

富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金  
2022 年第 1 季度报告

2022 年 3 月 31 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：2022 年 4 月 22 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 2022 年 4 月 20 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 2022 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国富日日收益货币	
基金主代码	000203	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 7 月 24 日	
报告期末基金份额总额	3,258,073,487.15 份	
投资目标	在力求保持基金资产安全性与较高流动性的基础上，追求稳定的当期收益。	
投资策略	本基金主要为投资者提供现金管理工具，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。	
业绩比较基准	同期 7 天通知存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金及债券型基金，属于低风险稳定收益特征的证券投资基金。	
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	国富日日收益货币 A	国富日日收益货币 B
下属分级基金的交易代码	000203	000204
报告期末下属分级基金的份额总额	2,906,757,457.99 份	351,316,029.16 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（2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日）	
	国富日日收益货币 A	国富日日收益货币 B
1. 本期已实现收益	10,860,913.26	603,172.92
2. 本期利润	10,860,913.26	603,172.92
3. 期末基金资产净值	2,906,757,457.99	351,316,029.16

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。由于货币市场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 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

国富日日收益货币 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	0.4893%	0.0013%	0.2988%	0.0000%	0.1905%	0.0013%
过去六个月	1.0167%	0.0015%	0.6061%	0.0000%	0.4106%	0.0015%
过去一年	2.0912%	0.0020%	1.2230%	0.0000%	0.8682%	0.0020%
过去三年	6.3597%	0.0026%	3.7645%	0.0000%	2.5952%	0.0026%
过去五年	13.5696%	0.0033%	6.4332%	0.0000%	7.1364%	0.0033%
自基金合同 生效起至今	29.4223%	0.0046%	11.7358%	0.0000%	17.6865%	0.0046%

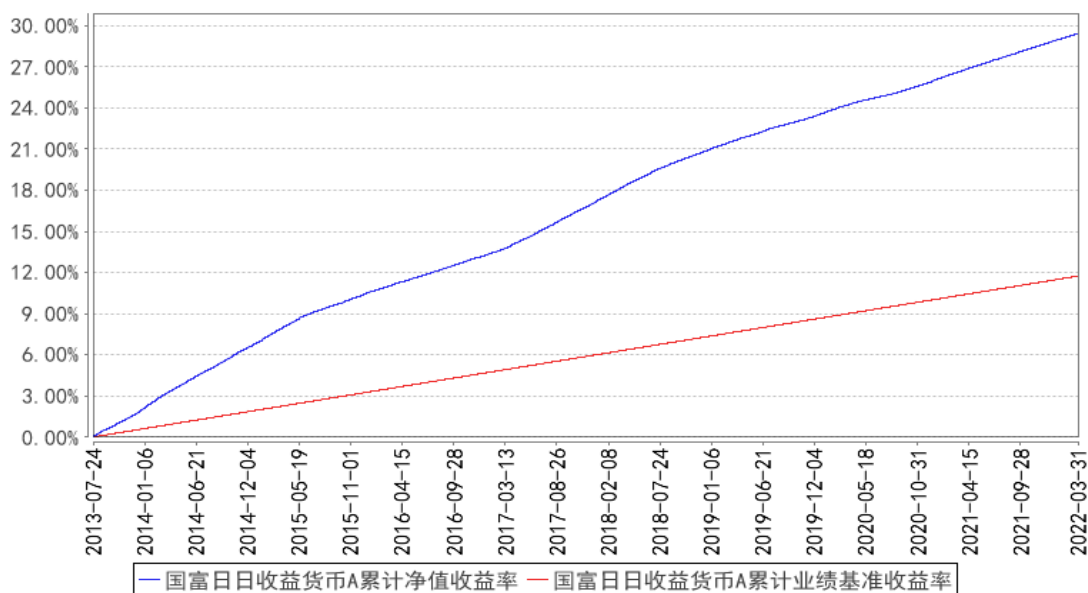
国富日日收益货币 B

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	0.5489%	0.0013%	0.2988%	0.0000%	0.2501%	0.0013%
过去六个月	1.1377%	0.0015%	0.6061%	0.0000%	0.5316%	0.0015%
过去一年	2.3363%	0.0020%	1.2230%	0.0000%	1.1133%	0.0020%
过去三年	7.1267%	0.0026%	3.7645%	0.0000%	3.3622%	0.0026%
过去五年	14.9399%	0.0033%	6.4332%	0.0000%	8.5067%	0.0033%
自基金合同 生效起至今	32.1468%	0.0046%	11.7358%	0.0000%	20.4110%	0.0046%

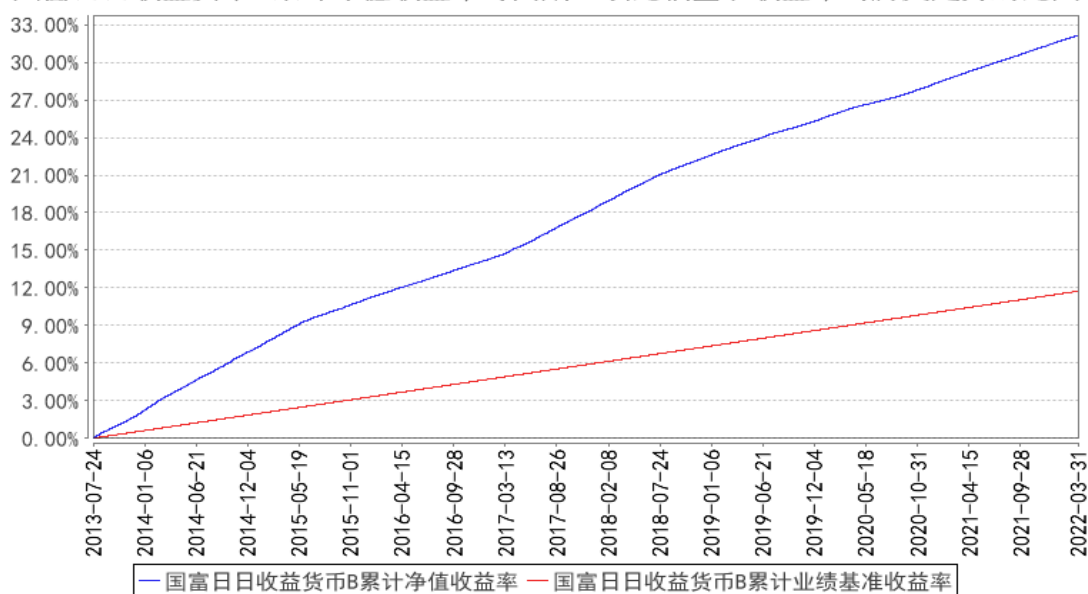
注：本基金收益分配按日结转份额。

### 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

国富日日收益货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



国富日日收益货币B累计净值收益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 2013 年 7 月 24 日。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	国富日日收益货币基金、国富安享货币基金、国富恒丰定期债券基金、国富新机遇混合基金及国富天颐混合基金的基金经理。	2016 年 1 月 22 日	-	12 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、国富日鑫月益 30 天理财债券基金的基金经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富日日收益货币基金、国富安享货币基金、国富恒丰定期债券基金、国富新机遇混合基金及国富天颐混合基金的基金经理。
严婧璧	国富日日收益货币基金及国富安享货币基金的基金经理	2019 年 7 月 27 日	-	14 年	严婧璧女士，CFA，FRM 持证人，中国人民大学金融学硕士。历任太平资产管理有限公司交易员，国海富兰克林基金管理有限公司交易员、国富日日收益货币基金、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助理、国富日鑫月益 30 天理财债券基金的基金经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富日日收益货币基金及国富安享货币基金的基金经理。

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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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《富兰克林国海日日收益货币市场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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年是稳增长的一年，两会将 GDP 目标设定在 5.5%，好的开端是对信心最好的提振。一季度就在红红火火的信贷投放和财政发力中拉开。1 月 17 日，央行率先降低了 MLF 和 OMO 利率 10bp 至 2.75% 和 2.10%，为 20 年 4 月以来首次，并超额续作了 2000 亿 MLF，在随后的金融统计数据新闻发布会上，刘司长更是表示“要把货币政策工具箱开的再大一些，保持总量稳定，避免信贷塌方”，足见货币政策提前发力的决心。1 月的金融数据也大幅超预期，社融达到 6.17 万亿的历史高位，同比增加 10.5%，新增信贷 3.98 万亿也创历史新高，虽然 2 月的信贷和社融大幅低于预期，但合并 1-2 月看数据依旧亮眼。出口数据依旧稳定的高增长，基建投资 1-2 月同比增长 8%，制造业投资同比增长 21% 均显示宽信用正在切实出现成效，在去年遭受重创的房地产行业动作频频，预售资金监管放松，相关并购贷不计入“三条红线”，越来越多的城市放松贷款政策。但新冠病毒的新变种也成为了这个季度最大的阴霾，1 月起零星的散发牵涉省份之广让很多城市只能继续鼓励就地过年，至 3 月深圳上海等一线城市一度封城，经济复苏压力不断加大。海外方面，美国通胀高企，2 月下旬俄乌擦枪走火，从闪电战演变成了持久战，大宗商品暴涨，欧美对俄极限制裁，全球资本巨震，让本来就压不住的通胀直冲云霄，3 月美联储按计划开启了加息周期，第一次加息 25bp，而今年的加息预期多的达到 6-7 次，美债利率在短暂的避险下行后大幅上行，至 3 月底中美利差已经缩小到 40bp 以内。

信用要宽，货币先行，央行延续合理充裕政策思路，积极配合地方债的发行，平抑关键时点的资金波动，结构性政策也持续发力，3 月初央行依法向中央财政上缴结存利润超过 1 万亿元，主要用于留抵退税和增加对地方转移支付，支持助企纾困、稳就业保民生。而财政政策也提前发力，一季度地方政府债券净发行达到约 1.67 万亿，占新增额度的约 38%。

一季度民营房地产企业的信用风险依旧，小民营房企违约比比皆是，部分头部房企估值也产生了影响。银行理财子净值化转型虽已基本完毕，权益一季度的大跌使得保本类产品重新获得青睐，对于短久期高流动性品种的需求依旧火热。在此背景下，本基金不断地提高对债券及存单品种的信用管理以及利差挖掘能力，力求将估值风险降到最低。

报告期内，本基金致力于择时配置和利差择期配置，在下行过程中通过判断未来利差走势选择较具性价比的期限配置，保持短期流动性并力求锁定一部分长期资产的收益率。投资品种上选择高评级同业存单为配置主力品种，通过杠杆和久期拉长合理配置资产，做好投资决策，为基金持有人创造收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 3 月 31 日，本基金 A 类份额净值增 0.4893%，同期业绩比较基准增长 0.2988%，基金超额收益率 0.1905%；本基金 B 类份额净值增长 0.5489%，同期业绩比较基准增长 0.2988%，基金超额收益率 0.2501%。

#### 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	2,347,118,466.41	69.71
	其中：债券	2,347,118,466.41	69.71
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	473,254,812.88	14.06
	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	535,774,507.15	15.91
4	其他资产	10,790,649.43	0.32
5	合计	3,366,938,435.87	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	7.98	
	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	107,166,498.97	3.29
	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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 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
报告期末投资组合平均剩余期限	109
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场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比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	20.09	3.29
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	22.68	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	12.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	3.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	44.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	102.75	3.29

## 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

本报告期内本货币市场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	149,548,809.64	4.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,397,347.19	1.24
	其中：政策性金融债	40,397,347.19	1.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	703,332,335.85	21.59
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,453,839,973.73	44.62
8	其他	-	-
9	合计	2,347,118,466.41	72.04
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，付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。

## 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	112104054	21 中国银行 CD054	2,000,000	196,768,995.23	6.04

2	012280289	22 中电投 SCP005	1,500,000	150,565,648.82	4.62
3	112109252	21 浦发银行 CD252	1,500,000	148,304,715.18	4.55
4	012103072	21 陕延油 SCP009	1,000,000	101,164,480.52	3.11
5	012105243	21 电网 SCP029	1,000,000	100,768,100.31	3.09
6	012280638	22 华能水电 SCP004	1,000,000	100,199,746.59	3.08
7	012281021	22 中电投 SCP012	1,000,000	99,940,707.87	3.07
8	112120269	21 广发银行 CD269	1,000,000	99,726,274.43	3.06
9	112113104	21 浙商银行 CD104	1,000,000	99,619,498.19	3.06
10	112109190	21 浦发银行 CD190	1,000,000	99,616,669.14	3.06

### 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	0.0966%
报告期内偏离度的最低值	0.0243%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0678%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本货币市场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

本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

### 5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	-

4	应收申购款	10,790,649.43
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	10,790,649.43

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国富日日收益货币 A	国富日日收益货币 B
报告期期初基金份额总额	2,869,103,710.23	116,797,371.28
报告期期间基金总申购份额	4,853,844,884.50	318,819,782.84
报告期期间基金总赎回份额	4,816,191,136.74	84,301,124.96
报告期期末基金份额总额	2,906,757,457.99	351,316,029.16

## § 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 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金托管协议》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 8.2 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)。

### 8.3 查阅方式

- 1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件。
- 2、登陆基金管理人网站 [www.ftsfund.com](http://www.ftsfund.com) 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司  
2022 年 4 月 22 日