

海富通一年定期开放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：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

§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。

基金托管人中国工商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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	39
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	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41
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	41
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	42
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	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44

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的情况	45
§ 9 开放式基金份额变动	45
§ 10 重大事件揭示	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通一年定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	海富通一年定开债券	
基金主代码	519051	
交易代码	519051	
基金运作方式	契约型开放式，本基金以定期开放方式运作。	
基金合同生效日	2013 年 10 月 24 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	193,609,152.13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通一年定开债券 A	海富通一年定开债券 C
下属分级基金的交易代码	519051	001976
报告期末下属分级基金的份额总额	193,354,619.44 份	254,532.69 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金的投资策略包括债券投资组合策略、信用类债券投资策略、资产支持证券投资策略、杠杆策略、可转换债券投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

注：报告期内本基金于 2023 年 12 月 29 日至 2024 年 1 月 23 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于 2024 年 1 月 24 日表决通过了《关于调整海富通一年定期开放债券型证券投资基金投资范围及修改基金合同有关事项的议案》。2024 年 1 月 24 日起，本基金的业绩比较基准变更为中债综合全价（总值）指数。

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		海富通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	郭明
	联系电话	021-38650788	010-66105799
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	40088-40099	95588
传真	021-33830166	010-66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	杨仓兵	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

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	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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日至2024年6月30日）	
	海富通一年定开债券 A	海富通一年定开债券 C
本期已实现收益	4,585,542.66	3,627.08
本期利润	7,979,269.72	6,963.52
加权平均基金份额本期利润	0.0313	0.0318
本期加权平均净值利润率	2.51%	2.54%
本期基金份额净值增长率	2.64%	2.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
	海富通一年定开债券 A	海富通一年定开债券 C
期末可供分配利润	24,965,781.07	35,046.82

期末可供分配基金份额利润	0.1291	0.1377
期末基金资产净值	220,548,976.66	291,954.54
期末基金份额净值	1.1406	1.1470
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
	海富通一年定开债券 A	海富通一年定开债券 C
基金份额累计净值增长率	126.64%	27.40%

注：1、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。

2、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。

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、本基金自 2015 年 11 月 23 日起，根据收费模式的不同，将基金份额分为 A 类和 C 类。

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

海富通一年定开债券 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	0.73%	0.12%	0.65%	0.03%	0.08%	0.09%
过去三个月	1.85%	0.09%	1.06%	0.07%	0.79%	0.02%
过去六个月	2.64%	0.08%	2.19%	0.06%	0.45%	0.02%
过去一年	3.76%	0.07%	3.57%	0.05%	0.19%	0.02%
过去三年	8.38%	0.07%	9.24%	0.03%	-0.86%	0.04%
自基金合同生效起至今	126.64%	0.47%	37.19%	0.02%	89.45%	0.45%

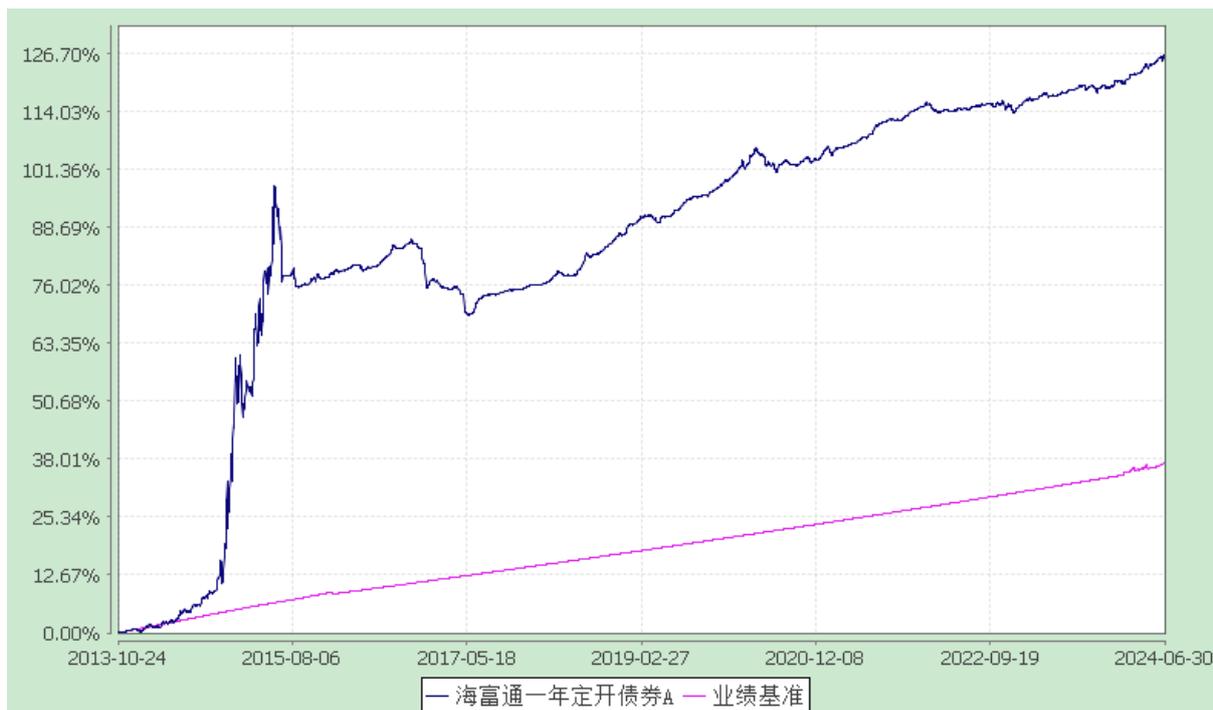
海富通一年定开债券 C

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	0.71%	0.12%	0.65%	0.03%	0.06%	0.09%
过去三个月	1.79%	0.09%	1.06%	0.07%	0.73%	0.02%
过去六个月	2.51%	0.08%	2.19%	0.06%	0.32%	0.02%
过去一年	3.41%	0.07%	3.57%	0.05%	-0.16%	0.02%
过去三年	7.11%	0.07%	9.24%	0.03%	-2.13%	0.04%
自基金合同生效起至今	27.40%	0.11%	26.84%	0.02%	0.56%	0.09%

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

海富通一年定期开放债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013 年 10 月 24 日至 2024 年 6 月 30 日)

海富通一年定开债券 A



海富通一年定开债券 C



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。2024 年 1 月 24 日起，本基金的业绩比较基准变更为中债综合全价（总值）指数。

§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

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 97 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定

期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通瑞鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、海富通优势驱动混合型证券投资基金、海富通 ESG 领先股票型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通数字经济混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
方昆明	本基金的基金经理	2024-03-20	-	14 年	硕士。持有基金从业人员资格证书。历任浙商银行投资经理、民生

					<p>银行投资高级经理、渤海银行上海分行金融市场一部总经理助理、营口银行上海金融中心债券投资交易主管、北京肯特瑞基金销售有限公司产品管理和投资总监、上海富诚海富通资产管理有限公司投资管理部总经理。2021 年 9 月加入海富通基金管理有限公司。2021 年 10 月至 2023 年 11 月任海富通强化回报混合基金经理。2022 年 2 月起兼任海富通集利债券、海富通弘丰定开债券基金经理。2022 年 7 月起兼任海富通上清所短融债券、海富通中债 1-3 年农发基金经理。2023 年 1 月起兼任海富通瑞福债券、海富通裕通 30 个月定开债券基金经理。2023 年 1 月至 2024 年 4 月兼任海富通裕昇三年定开债券基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通一年定开债券、海富通聚合纯债债券基金经理。2024 年 4 月起兼任海富通融丰定开债券基金经理。</p>
夏妍妍	本基金的基金经理	2018-04-23	2024-03-22	9 年	<p>上海交通大学经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生，西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师，2014 年加入海富通基金管理有限公司，历任固定收益投资部固定收益分析师、基金经理助理。2018 年 1 月至 2023 年 1 月任海富通欣益混合基金经理。2018 年 4 月至 2024 年 3 月兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2018 年 4 月至 2021 年 5 月任海富通融丰定开债券基金经理。2019 年 5 月至 2024 年 3 月兼任海富通安颐收益混合基金经理。2019 年 10 月至 2020 年 11 月兼任海富通瑞丰债券基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 9 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2019 年 10 月至 2023 年 4 月兼任海富通富祥混合基金经理。2019 年 10 月至 2024 年 3 月兼任海富通聚合纯债基金</p>

					经理。2020 年 5 月至 2023 年 10 月兼任海富通富盈混合基金经理。2021 年 5 月至 2024 年 3 月兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2021 年 8 月至 2024 年 3 月兼任海富通瑞兴 3 个月定开债券基金经理。2022 年 7 月至 2024 年 3 月兼任海富通策略收益债券基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

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，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

上半年国内经济企稳回升，实际 GDP 增速录得 5%，但整体呈现结构性复苏的格局。具体来看，

生产端修复节奏好于需求端，PMI 在 3 月重回扩张区间，但持续性尚待观察。投资端方面，制造业与基建投资实现高增，地产投资跌幅走扩。需求端外需好于内需，消费增速回落，可选消费与地产后周期消费偏弱，出口同比与贸易顺差双双回升。通胀方面，CPI 总体弹性有限，维持在 0-1% 的区间窄幅震荡；PPI 在基数效应下跌幅收窄但仍未转正。货币政策维持宽松基调，且靠前发力，上半年调降 5 年 LPR25BP，全面降准 50BP，助力经济企稳回升。财政政策方面，超长期特别国债发行计划落地，2024 年将率先发行 1 万亿；同时地方债稳步发行。流动性方面，总体维持合理充裕的状态。资金价格方面，上半年 R001 与 R007 均值为 1.84% 和 2.03%。

上半年债券市场整体呈现牛陡行情，截至 6 月 30 日，1 年国债估值 1.539%，较 2023 年末回落约 54BP；10 年国债估值 2.2058%，回落约 35BP。信用债方面供求矛盾持续，进一步演绎利差压缩行情，信用利差、期限利差多数创历史新低。

可转债方面，上半年中证转债先涨后跌，宽幅震荡，截至 6 月末指数微跌 0.07%。具体来看，市场分化明显，转债指数表现介于 A 股大盘指数与小盘指数之间。

报告期内，本基金主要配置于中高等级信用债，并结合市场情况及利率曲线形态，积极参与利率债交易，同时积极参与可转债的投资交易。5 月末本产品迎来开放期，开放期前组合陆续进行结构调整，降低杠杆，提高组合流动性以应对开放。开放期结束后，产品重新建仓，纯债部分，本基金主要配置于中等久期信用债并结合市场情况及利率曲线形态，积极参与利率债交易。6 月市场风险偏好有所回落，货币政策加码的预期有所升温，组合适度提高久期。转债方面，6 月可转债经历较大幅度调整，本轮调整中，组合增配了部分低价且信用风险较低的可转债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通一年定开债券 A 净值增长率为 2.64%，同期业绩比较基准收益率为 2.19%。海富通一年定开债券 C 净值增长率为 2.51%，同期业绩比较基准收益率为 2.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济或维持修复状态。投资方面，基建在超长期特别国债与地方债发力的情况下有望保持较高的景气度；制造业投资在高技术领域或将继续发力；地产投资在政策端可能仍有调整的空间。通胀方面，CPI 有望维持在正增区间；PPI 在需求端弹性有限，基数效应下跌幅有望继续收窄。货币政策方面，流动性的合理充裕或维持，总量层面仍有降准降息的可能性。财政方面，超长期特别国债持续发力，地方债发行有望提速。基本面方面，当前经济环比动能不足，关注下半年增量政策的出台。后续也需关注政府债券供给节奏，如果节奏加快，可能会对债券市场带来一定的扰动。

总体来看，广谱利率仍处于下行通道中，债牛的基础逻辑暂未打破。不过随着利率持续走低，以及一级供给速度可能有所加快，预计下半年债券市场整体波动有所加大。可转债方面，当前转债市场已经历较大幅度调整，从整体转债市场的纯债溢价率等水平来看已跌至历史低位，部分信用风险较低的转债自身未来的票息收入已经提供了较为充分的安全垫，在下行风险有限的背景下又提供了一定的权益市场潜在弹性，可积极关注。后续组合仍将继续紧密跟踪各类经济和政策信息，结合市场情况，积极运用各类策略，灵活调整组合久期和结构，并优选可转债，积极参与转债的投资交易，争取在合理控制风险的前提下提高组合收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%。

本基金报告期内进行过一次利润分配，以截止 2024 年 06 月 19 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2024 年 06 月 28 日完成权益登记，海富通一年定开债券 A 单位分红金额为 0.1250 元，海富通一年定开债券 C 单位分红金额为 0.1250 元。合计利润分配金额为 24,201,144.46 元。符合基金合同规定。

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

本基金本报告期无需要说明的情形。

§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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——海富通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：海富通一年定期开放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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,428,622.11	358,941.47
结算备付金		1,729,119.17	3,804,963.06
存出保证金		12,004.49	7,568.78
交易性金融资产	6.4.7.2	362,085,551.64	436,849,398.89
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		362,085,551.64	436,849,398.89
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	8,501,676.71	-
应收清算款		-	26,585.76
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		373,756,974.12	441,047,457.96
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
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		127,250,766.58	111,110,537.45
应付清算款		1,272,664.70	28,476.89
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		60,382.46	91,083.00
应付托管费		20,127.46	30,360.99
应付销售服务费		65.66	92.98
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8,794.84	19,425.88
应付利润		24,201,144.46	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	102,096.76	180,762.86
负债合计		152,916,042.92	111,460,740.05
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	193,609,152.13	267,266,984.60
未分配利润	6.4.7.8	27,231,779.07	62,319,733.31
净资产合计		220,840,931.20	329,586,717.91
负债和净资产总计		373,756,974.12	441,047,457.96

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.1406 元，C 类基金份额净值 1.1470 元。基金份额总额 193,609,152.13 份，其中 A 类基金份额 193,354,619.44 份，C 类基金份额 254,532.69 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通一年定期开放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
一、营业总收入		9,862,724.38	5,424,638.99
1.利息收入		86,377.14	802,496.44
其中：存款利息收入	6.4.7.9	47,151.82	83,350.33
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		39,225.32	719,146.11
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,379,283.74	3,803,757.73
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	6,379,283.74	3,803,757.73
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	3,397,063.50	818,384.36
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	0.46
减：二、营业总支出		1,876,491.14	1,114,319.78
1. 管理人报酬		474,323.58	640,587.03
2. 托管费		158,107.88	256,234.75
3. 销售服务费		363.97	742.74
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,110,961.54	102,217.85
其中：卖出回购金融资产支出		1,110,961.54	102,217.85
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		12,186.82	5,916.85
8. 其他费用	6.4.7.17	120,547.35	108,620.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,986,233.24	4,310,319.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,986,233.24	4,310,319.21
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,986,233.24	4,310,319.21

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通一年定期开放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（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	267,266,984.60	-	62,319,733.31	329,586,717.91
二、本期期初净资产	267,266,984.60	-	62,319,733.31	329,586,717.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-73,657,832.47	-	-35,087,954.24	-108,745,786.71
（一）、综合收益总额	-	-	7,986,233.24	7,986,233.24
（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）	-73,657,832.47	-	-18,873,043.02	-92,530,875.49
其中：1.基金申购款	123,471,136.30	-	31,698,464.72	155,169,601.02
2.基金赎回款	-197,128,968.77	-	-50,571,507.74	-247,700,476.51
（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）	-	-	-24,201,144.46	-24,201,144.46
四、本期期末净资产	193,609,152.13	-	27,231,779.07	220,840,931.20
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（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	137,667,995.87	-	91,022,495.71	228,690,491.58
二、本期期初净资产	137,667,995.87	-	91,022,495.71	228,690,491.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	125,188,960.56	-	23,229,125.67	148,418,086.23
（一）、综合收益	-	-	4,310,319.21	4,310,319.21

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)	125,188,960.56	-	84,469,152.82	209,658,113.38
其中: 1.基金申购款	182,220,930.97	-	123,237,727.43	305,458,658.40
2.基金赎回款	-57,031,970.41	-	-38,768,574.61	-95,800,545.02
(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)	-	-	-65,550,346.36	-65,550,346.36
四、本期期末净资产	262,856,956.43	-	114,251,621.38	377,108,577.81

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：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通一年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 1062 号《关于核准海富通一年定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准，由海富通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《海富通一年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，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 488,739,053.00 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 637 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 10 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 488,994,758.95 份，其中认购资金利息折合 255,705.95 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《关于海富通一年定期开放债券型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，自 2015 年 11 月 23 日起，本基金根据申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费

的基金份额的称为 A 类基金份额；从本类基金资产中计提销售服务费，并不再收取认购/申购费用的基金份额的称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，并分别计算基金份额净值。

本基金以定期开放的方式运作，在本基金的封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金的封闭期为自《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效之日起(包括生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期最长不超过 20 个工作日，最短不少于 5 个工作日，开放期的具体时间由基金管理人在开放期前依照《证券投资基金信息披露办法》的有关规定在指定媒体上予以公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款、国债期货等，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（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等权益类资产，但可持有因可转换债券转股所形成的股票等资产。因上述原因持有的股票等权益类资产，基金将在其可交易之日起的 6 个月内卖出。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%（但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制）；本基金持有的股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%。开放期内，本基金每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，封闭期内不受上述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价(总值)指数。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2024 年 8 月 29 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》、《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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 2024 年上半年度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 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度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

本基金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 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 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	1,428,622.11
等于：本金	1,428,245.14
加：应计利息	376.97
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	1,428,622.11

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	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	740,249.57		
	市场	131,664,914.32	131,872,746.73	-532,417.16
	银行间	2,536,804.91		
	市场	225,611,035.52	230,212,804.91	2,064,964.48
	合计	357,275,949.84	362,085,551.64	1,532,547.32
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	357,275,949.84	3,277,054.48	362,085,551.64	1,532,547.32

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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	-	-
银行间市场	8,501,676.71	-
合计	8,501,676.71	-

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。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.6 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	20,047.52
其中：交易所市场	-
银行间市场	20,047.52
应付利息	-
预提费用	82,049.24
合计	102,096.76

6.4.7.7 实收基金

海富通一年定开债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	267,056,861.07	267,056,861.07
本期申购	123,423,871.07	123,423,871.07
本期赎回（以“-”号填列）	-197,126,112.70	-197,126,112.70
本期末	193,354,619.44	193,354,619.44

海富通一年定开债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	210,123.53	210,123.53
本期申购	47,265.23	47,265.23
本期赎回（以“-”号填列）	-2,856.07	-2,856.07
本期末	254,532.69	254,532.69

6.4.7.8 未分配利润

海富通一年定开债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	63,020,445.51	-751,360.66	62,269,084.85
本期期初	63,020,445.51	-751,360.66	62,269,084.85
本期利润	4,585,542.66	3,393,727.06	7,979,269.72
本期基金份额交易产生的变动数	-18,470,879.29	-413,790.25	-18,884,669.54
其中：基金申购款	30,938,501.33	747,584.62	31,686,085.95
基金赎回款	-49,409,380.62	-1,161,374.87	-50,570,755.49
本期已分配利润	-24,169,327.81	-	-24,169,327.81
本期末	24,965,781.07	2,228,576.15	27,194,357.22

海富通一年定开债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	51,718.01	-1,069.55	50,648.46
本期期初	51,718.01	-1,069.55	50,648.46
本期利润	3,627.08	3,336.44	6,963.52
本期基金份额交易产生的变动数	11,518.38	108.14	11,626.52
其中：基金申购款	12,259.58	119.19	12,378.77
基金赎回款	-741.20	-11.05	-752.25
本期已分配利润	-31,816.65	-	-31,816.65
本期末	35,046.82	2,375.03	37,421.85

6.4.7.9 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	11,245.04
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	25,276.64
其他	10,630.14
合计	47,151.82

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 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	5,789,980.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	589,303.34
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	6,379,283.74

6.4.7.11.2 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	765,212,296.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	756,331,640.26
减：应计利息总额	8,271,803.76
减：交易费用	19,549.51
买卖债券差价收入	589,303.34

6.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.15 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	3,397,063.50
——股票投资	-
——债券投资	3,397,063.50
——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	3,397,063.50

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.17 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	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	9,898.11
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
公证费	10,000.00
合计	120,547.35

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

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无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 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	474,323.58	640,587.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	16,980.26	27,979.06
应支付基金管理人的净管理费	457,343.32	612,607.97

注：海富通一年定期开放债券型证券投资基金的管理费率由 0.50% 下调至 0.30%，自 2023 年 8 月 28 日起执行新的管理费率。

2023 年 8 月 28 日之前，支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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 \times 0.50% / 当年天数。

2023 年 8 月 28 日(含)之后，支付基金管理人海富通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 \times 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 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	158,107.88	256,234.75

注：海富通一年定期开放债券型证券投资基金的托管费率由 0.20% 下调至 0.10%，自 2023 年 8 月 28 日起执行新的托管费率。

2023 年 8 月 28 日之前，支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 x0.20%/当年天数。

2023 年 8 月 28 日（含）之后，支付基金托管人的基金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：日基金托管费=前一日基金资产净值 x0.10%/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 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		
	海富通一年定开债券 A	海富通一年定开债券 C	合计
中国工商银行	-	-	-
海通证券	-	-	-
海富通	-	-	-
合计	-	-	-
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		
	海富通一年定开债券 A	海富通一年定开债券 C	合计
中国工商银行	-	-	-
海通证券	-	-	-
海富通	-	0.49	0.49
合计	-	0.49	0.49

注：海富通一年定期开放债券型证券投资基金的销售服务费年费率由 0.40% 下调至 0.25%，自 2024 年 1 月 24 日起执行新的销售服务费费率。

2024 年 1 月 24 日之前，本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.40%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。销售服务费的计算方法如下：日销售服务费=前一日 C 类份额的基金资产净值 x0.40%/当年天数。

2024 年 1 月 24 日（含）之后，本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.25%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.25% 年费率计提，逐日累

计至每月月底,按月支付。销售服务费的计算方法如下:日销售服务费=前一日 C 类份额的基金资产净值 x0.25%/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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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 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	
	海富通一年定开债券A	海富通一年定开债券C	海富通一年定开债券A	海富通一年定开债券C
期初持有的基金份额	25,046,963.06	-	25,046,963.06	-
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	25,046,963.06	-	25,046,963.06	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.95%	-	9.54%	-

注:基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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

本报告期末及上年度末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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		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
中国工商银行	1,428,622.11	11,245.04	4,188,918.17	31,830.99

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**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期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

海富通一年定开债券 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
1	2024-06-28	2024-06-28	1.250	23,596,600.6 4	572,727.17	24,169,327.8 1	-
合计			1.250	23,596,600.6 4	572,727.17	24,169,327.8 1	-

海富通一年定开债券 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2024-06-28	2024-06-28	1.250	20,306.00	11,510.65	31,816.65	-
合计			1.250	20,306.00	11,510.65	31,816.65	-

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

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 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 76,433,842.75 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
232480008	24 中行二级资本债 02A	2024-07-02	102.39	200,000	20,478,473.42
242400005	24 农行永续债 01	2024-07-02	102.83	157,000	16,143,717.27
242380012	23 厦门银行永续债 01	2024-07-02	109.97	100,000	10,996,639.34
230215	23 国开 15	2024-07-02	105.19	100,000	10,519,081.97
102400781	24 涪陵国资 MTN003A	2024-07-02	101.05	100,000	10,105,209.32
230023	23 付息国债 23	2024-07-01	112.69	63,000	7,099,542.30
230210	23 国开 10	2024-07-02	104.35	58,000	6,052,244.38
230210	23 国开 10	2024-07-01	104.35	42,000	4,382,659.73

合计				820,000	85,777,567.73
----	--	--	--	---------	---------------

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 50,816,923.83 元，截至 2024 年 7 月 25 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

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

本基金是一只债券型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要为债券投资等。本基金在日常经营活动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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

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分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。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，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在此可承受的范围内。

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于信用良好的银行，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。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 144.26%（2023 年 12 月 31 日：126.42%）。

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。

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	-	15,140,473.77
合计	-	15,140,473.77

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为短期融资券。

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	180,835,375.24	218,947,381.62
AAA 以下	87,035,047.52	100,525,362.36
未评级	94,215,128.88	102,236,181.14
合计	362,085,551.64	421,708,925.12

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债、政策性金融债、中期票据及无第三方评级机构评级的债券。

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约定开放日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。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

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》且于基金开放期内按照《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发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内，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该比例限制)。

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。在开放期内，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。

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 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	1,428,622.11	-	-	-	1,428,622.11
结算备付金	1,729,119.17	-	-	-	1,729,119.17
存出保证金	12,004.49	-	-	-	12,004.49
交易性金融资产	31,269,025.26	283,322,171.02	47,494,355.36	-	362,085,551.64
买入返售金融资产	8,501,676.71	-	-	-	8,501,676.71
资产总计	42,940,447.74	283,322,171.02	47,494,355.36	-	373,756,974.12
负债					
卖出回购金融资产款	127,250,766.58	-	-	-	127,250,766.58
应付清算款	-	-	-	1,272,664.70	1,272,664.70
应付管理人报酬	-	-	-	60,382.46	60,382.46

应付托管费	-	-	-	20,127.46	20,127.46
应付销售服务费	-	-	-	65.66	65.66
应交税费	-	-	-	8,794.84	8,794.84
应付利润	-	-	-	24,201,144.46	24,201,144.46
其他负债	-	-	-	102,096.76	102,096.76
负债总计	127,250,766.58	-	-	25,665,276.34	152,916,042.92
利率敏感度缺口	-84,310,318.84	283,322,171.02	47,494,355.36	-25,665,276.34	220,840,931.20
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	358,941.47	-	-	-	358,941.47
结算备付金	3,804,963.06	-	-	-	3,804,963.06
存出保证金	7,568.78	-	-	-	7,568.78
交易性金融资产	97,115,473.93	331,722,996.91	8,010,928.05	-	436,849,398.89
应收清算款	-	-	-	26,585.76	26,585.76
资产总计	101,286,947.24	331,722,996.91	8,010,928.05	26,585.76	441,047,457.96
负债					
卖出回购金融资产款	111,110,537.45	-	-	-	111,110,537.45
应付清算款	-	-	-	28,476.89	28,476.89
应付管理人报酬	-	-	-	91,083.00	91,083.00
应付托管费	-	-	-	30,360.99	30,360.99
应付销售服务费	-	-	-	92.98	92.98
应交税费	-	-	-	19,425.88	19,425.88
其他负债	-	-	-	180,762.86	180,762.86
负债总计	111,110,537.45	-	-	350,202.60	111,460,740.05
利率敏感度缺口	-9,823,590.21	331,722,996.91	8,010,928.05	-323,616.84	329,586,717.91

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
	市场利率上升 25 个基点	-4,470,415.14	-3,287,579.74
	市场利率下降 25 个基点	4,598,290.02	3,333,491.49

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债券，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%。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。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资(2023 年 12 月 31 日：同)，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(2023 年 12 月 31 日：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	60,704,034.41	43,100,422.74
第二层次	301,381,517.23	393,748,976.15
第三层次	-	-
合计	362,085,551.64	436,849,398.89

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 2024 年 6 月 30 日,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023 年 12 月 31 日:无)。

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、买入返售金融资产、卖出回购金融资产和其他金融负债,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	362,085,551.64	96.88
	其中：债券	362,085,551.64	96.88
	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	8,501,676.71	2.27
	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	3,157,741.28	0.84
8	其他各项资产	12,004.49	0.00
9	合计	373,756,974.12	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

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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买入股票。

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卖出股票。

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进行股票交易。

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	22,538,229.51	10.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	156,455,424.67	70.85
	其中：政策性金融债	20,953,986.08	9.49
4	企业债券	50,932,147.59	23.06
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	71,455,715.46	32.36
7	可转债（可交换债）	60,704,034.41	27.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	362,085,551.64	163.96

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	230023	23 付息国债 23	200,000	22,538,229.51	10.21
2	242400005	24 农行永续债 01	200,000	20,565,244.93	9.31
3	232480008	24 中行二级资本债 02A	200,000	20,478,473.42	9.27
4	102480560	24 中航租赁 MTN002	200,000	20,442,360.66	9.26
5	148603	24 广发 04	200,000	20,346,273.97	9.21

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。国债期货相关投资严格遵循法律法规及中国证监会的规定。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中国银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚，广发证券股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到中国人民银行广东省分行、中国证券监督管理委员会的处罚，徽商银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局安徽监管局的处罚，中国建设银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，杭州联合农村商业银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到浙江银保监局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	12,004.49
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,004.49

7.12.4 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	113052	兴业转债	4,562,457.02	2.07
2	113633	科沃转债	4,244,254.73	1.92
3	110076	华海转债	3,036,521.11	1.37
4	127024	盈峰转债	2,991,974.38	1.35
5	113605	大参转债	2,588,413.27	1.17
6	113644	艾迪转债	2,551,512.78	1.16
7	113584	家悦转债	2,495,760.52	1.13
8	123071	天能转债	2,471,914.49	1.12
9	128134	鸿路转债	2,393,489.05	1.08
10	128071	合兴转债	2,281,007.03	1.03
11	113657	再 22 转债	2,248,929.99	1.02
12	113606	荣泰转债	2,228,443.84	1.01
13	123120	隆华转债	2,124,108.44	0.96
14	127088	赫达转债	1,619,641.64	0.73
15	118038	金宏转债	1,503,417.38	0.68
16	128131	崇达转 2	1,281,153.63	0.58
17	111014	李子转债	1,195,046.94	0.54
18	110081	闻泰转债	1,189,226.96	0.54
19	123154	火星转债	1,074,861.84	0.49
20	128125	华阳转债	1,051,246.19	0.48
21	123115	捷捷转债	1,036,485.37	0.47
22	123124	晶瑞转 2	1,001,593.88	0.45

23	113636	甬金转债	978,406.88	0.44
24	113676	荣 23 转债	879,080.75	0.40
25	123113	仙乐转债	867,240.00	0.39
26	128117	道恩转债	864,742.29	0.39
27	127062	垒知转债	831,644.48	0.38
28	113625	江山转债	720,544.60	0.33
29	127051	博杰转债	646,495.63	0.29
30	110079	杭银转债	603,836.16	0.27
31	127025	冀东转债	569,172.85	0.26
32	127077	华宏转债	556,147.40	0.25
33	118032	建龙转债	499,530.14	0.23
34	127017	万青转债	492,671.69	0.22
35	113059	福莱转债	482,790.49	0.22
36	123165	回天转债	475,500.36	0.22
37	128109	楚江转债	443,306.08	0.20
38	128066	亚泰转债	437,652.60	0.20
39	128087	孚日转债	428,511.20	0.19
40	127059	永东转 2	427,784.72	0.19
41	123126	瑞丰转债	385,699.62	0.17
42	123104	卫宁转债	273,180.64	0.12
43	123119	康泰转 2	231,018.63	0.10
44	123063	大禹转债	224,246.96	0.10
45	110064	建工转债	223,167.29	0.10
46	128116	瑞达转债	210,816.66	0.10
47	128142	新乳转债	145,962.68	0.07
48	127026	超声转债	111,813.97	0.05
49	111004	明新转债	106,263.84	0.05
50	113046	金田转债	104,132.05	0.05
51	113053	隆 22 转债	101,750.36	0.05
52	123169	正海转债	75,672.01	0.03
53	123178	花园转债	61,899.11	0.03
54	118024	冠宇转债	50,440.83	0.02
55	113643	风语转债	21,450.96	0.01

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
海富通一年定开债券 A	722	267,804.18	184,063,359.28	95.19%	9,291,260.16	4.81%
海富通一年定开债券 C	122	2,086.33	-	-	254,532.69	100.00%
合计	844	229,394.73	184,063,359.28	95.07%	9,545,792.85	4.93%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,A、C级比例分母为各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

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	海富通一年定开债券 A	7,952.57	0.0041%
	海富通一年定开债券 C	97.46	0.0383%
	合计	8,050.03	0.0042%

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的情况

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	海富通一年定开债券 A	0
	海富通一年定开债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通一年定开债券 A	0~10
	海富通一年定开债券 C	0
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通一年定开债券 A	海富通一年定开债券 C
基金合同生效日(2013年10月24日)基金份额总额	488,994,758.95	-
本报告期期初基金份额总额	267,056,861.07	210,123.53
本报告期基金总申购份额	123,423,871.07	47,265.23

减：本报告期基金总赎回份额	197,126,112.70	2,856.07
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	193,354,619.44	254,532.69

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2023 年 12 月 29 日至 2024 年 1 月 23 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于 2024 年 1 月 24 日表决通过了《关于调整海富通一年定期开放债券型证券投资基金投资范围及修改基金合同有关事项的议案》，已按规定向中国证券监督管理委员会进行了备案。详情请参考本基金管理人发布的相关公告。

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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略部分增加了国债期货投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

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，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其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	
海通证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-

兴业证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内未新增交易单元，退租方正证券 1 个交易单元。

2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉、研究水平和综合服务支持三个部分进行评议，形成证券公司交易单元租用意见。

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门内部讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会审议。

<2> 核准。在完成对证券公司的评估和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

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		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
海通证券	361,051,315.67	100.00%	1,481,180,000.00	100.00%	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

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	海富通基金管理有限公司关于海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-26
2	海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-21
3	海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-23
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增京东肯特瑞基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-17
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-07
6	海富通一年定期开放债券型证券投资基金开	证券时报、基金管理人网	2024-05-24

	放申购、赎回、转换业务公告	站及中国证监会基金电子披露网站	
7	海富通基金管理有限公司关于海富通一年定期开放债券型证券投资基金提前结束开放期并进入下一封闭期的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-31
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-25
9	海富通一年定期开放债券型证券投资基金第五次分红公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-26

§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	2024/5/31-2024/6/30	-	55,696,212.60	-	55,696,212.60	28.77%
	2	2024/1/1-2024/5/30	89,205,471.31	-	89,205,471.31	-	-

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额；
- 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；
- 4、其他可能的风险。

另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 123 只公募基金。截至 2024 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1613 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联《上海证券报》颁发的“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获中国保险资产管理业协会颁发的“IAMAC 推介 2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《上海证券报》颁发的“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证·中国基金投教创新案例奖”。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通一年定期开放债券型证券投资基金的文件
- (二)海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同
- (三)海富通一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通一年定期开放债券型证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日