

富兰克林国海恒利债券型证券投资基金  
(LOF)  
2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 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>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>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	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
<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 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	40

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 .....	40
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 .....	40
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 .....	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	40
7.12 投资组合报告附注 .....	41
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
8.4 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 .....	42
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>42</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	43
10.4 基金投资策略的改变 .....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
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 .....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	44
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>45</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 .....	45
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>46</b>
12.1 备查文件目录 .....	46
12.2 存放地点 .....	46
12.3 查阅方式 .....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）	
基金简称	国富恒利债券（LOF）	
场内简称	国富恒利债券 LOF	
基金主代码	164509	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2014 年 3 月 10 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	692,429,263.63 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2017 年 4 月 7 日	
下属分级基金的基金简称	国富恒利债券（LOF）A	国富恒利债券（LOF）C
下属分级基金的场内简称	国富恒利债券 LOF	
下属分级基金的交易代码	164509	164510
报告期末下属分级基金的份额总额	642,961,776.56 份	49,467,487.07 份

注：本基金合同生效日为 2014 年 3 月 10 日，本基金 3 年分级运作期届满日为 2017 年 3 月 10 日，根据基金合同规定，于 2017 年 3 月 10 日自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）”，2017 年 3 月 11 日为本基金转型后的首个运作日。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在追求基金资产稳定增值、有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
------	---

投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法，灵活运用利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、相对价值判断等多重投资策略，构建债券投资组合，力求实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中债综合指数（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	fxjd_hq@bank-of-china.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	葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街27号投资广场23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(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	国富恒利债券（LOF）A	国富恒利债券（LOF）C
本期已实现收益	7,003,994.35	24,402.96
本期利润	9,288,784.58	74,661.36

加权平均基金份额本期利润	0.0121	0.0304
本期加权平均净值利润率	1.35%	2.89%
本期基金份额净值增长率	1.58%	1.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	145,207,419.50	6,965,698.86
期末可供分配基金份额利润	0.2258	0.1408
期末基金资产净值	582,913,264.31	52,319,319.46
期末基金份额净值	0.9066	1.0577
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	26.36%	24.12%

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

国富恒利债券（LOF）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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

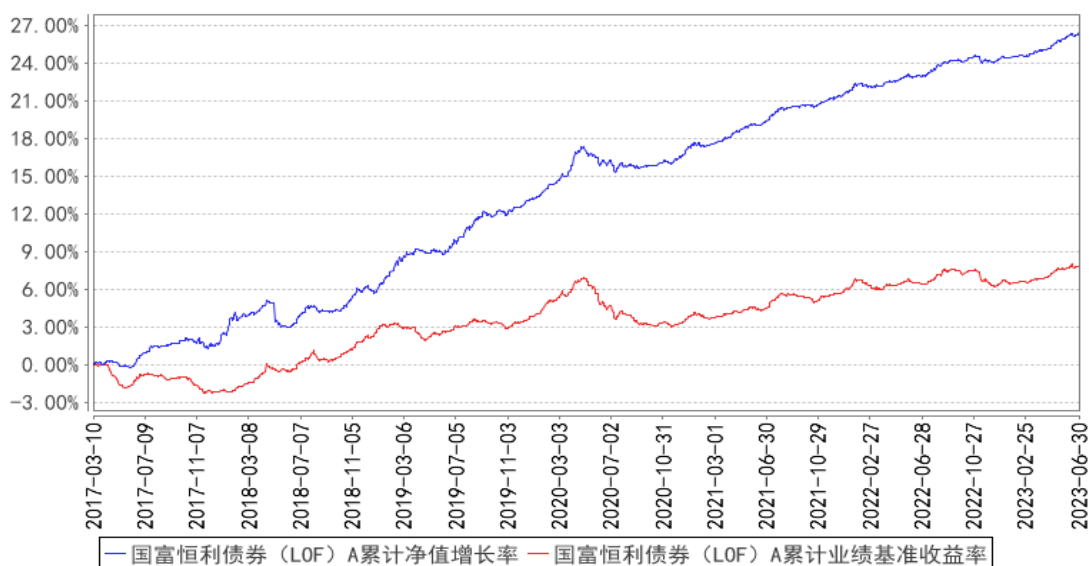
过去一个月	0.28%	0.04%	0.18%	0.05%	0.10%	-0.01%
过去三个月	1.09%	0.03%	0.94%	0.04%	0.15%	-0.01%
过去六个月	1.58%	0.03%	1.22%	0.04%	0.36%	-0.01%
过去一年	2.72%	0.04%	1.35%	0.05%	1.37%	-0.01%
过去三年	8.73%	0.04%	2.99%	0.05%	5.74%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	26.36%	0.08%	7.85%	0.06%	18.51%	0.02%

国富恒利债券 (LOF) 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	0.25%	0.04%	0.18%	0.05%	0.07%	-0.01%
过去三个月	1.00%	0.03%	0.94%	0.04%	0.06%	-0.01%
过去六个月	1.40%	0.03%	1.22%	0.04%	0.18%	-0.01%
过去一年	2.13%	0.04%	1.35%	0.05%	0.78%	-0.01%
过去三年	7.35%	0.04%	2.99%	0.05%	4.36%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	24.12%	0.08%	7.85%	0.06%	16.27%	0.02%

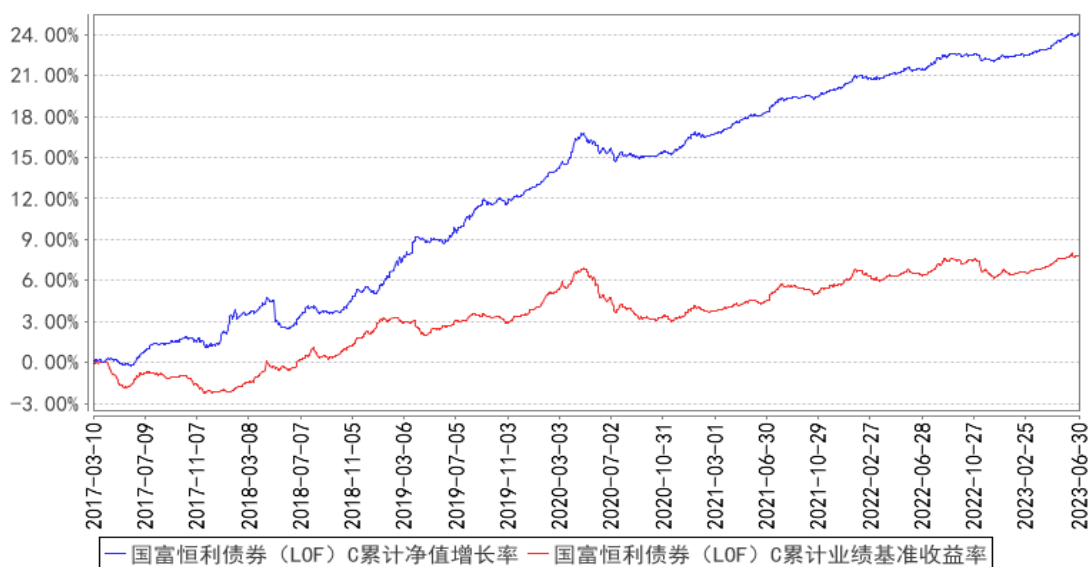
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国富恒利债券 (LOF) 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





国富恒利债券（LOF）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：本基金已在转换基准日 2017 年 3 月 10 日日终转换为上市开放式基金（LOF）。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 2023 年 6 月 30 日，公司旗下合计管理 42 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	公司固定	2015 年	-	19 年	刘怡敏女士，CFA，四川大学金融学硕士。

敏	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	11 月 28 日			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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）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

上半年宏观经济修复总体不及预期。一季度，宏观经济低位复苏的态势。随着疫情防控政策优化调整，国内生产和消费活动均有不同程度的复苏。进入二季度，经济修复动能有所减弱。从已公布的经济数据来看，一、二季度 GDP 增速分别为 4.5%、6.3%。消费、工业生产以及投资增速在二季度的环比均有不同程度的放缓。1-6 月，社会消费品零售总额同比增长 3.3%，固定资产投资累计同比增长 3.8%，其中，房地产开发投资累计下降 7.9%。1-6 月，商品房累计销售面积持续疲软，新开工同比降幅较大。总的来看，疫情放开之后经济修复动能在一季度释放之后，二季度以来内需疲软的现象较为突出。

上半年，国际政治经济形势的动荡多变，中美关系的复杂变局引人关注。上半年，美国经济显示超预期的韧性，通胀高企，就业形势大超预期，美联储继续实施加息。我国央行实施降息降准等进一步放松的政策，中美两国国债利率深度倒挂。受中美经济周期不同步的影响，上半年，人民币汇率兑美元的汇率大幅贬值。经济复苏预期落空，叠加稳增长政策姗姗来迟，上半年股票指数表现平平，万德全 A 先涨后跌，总体上涨 3.2%，沪深 300 下跌 0.75%。盈利确定性高、低估值高分红的品种受到投资者青睐。由于宏观基本面走弱，缺乏确定性收益品种，债市配置需求集中释放。上半年中债总财富指数上涨 1.86%，中债信用债总财富指数上涨 1.24%。一季度，基金在资金较为紧张阶段增加短端利率债配置，杠杆率有所上升，战胜了比较基准。二季度，随着收益率的快速下行，短端利率反映了降息后的资金价格，中长端曲线各期限段价值较为均衡，反映市场对投资机会的挖掘较充分。基金择机减持了部分短久期的利率债品种，杠杆率有所下降。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 0.9066 元，本报告期份额净值上涨 1.58%，同期业绩比较基准上涨 1.22%，跑赢业绩比较基准 0.36%；本基金 C 类份额净值为 1.0577 元，本报告期份额净值上涨 1.40%，同期业绩比较基准上涨 1.22%，跑赢业绩比较基准 0.18%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济修复动能不足的问题在二季度有所体现，生产、需求、价格三大指标同时走弱，企业对未来经济增长的持续性和回报率的能见度较低，选择了收缩投资回笼现金，以应对不确定性。同时，结构性失业的问题突出，16-24 岁调查失业率达到 21.3%，居民可支配收入的下降导致消费支出的缩减。受地产行业景气度持续下行的影响，房地产企业开工和拿地积极性大幅降低，土地拍卖市场遇冷，尤其是三四线城市，房地产市场的供需矛盾较为突出。广义财政收入的下滑带动上半年财政支出不及预期。

二季度以来，市场对于经济增长的担忧较为突出，也包括一部分经济学家认为中国可能出现日本式资产负债表衰退。在这样的背景下，二季度股债走势出现明显的背离。上市公司盈利水平下降，主要股指走势一波三折，总体下跌。债券收益率曲线则持续下行，30-10 年国债利差极度变窄，低于 16 年低点水平，随着 30 年逼近历史低点，反映了市场对经济增长长期增速的悲观预期。

市场较为关注中长期增长的逻辑，对短期经济基本面的变化等因素关注度较低。当前宏观经济逐步出现一些积极因素，经过持续去库存，社会总库存水平处于低位，未来可能出现企业补库存而带动需求的回升。美国加息接近尾声，海外需求韧性超预期，大宗商品价格存在反弹动能。我国 PPI 在下半年或将见底回升，有望降低社会面的通缩预期，提高企业盈利能力。从政策面来看，一系列支撑经济稳中向好的举措正在紧锣密鼓的研究和制定。

下半年预计货币政策短期或将维持宽松，债券总体收益率仍将维持低位，个别时间点可能受政策预期的影响出现波动放大。策略上，重视低息环境下的票息收入，综合采取期限利差分析、骑乘收益分析、安全边际分析等方法，整体在低收益环境下提高组合的 ALPHA 收益。

基金继续按照基金合同及相关法律法规要求，做好行业的配置，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

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

#### 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”）在富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）（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：富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	531,811.60	1,170,915.55
结算备付金		9,003.69	1,588,442.27
存出保证金		385.07	865.85
交易性金融资产	6.4.7.2	674,306,772.09	1,175,773,748.58
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		674,306,772.09	1,175,773,748.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		80,009,755.69	17,164.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		754,857,728.14	1,178,551,136.96
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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		91,049,139.20	6,002,574.84
应付清算款		-	-
应付赎回款		28,279,882.52	16,920.17
应付管理人报酬		131,275.79	327,679.77
应付托管费		43,758.60	109,226.57
应付销售服务费		1,156.45	615.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	119,931.81	222,727.38
负债合计		119,625,144.37	6,679,743.88
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	478,417,490.31	886,734,667.56
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	156,815,093.46	285,136,725.52
净资产合计		635,232,583.77	1,171,871,393.08
负债和净资产总计		754,857,728.14	1,178,551,136.96

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 692,429,263.63 份，其中国富恒利债券（LOF）A 基金份额净值 0.9066 元，基金份额总额 642,961,776.56 份；国富恒利债券（LOF）C 基金份额净值 1.0577 元，基金份额总额 49,467,487.07 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		11,471,565.09	13,036,488.97
1. 利息收入		576,943.71	161,943.66
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,962.13	20,653.46
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		547,981.58	141,290.20
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,333,726.07	14,656,529.09
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	8,333,726.07	14,656,529.09
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,335,048.63	-1,867,598.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	225,846.68	85,614.69
<b>减：二、营业总支出</b>		2,108,119.15	2,369,227.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,055,447.42	1,323,084.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	351,815.82	441,028.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,222.77	5,889.78
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		577,432.25	481,685.84

其中：卖出回购金融资产支出		577,432.25	481,685.84
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	119,200.89	117,539.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>9,363,445.94</b>	<b>10,667,261.75</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>9,363,445.94</b>	<b>10,667,261.75</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>9,363,445.94</b>	<b>10,667,261.75</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	886,734,667.56	-	285,136,725.52	1,171,871,393.08
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	886,734,667.56	-	285,136,725.52	1,171,871,393.08
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-408,317,177.25	-	-128,321,632.06	-536,638,809.31
(一)、综合收	-	-	9,363,445.94	9,363,445.94



益总额				
（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）	-408,317,177.25	-	-137,685,078.00	-546,002,255.25
其中：1. 基金申购款	280,477,813.15	-	86,701,201.64	367,179,014.79
2 .基金赎回款	-688,794,990.40	-	-224,386,279.64	-913,181,270.04
（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）	-	-	-	-
（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）	478,417,490.31	-	156,815,093.46	635,232,583.77
项目	上年度可比期间 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 期末净资产（基	716,176,527.35	-	304,842,659.35	1,021,019,186.70

金净值)				
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)	716,176,527.35	-	304,842,659.35	1,021,019,186.70
三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “-” 号 填 列)	-156,902,554.70	-	-57,881,237.60	-214,783,792.30
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	10,667,261.75	10,667,261.75
(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)	-156,902,554.70	-	-68,548,499.35	-225,451,054.05
其中:1. 基 金 申 购 款	108,653,003.33	-	46,576,977.84	155,229,981.17
2 .基 金 赎 回 款	-265,555,558.03	-	-115,125,477.19	-380,681,035.22
(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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	559,273,972.65	-	246,961,421.75	806,235,394.40

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：

<u>徐荔蓉</u>	<u>于意</u>	<u>肖燕</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海恒利债券型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)是由富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金转型而来。根据原《富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金基金合同》，原富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金为契约型基金，基金合同生效后 3 年期届满。根据《富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金转换结果公告》，原富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金于 2017 年 3 月 10 日日终，自动转换为上市开放式基金 (LOF)，基金名称变更为“富兰克林国海恒利债券型证券投资基金 (LOF)”。本基金为契约型开放式基金，存续期间不定。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。

根据原《富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金基金合同》和原《富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金招募说明书》，根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将实施转换后的基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为富兰克林国海恒利债券型证券投资基金 (LOF) 的 A 类份额 (以下简称“国富恒利债券 (LOF)A”)；计提销售服务费、不收取申购费用，对于持有期限不少于 30 日的基金份额的赎回亦不收取赎回费，但对持有期限少于 30 日的基金份额的赎回收取赎回费的基金份额，称为国海

恒利债券型证券投资基金(LOF)的 C 类份额(以下简称“国富恒利债券(LOF)C”)。

根据原《富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金基金合同》以及本基金管理人披露的《富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金转换结果公告》，在 2017 年 3 月 10 日日终，以份额转换后 1.000 元的基金份额净值为基准，本基金管理人根据原富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金 A 类基金(以下简称“恒利 A”)份额和原富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金 B 类基金(以下简称“恒利 B”)份额的转换比例对转换基准日登记在册的基金份额实施转换。恒利 A 份额将转为富兰克林国海恒利债券型证券投资基金(LOF)场外的恒利 C 份额，场外的恒利 B 份额将转为场外的国富恒利债券(LOF)A 类份额，且均登记在注册登记系统下；场内的恒利 B 份额将转为场内的国富恒利债券(LOF)A 类份额，仍登记在证券登记结算系统下。份额转换后，基金份额持有人持有的基金份额数将按照份额转换规则相应增加或减少。根据《富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金转换结果公告》，于 2017 年 3 月 10 日日终，恒利 A 转换前基金份额总额为 20,962,375.50 份，基金份额净值为 1.000 元，转换比例为 1.00006904，转换后对应的国富恒利债券(LOF)C 类份额为 20,963,822.74 份；恒利 B 转换前场内和场外基金份额分别为 1,050,074.00 份和 112,756,356.41 份，基金份额净值为 1.481 元，转换比例分别为 1.48106434，转换后对应的国富恒利债券(LOF)A 类份额场内和场外基金份额分别为 1,555,227.00 份和 166,999,418.58 份。本基金管理人已根据《富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金基金合同》的约定，对恒利 A、恒利 B 的份额持有人的基金份额进行了计算，并由本基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2017]206 号核准，国富恒利债券(LOF)A 类份额 5,274,673.00 份(截至 2017 年 3 月 29 日)于 2017 年 4 月 7 日在深交所挂牌交易。对于托管在场外的国富恒利债券(LOF)A 类份额，基金份额持有人将其转托管至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海恒利债券型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、短期融资券、企业债、公司债、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、回购和银行定期存款等固定收益类金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金不从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场股票首次发行或新股增发，因投资可转换债券转股所得的股票、及因投资分离交易可转债而产生的权证等而持有的非固定收益类金融工具，应在其可交易的 30 个工作日内卖出。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金所持有的现金(不包括结算备付

金、存出保证金、应收申购款等)和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中债综合指数(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 2023 年 8 月 31 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海恒利债券型证券投资基金(LOF)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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税

[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	531,811.60
等于：本金	531,504.56
加：应计利息	307.04
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	531,811.60

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,049,399.00	51,799.24	2,150,600.64	49,402.40
	银行间市场	662,946,234.93	7,255,971.45	672,156,171.45	1,953,965.07
	合计	664,995,633.93	7,307,770.69	674,306,772.09	2,003,367.47
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	664,995,633.93	7,307,770.69	674,306,772.09	2,003,367.47	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	379.42
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	19,804.42
其中：交易所市场	-
银行间市场	19,804.42
应付利息	-
审计费用	31,240.60
信息披露费	59,507.37
债券账户维护费	9,000.00
合计	119,931.81

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国富恒利债券（LOF）A



项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,310,585,094.14	884,924,928.80
本期申购	350,797,900.66	236,865,367.39
本期赎回（以“-”号填列）	-1,018,421,218.24	-687,651,110.95
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	642,961,776.56	434,139,185.24

## 国富恒利债券（LOF）C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,021,790.98	1,809,738.76
本期申购	48,723,616.49	43,612,445.76
本期赎回（以“-”号填列）	-1,277,920.40	-1,143,879.45
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	49,467,487.07	44,278,305.07

注：2023 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 696,168.00 份（其中 A 类基金份额的基金份额为 696,168.00 份，C 类基金份额的基金份额为 0 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 691,733,095.63 份（其中 A 类基金份额的基金份额为 642,265,608.56 份，C 类基金份额的基金份额为 49,467,487.07 份）

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 国富恒利债券（LOF）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	283,642,889.04	1,194,603.14	284,837,492.18
本期利润	7,003,994.35	2,284,790.23	9,288,784.58
本期基金份额交易产生的变动数	-145,439,463.89	87,266.20	-145,352,197.69
其中：基金申购款	77,746,060.40	1,091,191.54	78,837,251.94
基金赎回款	-223,185,524.29	-1,003,925.34	-224,189,449.63
本期已分配利润	-	-	-

本期末	145,207,419.50	3,566,659.57	148,774,079.07
-----	----------------	--------------	----------------

## 国富恒利债券（LOF）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	266,223.83	33,009.51	299,233.34
本期利润	24,402.96	50,258.40	74,661.36
本期基金份额交易产生的变动数	6,675,072.07	992,047.62	7,667,119.69
其中：基金申购款	6,848,767.31	1,015,182.39	7,863,949.70
基金赎回款	-173,695.24	-23,134.77	-196,830.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,965,698.86	1,075,315.53	8,041,014.39

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	19,416.42
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	1,473.58
其他	8,072.13
合计	28,962.13

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	8,800,747.20
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-467,021.13
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	8,333,726.07

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,289,451,515.49
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,276,894,896.03
减：应计利息总额	13,002,099.09
减：交易费用	21,541.50
买卖债券差价收入	-467,021.13

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

无。

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	2,335,048.63
股票投资	-
债券投资	2,335,048.63

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	2,335,048.63

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	225,846.68
合计	225,846.68

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，其中 A 类份额将不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产，C 类份额将赎回费收入全额归入基金资产。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	31,240.60
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券账户维护费	18,000.00
银行汇划费用	9,852.92
其他手续费	600.00
合计	119,200.89

#### 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 2023 年 8 月 18 日宣告 2023 年度第 1 次分红，向截至 2023 年 8 月 22 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的本基金全体持有人，A 类基金份额按每 10 份基金份额派发红利 0.690 元，C 类基金份额按每 10 份基金份额派发红利 0.436

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
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。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

##### 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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,055,447.42	1,323,084.30
其中：支付销售机构的客户维护费	62,468.95	63,649.86

注：支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	351,815.82	441,028.11

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 × 0.10%/ 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富恒利债券（LOF）A	国富恒利债券（LOF）C	合计
中国银行	-	3,162.71	3,162.71
国海富兰克林基金管理有 限公司	-	479.59	479.59
合计	-	3,642.30	3,642.30
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 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		
	国富恒利债券（LOF）A	国富恒利债券（LOF）C	合计
中国银行	-	3,650.19	3,650.19
国海证券	-	0.38	0.38
合计	-	3,650.57	3,650.57

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.35%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：日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.35%/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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	国富恒利债券（LOF）A	国富恒利债券（LOF）C
基金转型后首个运作日 （2017 年 03 月 11 日）持有的 基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	4,635,060.89	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	4,635,060.89	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.72%	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	国富恒利债券（LOF）A	国富恒利债券（LOF）C
基金转型后首个运作日 （2017 年 03 月 11 日）持有的 基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	4,635,060.89	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	4,635,060.89	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.56%	-

注：1. 基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

2. 2017 年 3 月 11 日为基金转型后首个运作日。

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

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（2022 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。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	531,811.60	19,416.42	589,436.74	17,763.93

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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.10.8 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 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 2023 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 91,049,139.20 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
210406	21 农发 06	2023 年 7 月 3 日	103.26	32,000	3,304,245.48
220322	22 进出 22	2023 年 7 月 3 日	102.03	500,000	51,012,534.25
239936	23 贴现国债 36	2023 年 7 月 6 日	99.68	450,000	44,853,814.28



合计				982,000	99,170,594.01
----	--	--	--	---------	---------------

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于较低风险收益特征的证券投资基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要为固定收益证券品种。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于货币型基金而低于混合型和股票型基金，谋求稳定和可持续的长期收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险控制部负责投资风险管理与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的分析报告，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时对各种风险进行监控和评估，并通过风险处置流程，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

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。

#### 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	75,753,108.57	-
合计	75,753,108.57	-

注：1. 本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

2. 未评级债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的信用债。

3. 债券投资以全价列示。

#### 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	598,553,663.52	-
合计	598,553,663.52	-

注：1. 本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

2. 未评级债券为期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的信用债。

3. 债券投资以全价列示。

#### 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 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款将在 1 个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约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上市公司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 2023 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 2023 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 2023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	531,811.60	-	-	-	531,811.60
结算备付金	9,003.69	-	-	-	9,003.69
存出保证金	385.07	-	-	-	385.07
交易性金融资产	176,755,594.91	480,266,503.92	17,284,673.26	-	674,306,772.09
应收申购款	-	-	-	80,009,755.69	80,009,755.69
资产总计	177,296,795.27	480,266,503.92	17,284,673.26	80,009,755.69	754,857,728.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	28,279,882.52	28,279,882.52
应付管理人报酬	-	-	-	131,275.79	131,275.79
应付托管费	-	-	-	43,758.60	43,758.60
卖出回购金融资产款	91,049,139.20	-	-	-	91,049,139.20
应付销售服务费	-	-	-	1,156.45	1,156.45
其他负债	-	-	-	119,931.81	119,931.81
负债总计	91,049,139.20	-	-	28,576,005.17	119,625,144.37
利率敏感度缺口	86,247,656.07	480,266,503.92	17,284,673.26	51,433,750.52	635,232,583.77
上年度末 2022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	1,170,915.55	-	-	-	1,170,915.55
结算备付金	1,588,442.27	-	-	-	1,588,442.27
存出保证金	865.85	-	-	-	865.85
交易性金融资产	716,059,805.40	439,605,689.04	20,108,254.14	-	1,175,773,748.58
应收申购款	-	-	-	17,164.71	17,164.71
资产总计	718,820,029.07	439,605,689.04	20,108,254.14	17,164.71	1,178,551,136.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	16,920.17	16,920.17
应付管理人报酬	-	-	-	327,679.77	327,679.77
应付托管费	-	-	-	109,226.57	109,226.57
卖出回购金融资产款	6,002,574.84	-	-	-	6,002,574.84
应付销售服务费	-	-	-	615.15	615.15
其他负债	-	-	-	222,727.38	222,727.38
负债总计	6,002,574.84	-	-	677,169.04	6,679,743.88
利率敏感度缺口	712,817,454.23	439,605,689.04	20,108,254.14	-660,004.33	1,171,871,393.08

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	增加约 323	增加约 384
	2. 市场利率上升 25 个基点	减少约 320	减少约 380

#### 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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

## 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	674,306,772.09	1,175,773,748.58
第三层次	-	-
合计	674,306,772.09	1,175,773,748.58

#### 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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	674,306,772.09	89.33
	其中：债券	674,306,772.09	89.33
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	540,815.29	0.07
8	其他各项资产	80,010,140.76	10.60
9	合计	754,857,728.14	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未通过港股通交易机制投资港股。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

本基金本报告期内未投资股票。

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

本基金本报告期内未投资股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	85,752,403.65	13.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	588,554,368.44	92.65
	其中：政策性金融债	588,554,368.44	92.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	674,306,772.09	106.15

注：基金管理人持对持仓债券期限结构进行分析和测算。截至 2023 年 6 月末，持仓债券平均久期 1.84 年，久期 1 年以内的债券 19769.37 万元，占比 29.32%；久期 1 年至 3 年的债券 34620.13 万元，占比 51.34%；久期 3 年至 5 年的债券 11312.71 万元，占比 16.78%；久期 5 年至 7 年的债券 999.93 万元，占比 1.48%；久期 7 年至 10 年的债券 617.65 万元，占比 0.92%；久期 10 年至 20 年的债券 110.89 万元，占比 0.16%。

#### 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	239936	23 贴现国债 36	760,000	75,753,108.57	11.93
2	190409	19 农发 09	500,000	52,009,712.33	8.19
3	220322	22 进出 22	500,000	51,012,534.25	8.03
4	220207	22 国开 07	500,000	50,837,739.73	8.00
5	210303	21 进出 03	500,000	50,766,065.57	7.99

#### 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 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同，本基金不投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同，本基金不投资国债期货。



### 7.11.2 本期国债期货投资评价

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	385.07
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	80,009,755.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	80,010,140.76

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
国富恒利 债券 (LOF) A	438	1,467,949.26	637,693,453.72	99.18	5,268,322.84	0.82
国富恒利	621	79,657.79	47,334,781.41	95.69	2,132,705.66	4.31

债券 (LOF) C						
合计	1,059	653,852.00	685,028,235.13	98.93	7,401,028.50	1.07

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

### 国富恒利债券（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	李红	256,869.00	36.90
2	苏洋林	98,636.00	14.17
3	滕艾	51,600.00	7.41
4	钱中明	42,545.00	6.11
5	张荣斌	29,047.00	4.17
6	杨一木	21,300.00	3.06
7	杨桂远	20,500.00	2.94
8	钱伟雄	20,000.00	2.87
9	徐金娣	19,948.00	2.87
10	樊怡君	16,106.00	2.31

注：持有人为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	国富恒利债券（LOF）A	1,356.38	0.000211
	国富恒利债券（LOF）C	9.47	0.000019
	合计	1,365.85	0.000197

## 8.4 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、基金投资和研究人员持有本开放式基金	国富恒利债券（LOF）A	0~10
	国富恒利债券（LOF）C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国富恒利债券（LOF）A	0~10
	国富恒利债券（LOF）C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富恒利债券（LOF）A	国富恒利债券（LOF）C
基金转型后首个运作日（2017年03月11日）	168,554,645.58	20,963,822.74

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	1, 310, 585, 094. 14	2, 021, 790. 98
本报告期基金总申购份额	350, 797, 900. 66	48, 723, 616. 49
减: 本报告期基金总赎回份额	1, 018, 421, 218. 24	1, 277, 920. 40
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	642, 961, 776. 56	49, 467, 487. 07

注: 2017 年 3 月 11 日为基金转型后首个运作日。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (一) 基金管理人重大人事变动

本报告期内, 本基金基金管理人无重大人事变动。

#### (二) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内, 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 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 (%)	
国海证券	2	-	-	-	-	-

注：管理人对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其他相关因素后决定的。报告期内，本基金交易单元无变更。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国海证券	2,049,399.00	100.00	135,000,000.00	100.00	-	-

## 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	富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）2022 年第四季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 1 月 20 日
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规定网站	2023 年 1 月 20 日
3	关于增加万家财富基金销售（天津）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规定网站	2023 年 2 月 8 日
4	关于增加上海万得基金销售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规定网站	2023 年 2 月 14 日
5	关于增加国金证券股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换业务、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规定网站	2023 年 2 月 18 日
6	国海富兰克林基金管理有限公司旗下	中国证监会规定报刊及	2023 年 3 月 31 日

	全部基金年度报告提示性公告	规定网站	
7	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加兴业证券股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 3 月 31 日
8	富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）2022 年年度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 3 月 31 日
9	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加南京证券股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 4 月 12 日
10	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 4 月 22 日
11	富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）2023 年第一季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 4 月 22 日
12	关于增加中国中金财富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规定网站	2023 年 6 月 26 日
13	富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）（国富恒利债券（LOF）A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 6 月 27 日
14	富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）（国富恒利债券（LOF）C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 6 月 27 日
15	富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2023 年 1 号）	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 6 月 30 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 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	20230101-20230630	346,710,498.34	-	-	346,710,498.34	50.07
	2	20230206-20230306	203,003,451.08	-	203,003,451.08	-	-
产品特有风险							
1. 流动性风险							

投资者大额赎回所持有的基金份额时，为了实现基金资产的迅速变现，在基金交易过程中可能存在无法实现交易价格最优；亦或导致基金仓位调整困难，基金资产不能迅速转变成现金，产生流动性风险。

一旦引发巨额赎回，当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，可能出现比例赎回、延期支付赎回款等情形。

管理人有权根据本基金合同和招募说明书的约定，基于投资者保护原则，暂停或拒绝申购、暂停赎回。

## 2. 估值风险

投资者大额赎回所持有的基金份额时，基金份额净值可能受到尾差和部分赎回费归入基金资产的影响，从而导致非市场因素的净值异常波动。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金设立的文件（于 2017 年 3 月 10 日自动转换为上市开放式基金 (LOF)，基金名称变更为“富兰克林国海恒利债券型证券投资基金 (LOF)）

2、《富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）基金合同》

3、《富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）招募说明书》

4、《富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）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

2023 年 8 月 31 日