110059	浦发转债	22,601,057.13	3.63
3	113042	上银转债	21,088,610.24	3.38
4	113021	中信转债	3,492,499.90	0.56
5	110079	杭银转债	2,083,446.49	0.33
6	127045	牧原转债	1,915,647.56	0.31
7	123107	温氏转债	1,863,047.86	0.30
8	110053	苏银转债	1,718,360.10	0.28
9	113052	兴业转债	1,605,836.66	0.26
10	113050	南银转债	250,275.42	0.04
11	113634	珀莱转债	1,397.95	0.00

注：鉴于部分资产占基金资产净值的比例过于微小，四舍五入后无法通过小数点后两位数据加以列示，故标注为“0.00”。

#### 7.10.5 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

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 (%)
国富强化 收益债券 A	1,269	411,903.01	510,776,739.86	97.72	11,928,184.78	2.28
国富强化 收益债券 C	471	55,561.86	23,651,398.55	90.38	2,518,239.80	9.62
合计	1,740	315,445.15	534,428,138.41	97.37	14,446,424.58	2.63

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

### 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	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	国富强化收益债券 A	0
	国富强化收益债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	国富强化收益债券 A	0
	国富强化收益债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富强化收益债券 A	国富强化收益债券 C
基金合同生效日 (2008 年 10 月 24 日) 基金份额总额	1,074,835,078.73	-
本报告期期初基金 份额总额	509,760,565.30	33,142,677.04
本报告期基金总申 购份额	105,452,085.35	8,709,959.38
减：本报告期基金 总赎回份额	92,507,726.01	15,682,998.07
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	522,704,924.64	26,169,638.35

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

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，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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自成立以来对其进行审计的均是普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### (一) 基金管理人及高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形：

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### (二) 基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
申万宏源	2	33,613,537.42	25.13	31,305.40	25.13	-
华创证券	1	20,989,566.94	15.69	19,546.39	15.69	-

光大证券	2	17,206,338.00	12.86	16,024.47	12.86	-
国信证券	1	12,329,811.62	9.22	11,483.56	9.22	-
中金公司	1	11,398,485.20	8.52	10,615.44	8.52	-
东吴证券	2	9,003,202.00	6.73	8,384.82	6.73	-
民生证券	1	6,649,529.00	4.97	6,192.60	4.97	-
兴业证券	1	5,407,623.00	4.04	5,035.96	4.04	-
瑞银证券	1	4,973,406.00	3.72	4,631.71	3.72	-
招商证券	1	3,613,756.00	2.70	3,365.50	2.70	-
中泰证券	1	3,128,733.00	2.34	2,913.73	2.34	-
中信建投	2	2,799,641.00	2.09	2,606.67	2.09	-
银河证券	1	2,642,832.00	1.98	2,460.77	1.98	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	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，本基金交易单元无变更。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)

申万宏源	138,251,375.20	71.74	402,000,000.00	33.61	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	1,593,829.15	0.83	-	-	-	-
国信证券	15,723,550.00	8.16	57,000,000.00	4.77	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券	3,087,649.42	1.60	-	-	-	-
民生证券	20,012,000.00	10.38	59,500,000.00	4.97	-	-
兴业证券	1,196.06	0.00	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	153,000,000.00	12.79	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	75,000,000.00	6.27	-	-
中信建投	3,107,839.20	1.61	350,000,000.00	29.26	-	-
银河证券	-	-	69,600,000.00	5.82	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	9,732,883.00	5.05	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	30,000,000.00	2.51	-	-
中银国际	1,194,096.75	0.62	-	-	-	-

## 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	关于增加上海利得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	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-1-4
2	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指定网站	2022-1-24
3	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-1-24
4	关于国海富兰克林基金管理有限公司	中国证监会规定报刊及	2022-1-26

	司旗下部分基金参加平安证券股份有限公司费率优惠活动的公告	指定网站	
5	国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-3-3
6	关于增加申万宏源证券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、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-3-14
7	国海富兰克林基金管理有限公司关于基金经理结束产假恢复履行职务的公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-3-14
8	国海富兰克林基金管理有限公司关于在直销柜台开展旗下部分基金申购、转换费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-3-21
9	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-3-21
10	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金分红公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-3-23
11	国海富兰克林基金管理有限公司关于北京分公司办公地址变更公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-3-24
12	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金恢复大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-3-28
13	国海富兰克林基金管理有限公司 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-3-31
14	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-3-31
15	国海富兰克林基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-4-6
16	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指定网站	2022-4-22
17	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-4-22
18	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加广发证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-5-13
19	关于增加国联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	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-5-20

20	国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-6-3
21	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-6-15
22	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金分红公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-6-17
23	国海富兰克林基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-6-20
24	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金恢复大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-6-22
25	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金更新招募说明书（2022 年 1 号）	中国证监会规定报刊及指定网站	2022-6-30

## § 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	20220101-20220630	173,046,042.96	5,270,618.82	-	178,316,661.78	32.49
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。</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>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>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金资产可投资于科创板股票和北京证券交易所股票，会面临科创板 and 北京证券交易所机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于公司治理风险、流动性风险、退市风险、股价波动风险、中小企业经营风险、投资集中风险、系统性风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票、北京证券交易所股票或选择不将基金资产投资于科创板股票、北京证券交易所股票，基金资产并非必然投资于科创板股票、北京证券交易所股票。

## § 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强化收益债券型证券投资基金设立的文件
- 2、《富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、《富兰克林国海强化收益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

2022 年 8 月 31 日