财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金

2017 第三季度 报告

2017年9月30日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	财通资管积极收益债券
基金主代码	002901
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年07月19日
报告期末基金份额总额	180,244,901.36份
投资目标	在有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的投研能力,采取自上而下的方法对基金的大类资产进行动态配置,综合久期管理、收益率曲线配置等策略对个券进行精选,力争在严格控制基金风险的基础上,获取长期稳定超额收益。另外,本基金可投资于股票、权证等权益类资产,基金管理人将选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资,强化基金的获利能力,提高预期收益水平,以期达到收益增强的效果。
业绩比较基准	中债总指数(全价)收益率
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,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	财通证券资产管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	财通资管积极收益债券A / 财通资管积极收益债券C
下属分级基金的交易代码	002901 / 002902
报告期末下属分级基金的份额总额	110,154,681.85份 / 70,090,219.51份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年07月01日-2017年09月30日)	
	财通资管积极收益债券A	财通资管积极收益债券C
1.本期已实现收益	3,967,694.81	3,777,993.92
2.本期利润	1,827,636.49	3,841,334.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0181	0.0167
4.期末基金资产净值	110,863,618.95	70,500,236.75
5.期末基金份额净值	1.006	1.006

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指本期基金利息收入、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

财通资管积极收益债券A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	1.27%	0.08%	-0.42%	0.06%	1.69%	0.02%

财通资管积极收益债券C

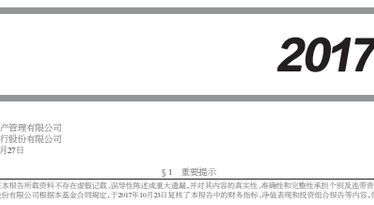
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.17%	0.08%	-0.42%	0.06%	1.59%	0.02%

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

财通资管积极收益债券A

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

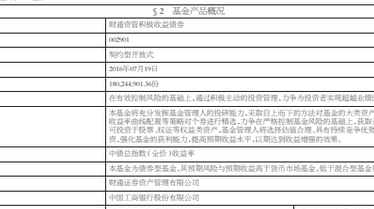
(2016年7月19日-2017年9月30日)



财通资管积极收益债券C

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年7月19日-2017年9月30日)



注:1.本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月,本基金已建仓完毕,截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。
2.自基金合同生效至报告期末,财通资管积极收益债券A基金份额净值增长率为4.61%,同期业绩比较基准收益率为-4.47%;财通资管积极收益债券C基金份额净值增长率为4.11%,同期业绩比较基准收益率为-4.47%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张波	本基金基金经理、财通资管鑫安货币市场基金基金经理	2016年08月15日	2017年09月06日	8	中南财经政法大学财政学学士,2007年8月至2013年8月期间于平安资产管理有限公司担任集中交易部债券交易员,2014年7月至2016年3月期间担任平安养老保险股份有限公司资产管理事业部债券交易主管。
宫志芳	本基金基金经理、财通资管鑫安货币市场基金和财通资管鑫通回报证券投资基金基金经理	2017年08月18日	--	6	武汉大学数理金融硕士,中级经济师,2010年7月进入浙江泰隆银行资金运营部先后从事外汇交易和债券交易,2012年3月进入宁波通商银行金融市场部海条债券业务,主要负责资金、债券投资交易,期间14年初海条并开展贵金属自营业务,2016年3月加入财通证券资产管理有限公司。
顾宇笛	本基金基金经理	2017年08月29日	--	3	华东师范大学经济学硕士,2014年6月至2014年12月担任财通证券股份有限公司资产管理部债券研究员,2015年1月至2017年8月担任财通证券资产管理有限公司固定收益部债券研究员,主要负责钢铁分析与创新产品研发,对城投债、产业债、可转债,可交换债等品种都有深入的研究。

注:1.上述任职日期为根据公司确定的聘任日期,离任日期为根据公司确定的解聘日期;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。
2.证券从业的涵义遵守行业协会《证券从业人员资格管理办法》相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金合同》、《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行,报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况,本基金与本公司管理的其他基金在不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度宏观经济数据表现偏弱,基建和制造业投资增速均出现明显下滑,基本面利好债市。物价方面,目前CPI处于低位,8月CPI同比上涨1.8%,较上月上升0.4个百分点,主要受鸡蛋、鲜菜等食品价格大涨和基期效应影响,预期年内通胀压力不大;PPI同比上涨6.3%,增幅较上月扩大0.8个百分点,主要是由于煤炭、铁矿石及原油等过剩产能行业价格走高,拉动生产资料同比大涨造成,预计四季度PPI涨幅回落概率较大。9月中国制造业PMI为52.4%,较上月提高0.7个百分点;财新服务业PMI为50.6%,低于前值52.7%。进出口方面,8月进口增速小幅回升,同比上涨13.3%,主要受大宗商品价格走高,铁矿砂、精矿、钢材等进口额大幅上涨影响;出口同比上涨5.5%,略有回落;贸易顺差419亿美元。固定投资方面,8月固定资产投资累计同比增速7.8%,较上月下滑0.5个百分点,其中基建和制造业投资回落,未来投资或将仍面临下行压力。

金融数据方面,8月新增社融1.48万亿,比上年同期多186亿元,其中人民币贷款增加1.15万亿元,同比多增1497亿元;表外融资增加1303亿元,同比少增489亿元;企业债券净融资为1063亿元,同比少增2173亿元;社融数据从结构上看从表外转向表内,债券、非标转向信贷趋势明显;M2同比增速8.9%,创近两年新低,连续十个月放缓,金融去杠杆初显成效。三季度金融监管步伐有所放缓,货币政策维持中性稳健,基本面利好债市,收益率特别是中高评级信用债收益率整体较二季度小幅下行。

三季度权益市场风格轮动加速,我们在坚守行业龙头和白马股的前提下,精选个股,择时卖出降低仓位;同时抓住转债机会,积极布局,力争净值平稳上行。

固定债作方面,本季度固定收益部在市场机会进行部分信用债的卖出,降低整体杠杆和久期,同时辅以利率债、国债期货转换债的波段操作,力争在保证安全性和流动性的前提下增厚整体收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,财通资管积极收益债券A基金份额净值增长率为1.27%,同期业绩比较基准收益率为-0.42%;财通资管积极收益债券C基金份额净值增长率为1.17%,同期业绩比较基准收益率为-0.42%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	2,967,188.00	1.47
	其中:股票	2,967,188.00	1.47
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	192,478,027.00	95.50
	其中:债券	192,478,027.00	95.50
	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	2,594,842.18	1.29
8	其他资产	3,514,396.30	1.74
9	合计	201,554,453.48	100.00

注:本报告期末基金投资的前十名证券的发行主体中被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	59,571.07
2	应收证券清算款	183,274.38
3	应收股利	--
4	应收利息	3,235,270.56
5	应收申购款	36,280.29
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	3,514,396.30

5.11.4 报告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	113008	电气转债	745,290.00	0.41

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300104	乐视网	1,410,360.00	0.78	筹划重大资产重组事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	财通资管积极收益债券A	财通资管积极收益债券C
报告期期初基金份额总额	142,606,320.09	372,524,343.00
报告期期间基金总申购份额	51,308,152.57	36,999,507.93
减:报告期期间基金总赎回份额	83,759,790.81	339,433,631.42
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	--	--
报告期期末基金份额总额	110,154,681.85	70,090,219.51

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

	财通资管积极收益债券A	财通资管积极收益债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,900.00	--
报告期期间买入/申购总份额	--	--
报告期期间卖出/赎回总份额	--	--
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,900.00	--
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	5.55	--

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人无运用固有资金申购、赎回本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额未适持有期限
基金管理人固有资金	9,999,900.00	5.50%	9,999,900.00	5.50%	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	--	--	--	--	--
基金经理等人员	--	--	--	--	--
基金管理人股东	--	--	--	--	--
其他	--	--	--	--	--
合计	9,999,900.00	5.50%	9,999,900.00	5.50%	自合同生效之日起不少于3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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比例达到或超过20%的时间区间				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	2017-09-04至2017-09-30	--	47,937,679.77	--	47,937,679.77	26.60%
个人	1	2017-07-01至2017-09-03	200,027,000.00	--	200,027,000.00	--	--
产品持有风险							
本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况,如该类投资者集中赎回,可能会对本基金造成流动性风险,从而影响基金的投资运作和收益水平,管理人将在基金运作中加强流动性管理,保持合适的流动性水平,对申购赎回进行合理的应对,防范流动性风险,保障持有人利益。						

注:上述期初为报告期起始日2017年7月1日。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录
1.中国证监会批准设立财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金的文件
2.财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金合同
3.财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金托管协议
4.中国证监会批准设立财通证券资产管理有限公司的文件
5.财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金财务报表及报表附注
6.报告期内在指定报刊上披露的各项公告

10.2 存放地点
上海市浦东新区福山路500号城建国际大厦28楼
浙江省杭州市上城区四宜路四宜大厦B幢办公楼

10.3 查阅方式
投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。
咨询电话:95336
公司网址:www.czzg.com

财通证券资产管理有限公司
二〇一七年十月二十七日

富兰克林国海安享货币市场基金

2017 第三季度 报告

2017年9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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富安享货币
基金主代码	004120
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年5月22日
报告期末基金份额总额	11,414,953,319.83份
投资目标	在严格控制风险并保持资产流动性的基础上,力争实现超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金主要为投资人提供现金管理工具,通过积极的投资组合管理,同时充分把握市场短期失衡带来的套利机会,在安全性、流动性和收益性之间寻求最佳平衡点。 1.期限配置策略 基于对国内外宏观经济形势、国家货币政策和财政政策、短期资金市场利率波动、资金供求、市场结构变化等因素的深入研究,对利率期限结构变动趋势进行研判,预期货币市场利率水平,确定基金投资组合的平均剩余期限及期限分配结构。本基金将投资组合的平均剩余期限控制在150天以内。 2.类属资产配置策略 深入分析国内外宏观经济形势、社会资金运动及各项宏观经济政策对货币市场和债券市场的影响,通过分析各类属品种的相对收益、信用利差变化等,判断类属债券的相对投资价值,并结合各品种的市场容量和流动性状况,在银行存款、短期融资券、国债、央行票据、债券回购等低风险品种间进行合理配置。 3.相对价值控摘策略 本基金在主要投资于货币市场工具的同时,深入挖掘市场上各类固定收益类投资品种由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级差异变化等因素造成的短期内市场失衡,进种入集将带来一定投资机会,通过分析短期市场机会发生的动因及规律,积极利用市场机会获得超额收益。 4.回购策略 (1)信息放大策略:本基金将在严格控制风险的前提下,利用回购利率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益。 (2)回购策略:基金管理人将密切关注由于新股申购、新债发行以及季节效应等因素导致短期资金需求激增的机会,通过进回购的方式融出资金以分享短期资金利率升高所带来的投资机会。 5.现金流管理策略 对市场资金供给的变化及本基金申购/赎回变化的动态预测,通过现金库存管理、回购滚动操作、债券品种的期限结构安排及资产变现等措施,动态调整并有效分配现金流,在保证基金资产流动性的基础上,获取稳定的收益。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,预期风险水平和预期收益低于混合型基金和股票型基金,高于货币市场基金。
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
下属分级基金的基金简称	国富日鑫月益30天理财债券A / 国富日鑫月益30天理财债券B
下属分级基金的交易代码	004663 / 004664
报告期末下属分级基金的份额总额	69,073,837.84份 / 1,502,297,395.61份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)	
	国富日鑫月益30天理财债券A	国富日鑫月益30天理财债券B
1. 本期已实现收益	3,047,235.26	13,794,327.74
2. 本期利润	3,047,235.26	13,794,327.74
3. 期末基金资产净值	69,073,837.84	1,502,297,395.61

注: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。由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

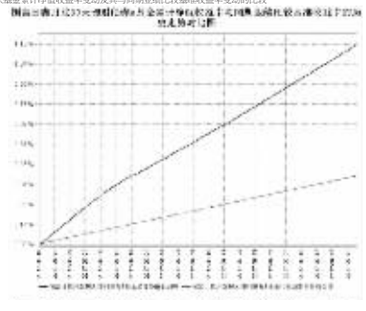
国富日鑫月益30天理财债券A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.9668%	0.0013%	0.3401%	0.0000%	0.6264%	0.0013%

国富日鑫月益30天理财债券B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.0368%	0.0014%	0.3401%	0.0000%	0.6967%	0.0014%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金的基金合同生效日为2017年5月22日,本基金建仓期为6个月,截至报告期末基金尚未完成建仓。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王莉	国富日收益货币基金、国富安享货币基金及国富日鑫月益30天理财债券基金的基金经理	2017年5月22日	--	7年	王莉女士,华东师范大学金融学硕士,历任武汉农村商业银行股份有限公司债券交易员、国海富兰克林基金管理有限公司债券交易员、国富日收益货币基金、国富安享货币基金及国富日鑫月益30天理财债券基金的基金经理。
胡永燕	国富日收益货币基金、国富恒丰定期债券基金、国富安享货币基金及国富日鑫月益30天理财债券基金的基金经理	2017年6月19日	2017年9月13日	9年	胡永燕女士,中国人民大学金融学硕士,历任华泰证券资产管理有限公司固定收益投研部研究员、投资助理及投资经理,国海富兰克林基金管理有限公司基金经理。

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《富兰克林国海日鑫月益30天理财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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配、信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》,严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度债券市场在监管和资金面的双重影响下,收益率呈现先上升后回落的态势,整体调整幅度不大,7月中旬以后,资金价格居高不下,资金面紧平衡的状态一直持续到季末。

报告期内,在保持组合流动性的前提下,逐步改善账户的债券和同业存单配置结构。考虑到中小银行在未来监管政策上资质可能有所分化,因此配置的评级分布主要在AA+及AAA上,兼顾流动性和收益性,组合久期维持在相对合理的区间。与此同时,本基金密切关注货币政策走向对市场情绪的冲击。

4.5 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0.9665%,同期业绩比较基准增长0.3401%,基金超额收益率0.6264%,基金份额B类净值增长1.0368%,同期业绩比较基准增长0.3401%,基金超额收益率0.6967%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,614,946,458.31	88.33
	其中:债券	1,614,946,458.31	88.33
	资产支持证券	--	--
2	买入返售金融资产	199,711,099.57	10.92
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
3	银行存款和结算备付金合计	4,915,665.76	0.27
4	其他资产	8,759,118.56	0.48
5	合计	1,828,332,342.20	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	5.12
	其中:买断式回购融资	--
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	254,049,178.92	16.17
	其中:买断式回购融资	--	--

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	期限	调整期
1	2017年9月26日	22.49	基于市场和投资情况	1天

注:本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期内投资组合平均剩余期限	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	5

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	49.24	16.17
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	--	--
2	30天(含)-60天	12.64	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	--	--
3	60天(含)-90天	6.31	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	--	--
4	90天(含)-120天	6.78	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	--	--
5	120天(含)-397天(含)	40.82	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	--	--
	合计	115.80	16.17

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	79,814,700.05	5.08
	其中:政策性金融债	79,814,700.05	5.08
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	同业存单	1,535,131,758.26	97.69
8	其他	--	--
9	合计	1,614,946,458.31	102.77
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	--	--

注:
1.上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。
2.同业存单中,投资于AAA同业存单的比例为35.79%,AA+同业存单的比例为51.35%,AA同业存单的比例为12.86%。

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1117039944	17广州农村商业银行CD154	1,000,000	99,226,986.80	6.31
2	1117210197	17渤海银行CD097	800,000	79,884,822.19	5.08
3	170204	17国开04	800,000	79,814,700.05	5.08
4	1117954427	17平顶山银行CD023	700,000	69,917,761.49	4.45
5	1117816156	17浦江银行CD130	700,000	69,014,826.36	4.39
6	1117853344	17广州农村商业银行CD167	700,000	67,717,194.51	4.31
7	1117858064	17河北银行CD091	600,000	57,972,718.93	3.69
8	1117954104	17四川天府银行CD045	500,000	49,963,414.00	3.18
9	1117954143	17广东南海农商行CD101	500,000	49,963,333.29	3.18
10	1117954158	17广东顺德农商行CD053	500,000	49,963,461.92	3.18

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0179%
报告期内偏离度的最低值	-0.0803%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0156%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
本报告期内本基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
本报告期内本基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明
本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。
本基金份额资产净值始终维持在1.00元。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	--
2	应收证券清算款	--
3	应收利息	1,583,418.56
4	应收申购款	7,175,700.00
5	其他应收款	--
6	待摊费用	--
7	其他	--
8	合计	8,759,118.56

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国富日鑫月益30天理财债券A	国富日鑫月益30天理财债券B
报告期期初基金份额总额	932,372,401.87	627,019,230.49
报告期期间基金总申购份额	22,454,705.98	1,512,124,810.40
报告期期间基金总赎回份额	885,753,270.01	636,846,645.28
报告期期末基金份额总额	69,073,837.84	1,502,297,395.61

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本公司管理的该基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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比例达到或者超过20%的时间区间					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	2017年7月19日至2017年9月30日	--	1,511,797,395.61	9,500,000.00	1,502,297,395.61	95.60%
产品持有风险							
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;市或导致基金在调整困难,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延期和部分赎回费归入基金资产的影响,从而导致市场因素的净值异常波动。						

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1.中国证监会批准富兰克林国海安享货币市场基金设立的文件;
2.《富兰克林国海安享货币市场基金基金合同》;
3.《富兰克林国海安享货币市场基金招募说明书》;
4.《富兰克林国海安享货币市场基金托管协议》;
5.中国证监会要求的其他文件。

9.2 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.ftfund.com。

9.3 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.ftfund.com 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司
2017年10月27日

富兰克林国海日鑫月益30天理财债券型证券投资基金

2017 第三季度 报告

2017年9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
报告送出日期:2017年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
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2017年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况