基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2015年08月28日

富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015年6月30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。本半年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月26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2015年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国富恒丰定期债券	
基金主代码	000351	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年11月20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	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	366,035,474.16	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	国富恒丰定期债券A	国富恒丰定期债券C
下属两级基金的交易代码	000351	000352
报告期末下属两级基金的份额总额	266,149,525.82	99,885,948.34

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争获得超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金遵循组合久期与运作周期的期限适当匹配的原则。在通过自上而下的方法所确定的组合久期的控制下,结合自下而上的个券选择方法。 (一)封闭期投资策略 1、资产配置策略 本基金通过综合分析国内外宏观经济形势、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险和有关政策法规等因素,研判各类属固定收益类资产以及参与新股申购等非固定收益类资产投资的预期收益和预期风险,确定各类金融资产的配置比例。 2、类属配置策略 基金将根据各类属债券的相对投资价值分析,确定债券类属配置策略,并根据市场变化及时进行调整,从而选择既能匹配目标久期、同时又能获得较高持有期收益的类属债券配置比例。 3、久期管理策略 本基金将根据基金封闭期的剩余运作期限以及宏观经济因素与不同种类债券收益率之间的关系,确定债券组合的久期。 4、中小企业私募债券投资策略 本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较,对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析,选择具有优势的品种进行投资,并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。 5、资产支持证券投资策略 对于资产支持证券,本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况,在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。 6、新股申购策略 本基金将深入研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面,挖掘公司的内在价值,根据当时股票市场整体投资环境及定价水平,在有效控制风险的前提下制定相应的新股认购策略。对通过新股申购获得的股票,将根据其实际的投资价值确定持有或卖出。 (二)开放期投资策略 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种。
业绩比较基准	一年期定期存款税后收益率+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	林葛
	联系电话	021-3855 5555	010-66060069
	电子邮箱	service@ftsfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-4518.9510-5680和021-38789555	95599
传真		021-6888 3050	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§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

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)	
	国富恒丰定期债券A	国富恒丰定期债券C
本期已实现收益	11,819,343.31	4,242,899.19
本期利润	13,794,220.18	4,983,440.03
加权平均基金份额本期利润	0.0519	0.0500
本期基金份额净值增长率	5.09%	4.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0573	0.0546
期末基金资产净值	281,388,134.71	105,334,966.13
期末基金份额净值	1.0570	1.0550

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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

4、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如,开放式基金的申购赎回费等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

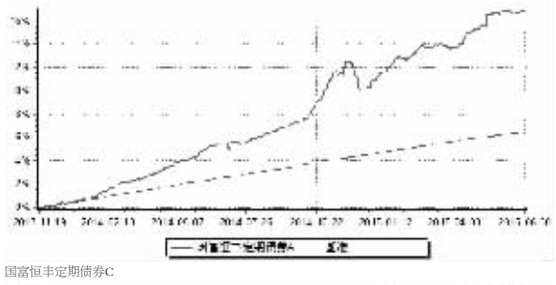
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

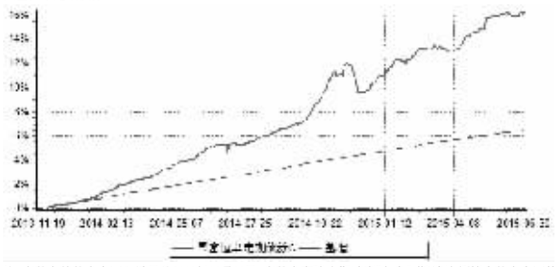
阶段 (国富恒丰定期债券A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.28%	0.06%	0.28%	0.01%	0.00%	0.05%
过去三个月	2.82%	0.10%	0.84%	0.01%	1.98%	0.09%
过去六个月	5.09%	0.10%	1.76%	0.01%	3.33%	0.09%
过去一年	10.75%	0.14%	3.83%	0.01%	6.92%	0.13%
自基金合同生效日起至今(2013年11月20日-2015年06月30日)	16.88%	0.11%	6.49%	0.01%	10.39%	0.10%
阶段 (国富恒丰定期债券C)	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	0.29%	0.08%	0.28%	0.01%	0.01%	0.07%
过去三个月	2.82%	0.09%	0.84%	0.01%	1.98%	0.08%
过去六个月	4.90%	0.10%	1.76%	0.01%	3.14%	0.09%
过去一年	10.35%	0.14%	3.83%	0.01%	6.52%	0.13%
自基金合同生效日起至今(2013年11月20日-2015年06月30日)	16.23%	0.12%	6.49%	0.01%	9.74%	0.11%

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

国富恒丰定期债券A



国富恒丰定期债券C



注:本基金的基金合同生效日为2013年11月20日。本基金在建仓期结束时,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,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持有51%的股份,邓普顿国际股份有限公司持有49%的股份。

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,在全球市场上有超过65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。

本公司具有丰富的管理基金经验。自2005年6月第一只基金成立开始,截至本报告期末,本公司已经成功管理了20只基金产品(包含A、C类混合基金,A、B、C类债券基金,A、B类货币市场基金)。

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		
胡永燕	国富日日收益货币基金、国富恒丰定期债券基金的基金经理	2013年11月20日	-	7年	胡永燕女士,中国人民大学金融学硕士。历任华泰资产管理有限公司固定收益组合管理部研究员、投资助理及投资经理,并曾在国海富兰克林基金管理有限公司负责公司投资管理部固定收益小组固定收益类产品的投资与研究工作。截止本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富日日收益货币基金、国富恒丰定期债券基金的基金经理。

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《富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。报告期内公司不存在投资组合之间发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年债券市场由强转弱,陡峭化趋势显著,尽管央行进行了多次逆回购并在6月底降准降息,然而对市场的提振并不明显,长期债券在降息之后反而出现了一轮明显的收益率上行,市场情绪整体比较悲观。从供需层面看,鉴于长期债券市场后大的供给预期,投资者对其仍然相对谨慎,未来人民银行和财政部关于万亿地方债发行的资金配套解决方案将对中长期利率债走势起到至关重要的作用。宏观面看,经济增长依然缺乏新的驱动因素,猪肉价格较大的涨幅尚不足以引发通胀率大幅度都上行,债券市场长期慢牛的内在动因仍然存在,美国加息开启的时间窗口虽有远虑但无近忧。

报告期内,组合保持高杠杆中票息的操作思路,一季度积极把握信用债机会,二季度末逐步提高组合久期加大对利率债的配置,组合始终规避产能过剩行业和盈利前景不明确的民企债券,为投资者实现稳健的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,基金份额A类净值增长5.09%,同期业绩比较基准增长1.76%,基金超额收益率3.33%,基金份额C类净值增长4.90%,同期业绩比较基准增1.76%,基金超额收益率3.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,伴随着资金价格的走低以及资金利率波动率下降,短期债券市场相对乐观,3年以内的信用债的行情更为确定。随着权益市场的波动率加剧以及打新资金的投资方向重新确立,债券市场的悲观预期将得到一定程度的修正,长久期债券此前堆积的利好消息将逐渐得以显现,因此下半年债券市场的交易机会将在权益市场热情冷却后得到体现。

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《公允估值管理办法》。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。公司估值委员会由董事长(本报告期内代为履行总经理职责)或其任命者负责,成员包括投研、风险控制、监察稽核、交易、基金核算方面的部门主管,相关人员均具有丰富的证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的基金管理人于2015年1月12日宣告分红,向截至2015年1月15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0.33元,C类基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.33元。

本基金的基金管理人于2015年4月10日宣告分红,向截至2015年4月14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0.28元,C类基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.27元。

本基金的基金管理人于2015年7月10日宣告分红,向截至2015年7月14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0.29元,C类基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.27元。

本基金本报告期所实施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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人-国海富兰克林基金管理有限公司 2015年1月1日至2015年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,国海富兰克林基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,国海富兰克林基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2015年06月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年06月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	11,460,065.48	377,586.59
结算备付金	6,826,023.25	7,850,712.87
存出保证金	15,923.65	64,781.90
交易性金融资产	500,452,397.62	519,820,213.07
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	500,452,397.62	519,820,213.07
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	21,060,151.59
应收证券清算款	9,966,271.67	939,566.71
应收利息	12,076,789.64	12,104,843.32
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	540,797,471.31	562,217,856.05
负债和所有者权益	本期末 2015年06月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	147,999,683.00	172,499,684.10
应付证券清算款	5,003,048.44	22,951.16
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	222,278.57	214,843.69
应付托管费	63,508.16	61,383.93
应付销售服务费	30,275.19	29,790.75
应付交易费用	8,938.18	18,014.54
应交税费	539,626.21	539,626.21
应付利息	55,269.56	100,961.66
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	151,743.16	306,000.00
负债合计	154,074,370.47	173,793,256.04
所有者权益:		
实收基金	366,035,474.16	364,418,828.28
未分配利润	20,687,626.68	24,005,771.73
所有者权益合计	386,723,100.84	388,424,600.01
负债和所有者权益总计	540,797,471.31	562,217,856.05

注:报告截止日2015年6月30日,国富恒丰定期债券基金A类基金份额净值1.057元,C类基金份额净值1.055元,基金份额总额366,035,474.16份,其中A类基金份额266,149,525.82份,C类基金份额99,885,948.34份。

6.2 利润表

会计主体:富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年01月01日-2015年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日	上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日
一、收入	24,874,906.33	42,033,588.46
1.利息收入	16,477,979.79	27,101,883.30
其中:存款利息收入	64,611.88	8,503,741.51
债券利息收入	16,358,590.45	17,684,814.75
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	54,777.46	913,327.04
其他利息收入	-	-
2.投资收益	5,681,508.83	6,558,362.66
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,681,508.83	6,558,362.66
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益	2,715,417.71	8,373,342.50
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
减:二、费用	6,097,246.12	11,239,396.91
1.管理人报酬	1,335,208.57	2,221,908.64
2.托管费	381,488.12	634,831.03
3.销售服务费	181,849.90	310,447.30
4.交易费用	5,356.36	12,157.70
5.利息支出	4,004,976.26	7,877,816.49
其中:卖出回购金融资产支出	4,004,976.26	7,877,816.49
6.其他费用	188,366.91	182,235.75
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	18,777,660.21	30,794,191.55
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	18,777,660.21	30,794,191.55

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年01月01日-2015年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	364,418,828.28	24,005,771.73	388,424,600.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,777,660.21	18,777,660.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,616,645.88	56,231.49	1,672,877.37
其中:1.基金申购款	1,616,645.88	56,231.49	1,672,877.37
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-22,152,036.75	-22,152,036.75
五、期末所有者权益(基金净值)	366,035,474.16	20,687,626.68	386,723,100.84
项 目	上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	625,548,965.97	3,490,424.78	629,039,390.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,794,191.55	30,794,191.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	214,451.42	3,830.19	218,281.61
其中:1.基金申购款	214,451.42	3,830.19	218,281.61
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-7,331,639.17	-7,331,639.17
五、期末所有者权益(基金净值)	625,763,417.39	26,956,807.35	652,720,224.74

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:

吴显玲(董事长,本报告期内代为履行总经理职责)	胡昕彦	黄宇虹
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

富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]第1187号《关于核准富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金募集的批复》注册,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《富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集625,438,206.93元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第764号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2013年11月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为625,548,965.97份,认购资金产生的利息收入折合110,759.04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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金自基金合同生效之日(含)起或自每一开放期结束之日次日(含)起一年的期间封闭运作。自封闭期结束之后第一个工作日(含)起进入开放期,每个开放期原则上不少于五个工作日且不超过十五个工作日,开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

根据《富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不从本类别基金资产中收取认购/申购费用的,称为C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债(含中小企业私募债券)、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,但可参与一级市场的新股申购、新股增发和可转债申购,并可持有因可转换债券转股所形成的股票以及股票派发或可分离交易可转债分离交易的权证等资产。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,但在每次开放期开始前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内,本基金投资不受上述比例限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制,但在开放期内,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:一年期定期存款税后收益率+1.2%。

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2015年8月26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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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》及其他相关财政法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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,股权的股息、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。自2013年1月1日起,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,暂减按25%计入应纳税所得额。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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本基金管理人全资控股的子公司国海富兰克林资产管理(上海)有限公司以自有资金全额出资,成立国海富兰克林投资管理(上海)有限公司,并已在工商行政管理部门办理完成工商注册登记,取得营业执照。

6.4.7.2 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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年01月01日-2015年06月30日	上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,335,208.57	2,221,908.64
其中:支付销售机构的客户维护费	677,136.90	973,177.39

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0.7%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×0.7% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年01月01日-2015年06月30日	上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	381,488.12	634,831.03

注:支付基金托管人中国农业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:日托管费=前一日基金资产净值×0.2% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2015年01月01日-2015年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富恒丰定期债券A	国富恒丰定期债券C	合计
国海富兰克林基金管理有限公司	-	219.39	219.39
中国农业银行	-	179,458.35	179,458.35
国海证券	-	697.80	697.80
合计	-	180375.54	180375.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国富恒丰定期债券A	国富恒丰定期债券C	合计
国海富兰克林基金管理有限公司		4,533.91	4,533.91
中国农业银行	-	300,181.82	300,181.82
国海证券	-	4,356.43	4,356.43
合计	-	309072.16	309072.16

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C 类份额对应的基金资产净值的年费率0.35%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 类份额对应的基金资产净值 × 0.35 % / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2015年01月01日-2015年06月30日		上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06月30日	
	国富恒丰定期债券A	国富恒丰定期债券C	国富恒丰定期债券A	国富恒丰定期债券C
期初持有的基金份额	11,130,797.77	-	11,999,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	11,130,797.77	-	11,999,000.00	-
占基金总份额比例	4.18%	-	2.66%	-

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。

6.4.8.4.2 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

注: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(2014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。

6.4.8.5 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2015年01月01日-2015年06月30日		上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	11,460,065.48	35,463.73	342,250.77	42,027.06

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2015年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.2.9.1.1 受限证券类别:债券								
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
112243	15东旭债	2015-05-20	2015-07-08	新债未上市	100.00	100.00	34,000	3,400,000.00	3,400,000.00
132002	15天集EB	2015-06-11	2015-07-02	新债未上市	100.00	100.00	4,340	434,000.00	434,000.00

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015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77,999,683.00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
1180053	11宝城投债	2015-07-01	105.43	200,000	21,086,000.00
1280398	12营口沿海债	2015-07-01	103.98	180,000	18,716,400.00
1080004	10郴州债	2015-07-01	103.85	200,000	20,770,000.00
1282464	12庆公用MTN