

富兰克林国海强化收益债券型证券投资基  
金  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>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	12
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	13
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	13
<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内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<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	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43

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 .....	43
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 .....	43
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 .....	43
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.11 投资组合报告附注 .....	44
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	46
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</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 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	52

## § 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	209,280,787.76 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	188,262,436.09 份	21,018,351.67 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	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。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。在股票投资上，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。在可转债投资策略上，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。
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	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	南宁高新区中国-东盟企业总部基地三期综合楼 A 座 17 层 1707 室	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国海富兰克林基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 8 号 上海国金中心二期 9 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	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	-373,908.74	147,819.24
本期利润	8,015,686.25	511,354.37
加权平均基金份额本期利润	0.0254	0.0229
本期加权平均净值利润率	2.45%	2.21%
本期基金份额净值增长率	2.36%	2.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
	2,430,352.81	167,279.63
期末可供分配利		

润		
期末可供分配基金份额利润	0.0129	0.0080
期末基金资产净值	198,403,338.12	22,064,807.63
期末基金份额净值	1.0539	1.0498
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	120.03%	105.33%

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	-0.26%	0.12%	0.72%	0.04%	-0.98%	0.08%
过去三个月	1.24%	0.14%	0.98%	0.09%	0.26%	0.05%
过去六个月	2.36%	0.16%	2.24%	0.09%	0.12%	0.07%
过去一年	1.06%	0.15%	3.05%	0.08%	-1.99%	0.07%
过去三年	4.57%	0.19%	6.26%	0.08%	-1.69%	0.11%
自基金合同生效起至今	120.03%	0.22%	17.63%	0.11%	102.40%	0.11%

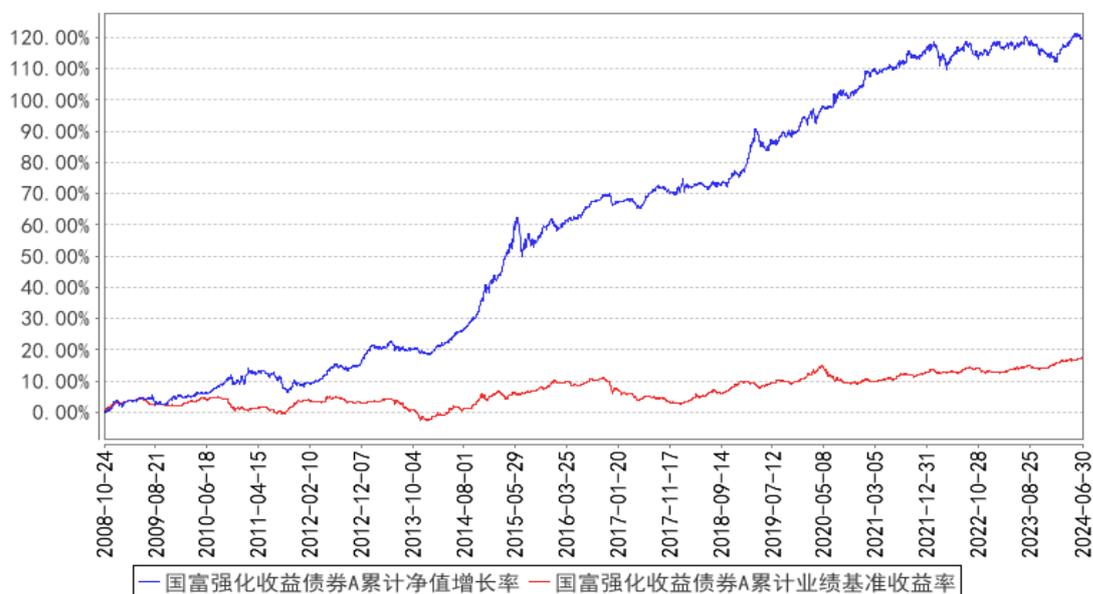
国富强化收益债券 C

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

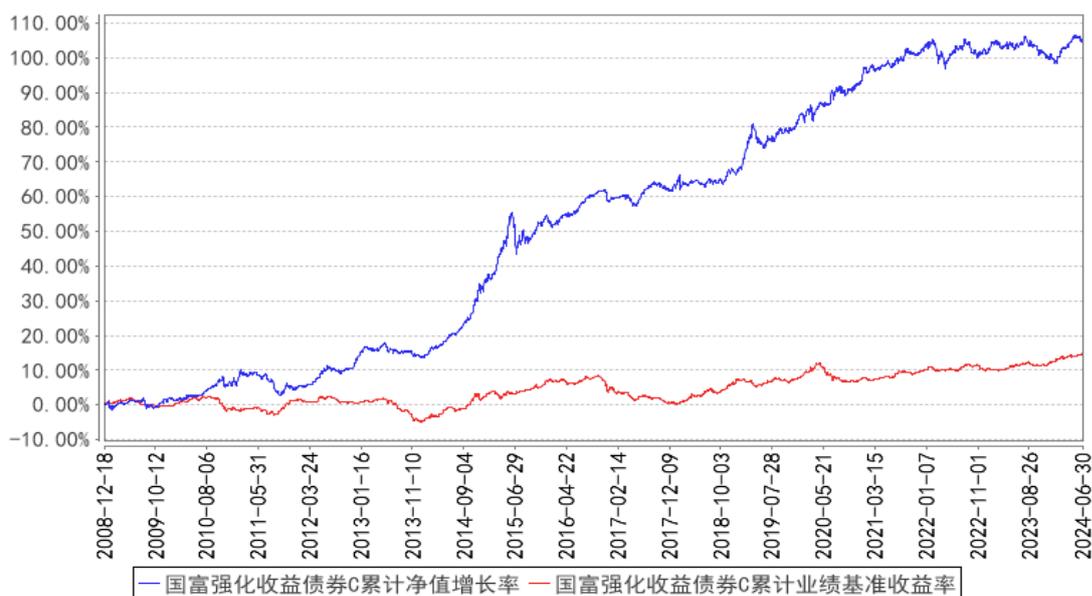
	率①	准差②		④		
过去一个月	-0.28%	0.12%	0.72%	0.04%	-1.00%	0.08%
过去三个月	1.18%	0.14%	0.98%	0.09%	0.20%	0.05%
过去六个月	2.21%	0.16%	2.24%	0.09%	-0.03%	0.07%
过去一年	0.76%	0.15%	3.05%	0.08%	-2.29%	0.07%
过去三年	3.64%	0.19%	6.26%	0.08%	-2.62%	0.11%
自增设 C 类份额至今	105.33%	0.22%	14.87%	0.10%	90.46%	0.12%

### 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 日增设 C 类份额。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国海富兰克林基金管理有限公司成立于 2004 年 11 月，由国海证券股份有限公司和富兰克林邓普顿投资集团全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建，国海证券股份有限公司持有 51% 的股份，邓普顿国际股份有限公司持有 49% 的股份。目前公司注册资本 2.2 亿元人民币。

国海证券股份有限公司是国内 A 股市场第 16 家上市券商，是拥有全业务牌照，营业网点遍布中国主要城市的全国性综合类证券公司。富兰克林邓普顿投资集团是世界知名基金管理公司，在全球市场具备超过 76 年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿投资集团享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系，借助国海证券股份有限公司的综合业务优势，力争成为国内一流的基金管理公司。

国海富兰克林基金管理有限公司具有丰富的基金管理经验，截至 2024 年 6 月末，公司旗下合计管理 47 只公募基金产品。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘怡	公司固定	2008 年	-	20 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	10月24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债券型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内公司严格执行《公平交易管理制度》，明确了公平交易的原则和目标，制订了实现公平交易的具体措施，并在技术上按照公平交易原则实现了严格的交易公平分配。

报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。

报告期内公司不存在投资组合之间发生的同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年宏观经济修复动能总体趋缓，经济活力在一定程度上体现出收缩压力。总体来看，出口部门表现亮眼，净出口拉动我国 GDP 增长 0.7 个百分点，大幅超越去年全年的-0.59%，净出口对实际 GDP 的贡献率为 13.9%。我们认为，净出口的强劲增长，一方面得益于全球制造业活动回升，带动出口需求走强，但更为重要的是，反应了中国制造在全球突出的竞争优势，经过长期现代化工业体系打造，我国制造业积累了成熟的经验，建造了优秀的产业集群，因此获得国际市场份额提升的反哺。上半年，国内内需增速乏善可陈，总体处于调整过程。房地产业对 GDP 的影响，新质生产力虽然有所提升，但是其对经济增长的支撑作用尚不足以弥补传统的消费和地产行业下滑带来的挑战。

货币政策方面，上半年央行主要在社融存量进行结构调整，在总量放松上则保持了较为平缓的节奏，仅在 2 月份下调一次存款准备金率。央行在压降银行存款成本上屡屡出手，旨在盘活存量信贷，打击资金空转套利。Q2 取消银行存款手工补息，使得银行存款在二季度出现集中流出。流动性从银行体系向非银体系转移，非银主体资金充沛，资产欠配严重，因此也拉动了一轮债市的配置行情。

上半年债市表现亮眼。一方面国内经济并未出现预期中的修复现象，另一方面，传统行业融资需求回落，信用债及政府债均同比缩量发行，机构配置需求上升进一步加剧供需结构的不平衡，债券收益率大幅下行。一季度，主要是银行类机构大力配置，二季度，随着手工补息取消和资金脱媒，非银金融机构接续存款类机构成为债券配置主力。上半年央行多次提示超长债风险，在一定程度上抑制了债券市场尤其是超长债的快速上涨，收益率曲线有所增陡。上半年股市整体呈现弱势震荡的走势，年初大幅下跌后快速反弹，结构性机会较多。总体看，高股息资产表现较好，海外大模型及下游应用的发展推动国内算力及消费电子相关个股走出一波行情。

报告期内，本基金保持了较高的债券仓位，积极投资于中长期利率债及信用债。一季度，随着市场下跌，我们提高可转债仓位，在 4-5 月反弹中获取较好的投资回报。6 月转债市场有所回调，组合出现获益回吐，但总体在转债投资取得了正向回报。权益方面则保持了较为谨慎的持仓结构，继续重点配置估值处于底部水平，且盈利能力较强的个股、力争从中长期维度争取更好的投资回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 06 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0539 元，本报告期份额净值上涨 2.36%，同期业绩比较基准上涨 2.24%，跑赢业绩比较基准 0.12%；本基金 C 类份额净值为 1.0498 元，本

报告期份额净值上涨 2.21%，同期业绩比较基准上涨 2.24%，跑输业绩比较基准 0.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在过去半年时间内，我们看到经济修复动能不足的问题继续有所体现，结构不平衡的问题有所凸显。净出口对国内经济拉动贡献度的上升，内需贡献度显著下降，我国经济对外依赖度显著提升。1-6 月，消费对 GDP 的贡献率从去年的 82.5% 下滑至上半年 60.5%，投资对 GDP 的贡献率从去年的 28.9% 下滑至上半年的 25.6%。这种经济结构的变化对我国经济长期增长动能的独立性和稳定性带来一定的挑战。从产业的角度来看，房地产、金融等行业的贡献度下降，房地产对 GDP 的贡献度从去年的 -1.5% 下滑到 -6.6%，金融业对 GDP 的贡献度从去年的 10.8% 下降到 8.3%。新质生产力对 GDP 的贡献率有所提升，但是升幅有限。我们注意到，房地产市场的调整和下降经过最陡峭的阶段，随着政府积极推进去库存稳需求，部分城市和地区房地产销售情况开始好转，房地产整体销售降幅有望逐步缩窄。去年下半年以来，中央政府推动化债和增发国债，并且在未来五年持续进行国债的增发，将有利于托底经济增速，提升宏观杠杆率和稳定预期。但我们也关注到当前仍存在新旧经济动能转换中，长期增长动能的缺位；地缘政治形势复杂；海外逆全球化趋势下，产业链上下游面临内外挤压；地方政府债务处置以及带来的安全和发展平衡等问题。国内外形势对决策层提出了更为严峻的考验，对投资者的眼光和能力也提出了很高的要求。中国完善有竞争力的产业链和广阔的市场需求空间，已经在过往数次周期之中帮助中国经济展现出较强的韧性，我们相信未来仍大有可为。同时，政府在稳定内需方向持续发力也将是未来经济修复的必要基础。

在投资策略上，由于债券市场受到较强的政策牵引，我们将关注政策指向谨慎而合理的构建组合的品类和期限，力争在控制回撤的基础上扩大投资收益。当前，权益市场的估值水平降至历史相对低位，我们将会继续挖掘经营业绩优秀，在行业中具备竞争优势、盈利能力和潜在分红能力的公司。同时，对于在全球具备竞争优势的产业和下一阶段政策稳内需受益的行业和公司将保持重点关注。当前市场对偏权益资产相当悲观，叠加季末时点评级调整压力，可转债出现深幅调整。报告期内组合对可转债保持了严格的筛选，对于面临较大的经营风险和偿债压力的个券，我们将继续回避。但我们也注意到随着大量可转债跌至债底附近，其中不乏稳健经营具备穿越周期的能力的企业，拉长维度看，这部分可转债将提供可观的投资回报。我们仍将着力挖掘该类投资机会。本基金将继续做好投资工作，力争获取较好的收益。

#### 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产:</b>			
货币资金	6.4.7.1	3,561,443.79	524,529.25
结算备付金		3,299,114.82	3,310,385.89
存出保证金		86,929.23	62,124.77
交易性金融资产	6.4.7.2	212,884,495.62	648,501,815.68
其中: 股票投资		26,539,146.51	94,504,250.21
基金投资		-	-
债券投资		186,345,349.11	553,997,565.47
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	2,000,360.00	46,515,034.87
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		7,820,788.80	962,847.77
应收股利		-	-
应收申购款		6,659.41	12,027.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		229,659,791.67	699,888,765.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		8,001,519.84	44,286,207.06
应付清算款		-	804,184.62
应付赎回款		15,797.55	149,220.30
应付管理人报酬		108,655.00	387,843.64
应付托管费		36,218.33	129,281.20
应付销售服务费		5,434.80	6,323.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		836,881.52	843,759.10
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.9	187,138.88	460,951.57
负债合计		9,191,645.92	47,067,770.54
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	209,280,787.76	634,091,674.26
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	11,187,357.99	18,729,320.51
净资产合计		220,468,145.75	652,820,994.77
负债和净资产总计		229,659,791.67	699,888,765.31

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 209,280,787.76 份，其中国富强化收益债券 A 基金份额净值 1.0539 元，基金份额总额 188,262,436.09 份；国富强化收益债券 C 基金份额净值 1.0498 元，基金份额总额 21,018,351.67 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		10,380,081.37	16,550,275.14
1. 利息收入		86,893.48	228,464.51
其中：存款利息收入	6.4.7.13	31,292.59	30,928.37
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		55,600.89	197,536.14
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,494,212.55	25,433,061.31
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-7,964,618.65	5,446,548.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	9,116,749.20	18,488,051.18
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	342,082.00	1,498,461.86
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	8,753,130.12	-9,125,681.77
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	45,845.22	14,431.09
<b>减: 二、营业总支出</b>		<b>1,853,040.75</b>	<b>4,600,879.02</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,047,555.66	3,115,926.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	349,185.19	1,038,642.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	34,552.17	39,295.93
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		289,382.28	267,536.69
其中: 卖出回购金融资产支出		289,382.28	267,536.69
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		4,397.76	12,418.19
8. 其他费用	6.4.7.23	127,967.69	127,059.00
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>8,527,040.62</b>	<b>11,949,396.12</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		<b>8,527,040.62</b>	<b>11,949,396.12</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>8,527,040.62</b>	<b>11,949,396.12</b>

### 6.3 净资产变动表

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: 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	634,091,674.26	-	18,729,320.51	652,820,994.77
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	634,091,674.26	-	18,729,320.51	652,820,994.77
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-424,810,886.50	-	-7,541,962.52	-432,352,849.02
(一)、综合收益	-	-	8,527,040.62	8,527,040.62

总额				
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-424,810,886.50	-	-16,069,003.14	-440,879,889.64
其中:1.基金申购款	68,332,797.27	-	2,846,227.47	71,179,024.74
2.基金赎回款	-493,143,683.77	-	-18,915,230.61	-512,058,914.38
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	209,280,787.76	-	11,187,357.99	220,468,145.75
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	928,726,069.91	-	87,706,655.45	1,016,432,725.36
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	928,726,069.91	-	87,706,655.45	1,016,432,725.36
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-24,295,610.73	-	-20,147,660.60	-44,443,271.33
(一)、综合收益总额	-	-	11,949,396.12	11,949,396.12
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-24,295,610.73	-	-1,155,360.13	-25,450,970.86

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	80,805,390.91	-	8,234,182.60	89,039,573.51
2. 基金赎回款	-105,101,001.64	-	-9,389,542.73	-114,490,544.37
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-30,941,696.59	-30,941,696.59
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	904,430,459.18	-	67,558,994.85	971,989,454.03

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，本基金主要投资于国债、金融债、央行票据、信用等级为投资级以上的企业债、公司债和短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益证券品种。本基金也可投资于非固定收益类金融工具，可以参与一级市场新股申购，也可以直接投资于二级市场的股票。本基金不直接通过二级市场买入权证，可持有股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券类品种。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%；本基金投资于固定收益类资产以外的其它资产(包括股票、存托凭证、权证等)的比例不超过基金资产的 20%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2024 年 8 月 31 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	3,561,443.79
等于：本金	3,560,983.90
加：应计利息	459.89
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	3,561,443.79

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		26,704,142.77	-	26,539,146.51	-164,996.26
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	91,225,757.49	731,364.71	93,223,751.77	1,266,629.57
	银行间市场	91,326,344.07	818,437.34	93,121,597.34	976,815.93
	合计	182,552,101.56	1,549,802.05	186,345,349.11	2,243,445.50
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		209,256,244.33	1,549,802.05	212,884,495.62	2,078,449.24

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000,360.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,000,360.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

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

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11.76
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	86,131.58
其中：交易所市场	76,322.76
银行间市场	9,808.82
应付利息	-
审计费用	32,323.20
信息披露费	59,672.34
债券账户维护费	9,000.00
合计	187,138.88

## 6.4.7.10 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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	610,021,815.82	610,021,815.82
本期申购	68,218,727.80	68,218,727.80

本期赎回（以“-”号填列）	-489,978,107.53	-489,978,107.53
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	188,262,436.09	188,262,436.09

## 国富强化收益债券 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,069,858.44	24,069,858.44
本期申购	114,069.47	114,069.47
本期赎回（以“-”号填列）	-3,165,576.24	-3,165,576.24
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	21,018,351.67	21,018,351.67

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 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
上年度末	1,191,822.65	16,886,156.98	18,077,979.63
本期期初	1,191,822.65	16,886,156.98	18,077,979.63
本期利润	-373,908.74	8,389,594.99	8,015,686.25
本期基金份额交易产生的变动数	1,612,438.90	-17,565,202.75	-15,952,763.85
其中：基金申购款	-767,947.99	3,611,019.02	2,843,071.03
基金赎回款	2,380,386.89	-21,176,221.77	-18,795,834.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,430,352.81	7,710,549.22	10,140,902.03

## 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
上年度末	-32,912.45	684,253.33	651,340.88
本期期初	-32,912.45	684,253.33	651,340.88
本期利润	147,819.24	363,535.13	511,354.37
本期基金份额交易产生的变动数	52,372.84	-168,612.13	-116,239.29

其中：基金申购款	-1,285.08	4,441.52	3,156.44
基金赎回款	53,657.92	-173,053.65	-119,395.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	167,279.63	879,176.33	1,046,455.96

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		12,290.76
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		18,250.46
其他		751.37
合计		31,292.59

#### 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

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-7,964,618.65
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		-7,964,618.65

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		169,049,423.26
减：卖出股票成本总额		176,663,394.53
减：交易费用		350,647.38
买卖股票差价收入		-7,964,618.65

#### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入		4,448,422.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券		4,668,327.14

到期兑付) 差价收入	
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	9,116,749.20

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	879,831,360.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	866,185,265.68
减：应计利息总额	8,952,364.77
减：交易费用	25,402.67
买卖债券差价收入	4,668,327.14

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	342,082.00

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	342,082.00

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	8,753,130.12
股票投资	7,638,667.91
债券投资	1,114,462.21
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	8,753,130.12

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	40,845.47
基金转换费收入	4,999.75
合计	45,845.22

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。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	32,323.20
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-

债券账户维护费	18,000.00
银行汇划费用	17,372.15
其他手续费	600.00
合计	127,967.69

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
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
中银国际证券股份有限公司（“中银国际”）	与基金托管人有其他重大利害关系的公司

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
中银国际	15,249,262.00	5.65	3,816,198.00	0.72

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中银国际	14,424.44	5.80	2,385.09	3.13
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中银国际	3,554.04	0.72	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,047,555.66
其中：应支付销售机构的客户维护 费	62,217.80	185,439.47
应支付基金管理人的净管理费	985,337.86	2,930,487.43

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 0.6% 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	349,185.19

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 0.2% 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	本期
-------------	----

方名称	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	40.39	40.39
中国银行	-	130.50	130.50
国海证券	-	28.92	28.92
合计	-	199.81	199.81
获得销售服务费的各关联 方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	-	39.82	39.82
中国银行	-	134.48	134.48
国海证券	-	29.72	29.72
合计	-	204.02	204.02

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

无。

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

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	58,462,080.00	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	38,129,715.12	-
报告期末持有的基金份额	20,332,364.88	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.80%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	33,074,930.16	-
报告期内申购/买入总份额	47,527,439.03	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	80,602,369.19	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.19%	-

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。

#### 6.4.10.5.2 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（2023 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,561,443.79	12,290.76	850,870.32	14,005.66

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

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 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 8,001,519.84 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
220202	22 国开 02	2024 年 7 月 1 日	101.43	85,000	8,621,733.97
合计				85,000	8,621,733.97

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币

市场基金，属于较低风险收益特征的证券投资基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险控制部负责投资风险管理与绩效评估。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格、合格境外机构投资者托管人资格或其他经管理人评估资质良好的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	19,797,873.18
合计	-	19,797,873.18

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、政策银行债、央行票据及未有第三方机构评级的信用债。

3. 债券投资以全价列示。

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	90,692,977.38	258,262,947.09
AAA 以下	15,617,471.33	25,255,197.86
未评级	80,034,900.40	250,681,547.34
合计	186,345,349.11	534,199,692.29

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

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

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内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。

于本期末，除卖出回购金融资产款将在 1 个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资

产)无固定到期日且不计息,因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

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

于开放期内,本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末,本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,561,443.79	-	-	-	3,561,443.79
结算备付金	3,299,114.82	-	-	-	3,299,114.82
存出保证金	86,929.23	-	-	-	86,929.23
交易性金融资产	50,149,597.62	57,912,746.57	78,283,004.92	26,539,146.51	212,884,495.62
买入返售金融资产	2,000,360.00	-	-	-	2,000,360.00
应收申购款	-	-	-	6,659.41	6,659.41
应收清算款	-	-	-	7,820,788.80	7,820,788.80
资产总计	59,097,445.46	57,912,746.57	78,283,004.92	34,366,594.72	229,659,791.67
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,797.55	15,797.55
应付管理人报酬	-	-	-	108,655.00	108,655.00
应付托管费	-	-	-	36,218.33	36,218.33
卖出回购金融资产款	8,001,519.84	-	-	-	8,001,519.84
应付销售服务费	-	-	-	5,434.80	5,434.80
应交税费	-	-	-	836,881.52	836,881.52
其他负债	-	-	-	187,138.88	187,138.88
负债总计	8,001,519.84	-	-	1,190,126.08	9,191,645.92
利率敏感度缺口	51,095,925.62	57,912,746.57	78,283,004.92	33,176,468.64	220,468,145.75
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	524,529.25	-	-	-	524,529.25
结算备付金	3,310,385.89	-	-	-	3,310,385.89
存出保证金	62,124.77	-	-	-	62,124.77
交易性金融资产	177,232,999.18	281,451,954.60	95,312,611.69	94,504,250.21	648,501,815.68
买入返售金融资产	46,515,034.87	-	-	-	46,515,034.87
应收申购款	-	-	-	12,027.08	12,027.08
应收清算款	-	-	-	962,847.77	962,847.77
资产总计	227,645,073.96	281,451,954.60	95,312,611.69	95,479,125.06	699,888,765.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	149,220.30	149,220.30
应付管理人报酬	-	-	-	387,843.64	387,843.64
应付托管费	-	-	-	129,281.20	129,281.20
应付清算款	-	-	-	804,184.62	804,184.62
卖出回购金融资产款	44,286,207.06	-	-	-	44,286,207.06
应付销售服务费	-	-	-	6,323.05	6,323.05
应交税费	-	-	-	843,759.10	843,759.10

其他负债	-	-	-	460,951.57	460,951.57
负债总计	44,286,207.06	-	-	2,781,563.48	47,067,770.54
利率敏感度缺口	183,358,866.90	281,451,954.60	95,312,611.69	92,697,561.58	652,820,994.77

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		
分析	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：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,498,045.63	2,456,693.47
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,464,254.07	-2,418,235.37

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金持有的证券所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	26,539,146.51	12.04	94,504,250.21	14.48
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	26,539,146.51	12.04	94,504,250.21	14.48

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本期末，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 12.04%(上年度末：14.48%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	64,156,869.35	221,976,862.06
第二层次	148,727,626.27	426,524,953.62
第三层次	-	-

合计	212,884,495.62	648,501,815.68
----	----------------	----------------

#### 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的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 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，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	26,539,146.51	11.56
	其中：股票	26,539,146.51	11.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	186,345,349.11	81.14
	其中：债券	186,345,349.11	81.14
	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	2,000,360.00	0.87
	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	6,860,558.61	2.99
8	其他各项资产	7,914,377.44	3.45
9	合计	229,659,791.67	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

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	197,136.00	0.09
C	制造业	13,538,651.71	6.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,626,570.00	0.74
E	建筑业	1,799,352.00	0.82
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,013,978.00	0.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	440,750.00	0.20
J	金融业	5,737,480.80	2.60
K	房地产业	1,185,228.00	0.54
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	26,539,146.51	12.04

### 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	000651	格力电器	103,900	4,074,958.00	1.85
2	000932	华菱钢铁	602,200	2,667,746.00	1.21
3	000858	五粮液	17,400	2,227,896.00	1.01
4	600970	中材国际	149,200	1,799,352.00	0.82
5	601128	常熟银行	223,940	1,695,225.80	0.77
6	600483	福能股份	139,500	1,626,570.00	0.74
7	601166	兴业银行	86,200	1,518,844.00	0.69
8	601006	大秦铁路	174,100	1,246,556.00	0.57
9	600048	保利发展	135,300	1,185,228.00	0.54

10	600016	民生银行	164,900	624,971.00	0.28
11	000568	泸州老窖	4,200	602,658.00	0.27
12	601665	齐鲁银行	107,200	526,352.00	0.24
13	002353	杰瑞股份	13,500	473,580.00	0.21
14	600941	中国移动	4,100	440,750.00	0.20
15	001872	招商港口	22,800	438,900.00	0.20
16	600036	招商银行	12,800	437,632.00	0.20
17	002142	宁波银行	18,100	399,286.00	0.18
18	002601	龙佰集团	20,000	371,400.00	0.17
19	002050	三花智控	17,669	337,124.52	0.15
20	001965	招商公路	27,700	328,522.00	0.15
21	002738	中矿资源	12,100	324,280.00	0.15
22	000333	美的集团	4,900	316,050.00	0.14
23	601398	工商银行	55,100	314,070.00	0.14
24	002557	洽洽食品	10,029	282,717.51	0.13
25	300037	新宙邦	9,800	279,888.00	0.13
26	002001	新和成	13,600	261,120.00	0.12
27	300502	新易盛	2,400	253,320.00	0.11
28	300408	三环集团	8,472	247,297.68	0.11
29	601998	中信银行	33,000	221,100.00	0.10
30	002432	九安医疗	5,400	218,916.00	0.10
31	002895	川恒股份	11,600	212,396.00	0.10
32	600547	山东黄金	7,200	197,136.00	0.09
33	600761	安徽合力	8,500	183,940.00	0.08
34	600352	浙江龙盛	12,600	108,234.00	0.05
35	600584	长电科技	3,000	95,130.00	0.04

## 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	000932	华菱钢铁	5,433,496.00	0.83
2	600872	中炬高新	4,958,959.65	0.76
3	000651	格力电器	4,041,984.00	0.62
4	002142	宁波银行	4,038,876.00	0.62
5	002493	荣盛石化	3,871,079.50	0.59
6	002557	洽洽食品	3,693,843.00	0.57
7	002050	三花智控	3,581,835.00	0.55
8	000568	泸州老窖	3,395,364.00	0.52
9	002738	中矿资源	3,200,989.00	0.49
10	601009	南京银行	3,136,773.00	0.48
11	000858	五粮液	3,047,972.04	0.47
12	600048	保利发展	2,932,168.00	0.45

13	002353	杰瑞股份	2,906,425.00	0.45
14	600483	福能股份	2,898,107.00	0.44
15	300274	阳光电源	2,726,945.00	0.42
16	601006	大秦铁路	2,583,671.00	0.40
17	688009	中国通号	2,537,973.82	0.39
18	601318	中国平安	2,471,291.00	0.38
19	600970	中材国际	2,357,231.00	0.36
20	603368	柳药集团	2,249,223.00	0.34

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	002557	洽洽食品	10,639,871.00	1.63
2	002050	三花智控	9,634,986.32	1.48
3	000651	格力电器	8,961,603.00	1.37
4	600483	福能股份	8,758,945.80	1.34
5	300408	三环集团	8,244,652.00	1.26
6	002432	九安医疗	6,699,167.60	1.03
7	601677	明泰铝业	6,409,779.22	0.98
8	601688	华泰证券	5,504,749.00	0.84
9	600872	中炬高新	5,502,528.00	0.84
10	601009	南京银行	4,537,594.58	0.70
11	300037	新宙邦	4,282,922.00	0.66
12	601128	常熟银行	4,245,068.00	0.65
13	002493	荣盛石化	3,926,535.00	0.60
14	002142	宁波银行	3,884,583.00	0.60
15	000858	五粮液	3,785,293.00	0.58
16	002475	立讯精密	3,715,006.31	0.57
17	002415	海康威视	3,701,340.00	0.57
18	688008	澜起科技	3,496,863.04	0.54
19	300274	阳光电源	3,330,591.50	0.51
20	003031	中瓷电子	3,255,679.00	0.50

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	101,059,622.92
卖出股票收入（成交）总额	169,049,423.26

注：“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”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	4,842,459.24	2.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,394,854.83	31.93
	其中：政策性金融债	64,901,843.35	29.44
4	企业债券	50,763,569.69	23.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	22,726,742.51	10.31
7	可转债（可交换债）	37,617,722.84	17.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	186,345,349.11	84.52

## 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	230205	23 国开 05	330,000	35,147,658.08	15.94
2	163341	20 中证 G7	150,000	15,205,495.89	6.90
3	110059	浦发转债	102,920	11,349,541.07	5.15
4	102480597	24 合建投 MTN002	100,000	10,290,597.81	4.67
5	163362	20 中金 G2	100,000	10,151,397.26	4.60

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## 7.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

## 7.10.2 本期国债期货投资评价

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金本期投资的前十名证券中，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、处罚的证券如下：

中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）于 2024 年 4 月 12 日收到中国证券监督管理委员会对中信证券的《立案告知书》（证监立案字 03720240049 号），主要违规事实包括在相关主体违反限制性规定转让中核钛白 2023 年非公开发行股票过程中涉嫌违法违规，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，决定对中信证券立案。

中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）于 2024 年 4 月 30 日收到中国证券监督管理委员会下发的对中信证券的行政处罚决定书《中国证监会行政处罚决定书（王泽龙、洪浩炜、中信中证、中信证券、海通证券、韩雨辰）》（证监罚(2024)45 号），主要违规事实包括中信证券在知悉客户融券目的是定增套利的情况下，配合其提供融券服务，根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券法》第一百八十六条及第一百九十七条第二款的规定，决定没收中信证券违法所得 1,910,680.83 元，并处以 23,250,000 元罚款。

本基金对中信证券投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件不改变长期投资价值。同时由于本基金认为中信证券信用风险短期可控，因此买入。本基金管理人的投资决策遵循公司的投资决策制度。

### 7.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	86,929.23
2	应收清算款	7,820,788.80
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,659.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,914,377.44

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	------	--------------

1	110059	浦发转债	11,349,541.07	5.15
2	127018	本钢转债	7,776,528.66	3.53
3	113633	科沃转债	3,565,344.77	1.62
4	128134	鸿路转债	2,874,114.51	1.30
5	113636	甬金转债	2,850,934.14	1.29
6	113052	兴业转债	2,235,777.09	1.01
7	128121	宏川转债	1,416,983.40	0.64
8	123179	立高转债	1,374,612.85	0.62
9	113655	欧 22 转债	1,344,744.97	0.61
10	118024	冠宇转债	1,329,006.15	0.60
11	118043	福立转债	326,076.76	0.15
12	110048	福能转债	227,055.19	0.10
13	110073	国投转债	219,726.53	0.10
14	113065	齐鲁转债	198,355.85	0.09
15	113661	福 22 转债	160,596.53	0.07
16	113632	鹤 21 转债	128,625.82	0.06
17	127056	中特转债	110,431.93	0.05
18	113053	隆 22 转债	109,890.38	0.05
19	113654	永 02 转债	19,376.24	0.01

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	4,392	42,864.85	171,118,347.77	90.89	17,144,088.32	9.11
国富强化收益债券 C	339	62,001.04	19,647,609.60	93.48	1,370,742.07	6.52
合计	4,731	44,236.06	190,765,957.37	91.15	18,514,830.39	8.85

### 8.2 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	国富强化收益债券 A	1,254,732.37	0.666480
	国富强化收益债券 C	-	-
	合计	1,254,732.37	0.599545

### 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	>100
	国富强化收益债券 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国富强化收益债券 A	>100
	国富强化收益债券 C	0
	合计	>100

## § 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	610,021,815.82	24,069,858.44
本报告期基金总申购份额	68,218,727.80	114,069.47
减：本报告期基金总赎回份额	489,978,107.53	3,165,576.24
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	188,262,436.09	21,018,351.67

## § 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，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

## 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 (%)	
民生证券	1	75,735,351.39	28.04	71,637.71	28.79	-
西南证券	1	33,480,768.19	12.40	24,974.44	10.04	-
长江证券	2	31,690,815.64	11.73	29,976.05	12.05	-
申万宏源	2	29,354,663.00	10.87	27,766.76	11.16	-
招商证券	1	24,757,647.8	9.17	23,418.18	9.41	-

		5				
东方证券	2	22,230,428.31	8.23	21,027.85	8.45	-
中银国际	1	15,249,262.00	5.65	14,424.44	5.80	-
东吴证券	2	9,275,162.08	3.43	8,773.48	3.53	-
海通证券	2	8,146,334.00	3.02	7,705.80	3.10	-
光大证券	2	6,914,812.04	2.56	6,540.75	2.63	-
银河证券	1	5,369,904.52	1.99	5,079.40	2.04	-
瑞银证券	1	2,928,948.81	1.08	2,770.52	1.11	-
中金公司	1	2,782,605.00	1.03	2,632.03	1.06	-
中泰证券	1	2,192,343.35	0.81	2,073.83	0.83	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：管理人对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其他相关因素后决定的。报告期内，本基金退租方正证券上交所交易单元 1 个。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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(%)
民生证券	109,729,201.86	40.36	1,456,361,000.00	63.96	-	-
西南证券	21,873,735.11	8.05	223,319,000.00	9.81	-	-
长江证券	8,063,630.72	2.97	-	-	-	-
申万宏源	7,618,610.93	2.80	33,000,000.00	1.45	-	-
招商证券	5,761,766.89	2.12	-	-	-	-

东方证 券	8,885,602.2 0	3.27	-	-	-	-
中银国 际	3,674,860.0 8	1.35	-	-	-	-
东吴证 券	6,595,531.4 2	2.43	-	-	-	-
海通证 券	1,960,036.4 1	0.72	-	-	-	-
光大证 券	3,680,663.5 3	1.35	-	-	-	-
银河证 券	19,602,539. 51	7.21	215,460,000. 00	9.46	-	-
瑞银证 券	2,209,588.0 9	0.81	24,903,000.0 0	1.09	-	-
中金公 司	3,575,277.4 3	1.32	-	-	-	-
中泰证 券	4,213,824.3 9	1.55	322,864,000. 00	14.18	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	64,421,192. 00	23.70	1,040,000.00	0.05	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国海富兰克林基金管理有限公司关于住所变更的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024年1月20日
2	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金 2023 年 4 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024年1月22日

3	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 1 月 22 日
4	国海富兰克林基金管理有限公司关于终止浦领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规定网站	2024 年 2 月 7 日
5	关于增加上海中正达广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	2024 年 3 月 23 日
6	关于增加广东南海农村商业银行股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换业务、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	2024 年 3 月 28 日
7	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 3 月 30 日
8	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 3 月 30 日
9	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 4 月 22 日
10	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金 2024 年 1 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 4 月 22 日
11	国海富兰克林基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 6 月 15 日
12	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金（国富强化收益债券 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	2024 年 6 月 26 日
13	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金（国富强化收益债券 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	2024 年 6 月 26 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 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	20240101-20240428	141,909,315.41	39,448,64.21	181,357,779.62	-	-
	2	20240514-20240626	43,694,68	-	-	43,694,682.63	20.88

		40630	2.63				
3	20240101-202	186,636,3		-	186,636,3		-
	40102	16.83			16.83		
4	20240514-202	42,768,18		-		42,768,186.95	20.44
	40630	6.95					

#### 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。

## 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，会面临科创板和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

2024 年 8 月 31 日