

海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）

2026 年中期报告

2026 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 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 2026 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 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	38
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	38
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	39
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	39
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	39
7.11 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息	40

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
§9 开放式基金份额变动	41
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	42
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	42
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	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）
基金简称	海富通美元债(QDII)
场内简称	美元债 LOF
基金主代码	501300
交易代码	501300
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 28 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
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	2,272,234,583.28 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2017 年 2 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球债券市场，在严格控制组合风险的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过分析各区域、国家的宏观经济环境、景气程度、总体经济指标、政治形势、货币政策、利差变化、利率水平、汇率水平等，确定基金资产在国家与地区间的配置及投资情况。
业绩比较基准	$90\% \times \text{巴克莱资本美国综合债券指数收益率} + 10\% \times \text{商业银行税后活期存款基准利率}$
风险收益特征	本基金为债券型基金，主要投资于全球市场的各类美元债券，属于证券投资基金中的较低风险品种，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。本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66596688
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区	北京市西城区复兴门内大街1

	陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	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1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	谢乐斌	葛海蛟

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行（香港）有限公司
注册地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	-

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.6 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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	16,779,991.11
本期利润	-58,964,474.53
加权平均基金份额本期利润	-0.0259
本期加权平均净值利润率	-2.71%

本期基金份额净值增长率	-2.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-126,097,131.93
期末可供分配基金份额利润	-0.0555
期末基金资产净值	2,146,137,451.35
期末基金份额净值	0.9445
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-5.55%

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)。

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	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
过去三个月	-1.29%	0.19%	-0.81%	0.23%	-0.48%	-0.04%
过去六个月	-2.68%	0.21%	-2.23%	0.25%	-0.45%	-0.04%
过去一年	-2.53%	0.19%	-1.08%	0.23%	-1.45%	-0.04%
过去三年	-0.76%	0.23%	5.99%	0.31%	-6.75%	-0.08%
过去五年	-9.51%	0.44%	5.55%	0.38%	-15.06%	0.06%
过去七年	-9.66%	0.40%	7.40%	0.36%	-17.06%	0.04%
自基金合同生效 起至今	-5.55%	0.36%	16.73%	0.34%	-22.28%	0.02%

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

海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）
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
(2016 年 11 月 28 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于 2016 年 11 月 28 日生效。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。

§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，于 2003 年 4 月 1 日发起设立。目前，公司的股东为国泰海通证券股份有限公司、法国巴黎资产管理 BE 控股公司，注册资本为 3 亿元人民币。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下运作的公募基金共有 100 只，分别是：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 A100 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、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、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、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、海富通量化选股混合型证券投资基金、海富通上证基准做市公司债交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、海富通远见回报混合型证券投资基金、海富通配置优选三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、海富通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、海富通致远量化选股股票型发起式证券投资基金、海富通添合收益债券型证券投资基金、海富通聚益优选三个月持有期债券型基金中基金（FOF）、海富通瑞颐 30 天滚动持有债券型证券投资基金、海富通瑞泽 90 天持有期债券型发起式证券投资基金、海富通沪港深医疗创新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		
陈阳	本基金的基金经理	2026-05-21	-	10 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2015 年 7 月加入海富通基金管理有限公司，历任助理固定收益分析师、固定收益分析师、高级固定收益分析师、投资经理助理、投资经理。2026 年 5 月起任海富通美元债(QDII) 基金经理。
陶斐然	本基金的基金经理	2024-03-20	-	11 年	金融学硕士，持有基金从业人员资格证书。2014 年 12 月加入海富通基金管理有限公司，历任助理交易员、交易员、高级交易员。2020 年 6 月至 2023 年 6 月任债券基金部基金经理助理。2023 年 6 月起任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF、海富通上证投资级可转债 ETF、海富通中证短融 ETF、海富通上证 10 年

					期地方政府债 ETF、海富通上证城投债 ETF 基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2025 年 1 月起兼任海富通上证基准做市公司债 ETF 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间

未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，美债主要围绕贸易摩擦、中东地缘油价冲击与美联储政策转向预期进行交易，收益率中枢震荡抬升。年初，美国对欧关税威胁推升通胀与政策不确定性溢价；同期，鹰派色彩浓厚的沃什被提名美联储主席，降息预期降温，收益率上行。2 月，美国劳动力市场疲软、通胀数据降温，叠加美股 AI 及软件板块大幅回调，避险情绪提振债市，美债收益率大幅下行。3 月以后，行情更多围绕美伊局势与通胀预期波动：霍尔木兹海峡局势紧张持续扰动油价，叠加美国经济数据好于预期，市场加息预期升温，10 年期美债收益率一度突破 4.6%。后续美伊谈判取得进展、油价冲高回落，通胀溢价逐步收敛，但新任美联储主席沃什释放鹰派言论，压制宽松预期，美债收益率波动中枢较年初抬升。上半年，2 年期美债收益率上行 67bps 至 4.14%，10 年期美债收益率上行 26bps 至 4.44%，曲线平坦化。

2026 年上半年，中资美元债券指数整体上涨，回报弱于上年同期。一级市场上，金融是发债主力；城投平台在境内化债政策约束下，境外新增融资意愿和能力均下降；地产企业信用修复缓慢，境外渠道仍受限；与城投、地产相比，产业债中的央国企和互联网企业融资需求相对稳定。收益率方面，截至 2026 年 6 月 30 日，iBoxx 亚洲中资美元债指数收益率为 5.33%，较年初上行 50bp；投资级指数收益率为 4.90%，较年初上行 30bp；高收益级指数收益率为 13.99%，较年初上行 408bp。由于短端美债收益率上行幅度更大，iBoxx 亚洲中资美元债收益率和 2 年期美债利差较年初下行约 17bp。

本基金上半年仍以中短久期投资级信用债作为票息底仓，以中长久期美国国债调节组合久期。二季度，美债波动加大、收益率中枢抬升，本基金择机适度提升了信用类资产的占比，以优化组合静态收益。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-2.68%，同期业绩比较基准收益率为-2.23%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，美债配置价值依托高静态凸显，但预计单边趋势行情空间有限。基本上，美国 AI 相关投资仍具支撑，但难以对冲其他行业的结构性走弱，K 型分化的格局仍将延续。劳动力市场“低雇佣、低解雇”的特征延续，失业率上行空间有限，但劳动力市场整体缺少活力、流动性较弱。在油

价未失控的假设下，总体通胀将步入回落通道，但难以快速回落至美联储合意区间内，美联储加息与降息操作空间均有限，预计美债以宽幅震荡为主，波动中枢较上半年抬升。此外，若沃什推动取消传统利率前瞻指引，政策判断更依赖实时数据，美债波动率或进一步抬升，推动期限溢价上行。

中资美元债市场或呈供给偏紧、板块分化的运行特征。收益率核心驱动因素取决于美联储货币政策路径与供需关系。受境外融资成本高企、城投化债政策等因素影响，一级以头部央国企、金融机构、优质平台新发为主，弱资质区县平台、民营地产新发受阻，供给规模预计延续收缩态势；与此同时，南向需求不断扩容，预计优质投资级中资美元债仍处于供不应求的状态。目前中资美元债信用利差已处于历史低位，进一步压缩空间不大，叠加基础利率“更高更久”的预期，资本利得空间有限，收益来源更依赖票息。

下半年，本基金将继续以投资级信用债和美国国债为主要投资标的。考虑到下半年美债的波动不确定性或上升，本基金将择机适度提升投资级信用债占比、优化静态收益，并择机适度调整组合久期。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

- 一、本基金本报告期内无应分配的收益。
- 二、已实施的利润分配：无。
- 三、不存在应分配但尚未实施的利润。

4.9 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，中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）(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）、投资组合报告等财务数据真实、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：海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	51,933,851.06	149,991,704.59
结算备付金		5,951,680.20	6,078,224.24
存出保证金		109.92	109.72

交易性金融资产	6.4.7.2	2,104,928,764.82	2,020,677,081.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,104,928,764.82	2,020,677,081.40
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	-	-
应收清算款		6,381,404.65	-
应收股利		-	-
应收申购款		158,813.67	2,161,879.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,169,354,624.32	2,178,908,999.01
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		-	-
应付清算款		20,499,836.54	-
应付赎回款		966,531.74	261,294.35
应付管理人报酬		1,066,475.93	1,088,532.87
应付托管费		355,491.97	362,844.28
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		236,867.69	212,486.84
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	91,969.10	166,441.04
负债合计		23,217,172.97	2,091,599.38
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,272,234,583.28	2,243,082,022.86
未分配利润	6.4.7.8	-126,097,131.93	-66,264,623.23
净资产合计		2,146,137,451.35	2,176,817,399.63
负债和净资产总计		2,169,354,624.32	2,178,908,999.01

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9445 元，基金份额总额 2,272,234,583.28 份。其中下属人民币基金份额参考净值人民币 0.9445 元，份额总额 2,262,381,626.01 份；下属美元基金份额参考净值 0.1387 美元，份额总额 9,852,957.27 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-50,091,928.09	25,188,471.61
1.利息收入		215,554.76	54,866.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	207,377.29	54,866.07
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		8,177.47	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		27,226,482.79	20,379,333.66
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-2,848.91	-
债券投资收益	6.4.7.12	27,226,882.12	20,379,333.66
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	2,449.58	-
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	-75,744,465.64	7,826,552.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-2,204,226.66	-3,162,113.64
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	414,726.66	89,833.02
减：二、营业总支出		8,872,546.44	3,861,583.22
1. 管理人报酬		6,476,412.57	2,779,425.88
2. 托管费		2,158,804.19	926,475.31
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		148,366.74	59,409.81
8. 其他费用	6.4.7.17	88,962.94	96,272.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-58,964,474.53	21,326,888.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-58,964,474.53	21,326,888.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		-58,964,474.53	21,326,888.39
----------	--	----------------	---------------

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	2, 243, 082, 022. 86	-	-66, 264, 623. 23	2, 176, 817, 39 9. 63
二、本期期初净资产	2,243,082,022.86	-	-66,264,623.23	2,176,817,399. 63
三、本期增减变动 额（减少以“-” 号填列）	29,152,560.42	-	-59,832,508.70	-30,679,948.2 8
（一）、综合收益 总额	-	-	-58,964,474.53	-58,964,474.5 3
（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）	29,152,560.42	-	-868,034.17	28,284,526.25
其中：1.基金申购 款	234,421,238.35	-	-9,350,157.36	225,071,080.9 9
2.基金赎回 款	-205,268,677.93	-	8,482,123.19	-196,786,554. 74
（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、本期期末净资产	2,272,234,583.28	-	-126,097,131.93	2,146,137,451. 35
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	872, 652, 514. 13	-	-46, 042, 561. 60	826, 609, 952. 53

二、本期期初净资产	872,652,514.13	-	-46,042,561.60	826,609,952.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	489,058,561.55	-	3,895,161.71	492,953,723.26
（一）、综合收益总额	-	-	21,326,888.39	21,326,888.39
（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）	489,058,561.55	-	-17,431,726.68	471,626,834.87
其中：1.基金申购款	555,465,350.03	-	-20,477,170.77	534,988,179.26
2.基金赎回款	-66,406,788.48	-	3,045,444.09	-63,361,344.39
（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、本期期末净资产	1,361,711,075.68	-	-42,147,399.89	1,319,563,675.79

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

海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）（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[2016]第 2277 号《关于准予海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）注册的批复》注册，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《海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，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 139,713,588.15 元，美元 17,977,789.63 元，已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(2016)第 1495 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 11 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额

为 263,399,284.82 份，其中认购资金利息折合 42,026.34 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据《海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）基金合同》和《海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）招募说明书》的相关规定，本基金的基金份额包括人民币份额和美元现汇份额，投资者可使用人民币或美元提交本基金的认购/申购申请，其中使用人民币认购/申购的份额将被确认为人民币份额，使用美元认购/申购的份额将被确认为美元现汇份额。本基金通过场外、场内两种方式公开发售，美元份额(以下若无特别说明，均指美元现汇份额)仅通过场外公开发售。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)[2017]35 号文审核同意，本基金 14,122,415.00 份人民币基金份额于 2017 年 2 月 16 日在上交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至上交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为境内境外市场。境内，本基金主要投资于依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、其他依法上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等，货币市场工具以及经中国证监会批准允许基金投资的其他境内金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。境外，本基金主要投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括 ETF）；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他境外金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于美元债券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：90%×巴克莱资本美国综合债券指数收益率+10%×商业银行税后活期存款基准利率。

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 2026 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）发布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 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

根据财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》财税[2016]140 号文《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 号文《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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)目前税收政策法规未对合格境内机构投资者（“QDII”）产品的税收处理给予特别的说明。在法规未有明确说明的情况下，参考现有的针对证券投资基金的税收法规进行处理。

(b)目前本基金取得的源自境外的差价收入和股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(c)本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入,截至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(d)对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(e)对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

(f)对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	51,933,851.06
等于：本金	51,931,674.43

加：应计利息	2,176.63
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	51,933,851.06

注：于 2026 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：美元活期存款 4,009,019.27 美元（折合人民币 27,305,029.34 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 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		21,925,843.58		
	市场	2,075,219,204.70		2,004,128,422.35	-93,016,625.93
	银行间		695,342.47		
	市场	100,085,450.00		100,800,342.47	19,550.00
合计		2,175,304,654.70	22,621,186.05	2,104,928,764.82	-92,997,075.93
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,175,304,654.70	22,621,186.05	2,104,928,764.82	-92,997,075.93

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,526.54
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,140.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	1,140.00
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	91,969.10

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,243,082,022.86	2,243,082,022.86
本期申购	234,421,238.35	234,421,238.35
本期赎回（以“-”号填列）	-205,268,677.93	-205,268,677.93
本期末	2,272,234,583.28	2,272,234,583.28

注：截至 2026 年 6 月 30 日止，本基金于上交所上市的基金份额为 1,644,441,845.00 份（2025 年 12 月 31 日：1,453,440,159.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 627,792,738.28 份（2025 年 12 月 31 日：789,641,863.86 份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

6.4.7.8 未分配利润

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	-123,833,217.13	57,568,593.90	-66,264,623.23
本期期初	-123,833,217.13	57,568,593.90	-66,264,623.23
本期利润	16,779,991.11	-75,744,465.64	-58,964,474.53
本期基金份额交易产生的变动数	-1,624,779.02	756,744.85	-868,034.17
其中：基金申购款	-12,223,108.06	2,872,950.70	-9,350,157.36
基金赎回款	10,598,329.04	-2,116,205.85	8,482,123.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-108,678,005.04	-17,419,126.89	-126,097,131.93

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	207,371.59
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	5.50
其他	0.20
合计	207,377.29

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 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	713,289.89
减：卖出/赎回基金成本总额	716,138.80
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	-
基金投资收益	-2,848.91

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	41,293,617.67

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-14,066,735.55
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	27,226,882.12

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	590,057,100.18
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	596,536,024.30
减：应计利息总额	7,586,836.43
减：交易费用	975.00
买卖债券差价收入	-14,066,735.55

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	-
基金投资产生的股利收益	2,449.58
合计	2,449.58

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-75,744,465.64
——股票投资	-
——债券投资	-75,744,465.64
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	-75,744,465.64

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	411,297.53
其他	3,429.13
合计	414,726.66

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
银行汇划费	4,660.38
合计	88,962.94

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

截至本财务报表批准报出日，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、关联关系

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	基金境外资产托管人
国泰海通证券股份有限公司(“国泰海通证券”)	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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,476,412.57	2,779,425.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,127,740.41	449,895.99
应支付基金管理人的净管理费	5,348,672.16	2,329,529.89

注：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 0.60%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 x0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,158,804.19	926,475.31

注：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。

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
期初持有的基金份额	10,759,629.87	10,759,629.87
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	10,759,629.87	10,759,629.87
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.48%	0.80%

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
国泰海通证券	-	-	8,400,000.00	0.3760%
合计	-	-	8,400,000.00	0.3760%

注：上述关联方投资本基金的相关费用符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	11,451,915.65	207,371.59	54,035,931.08	52,397.85

中银香港	40,481,935.41	-	83,204,471.87	-
合计	51,933,851.06	207,371.59	137,240,402.95	52,397.85

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

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 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有股票。

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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

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

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，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。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在严格控制风险的基础上，追求基金资产长期稳定增值,力争实现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在本基金的托管行中国银行以及境外次托管行中银香港，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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	97,311,613.30
A-1 以下	-	-
未评级	5,032,409.59	-
合计	5,032,409.59	97,311,613.30

注：未评级部分为标准普尔、惠誉国际未评级债券。

6.4.13.2 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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	1,710,054,940.90	1,694,602,444.27
未评级	389,841,414.33	228,763,023.83
合计	2,099,896,355.23	1,923,365,468.10

注：未评级部分为标准普尔、惠誉国际未评级债券。

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可随时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》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。

本基金持有同一家银行的存款不得超过本基金净值的 20%（在基金托管账户的存款可以不受上述限制），本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

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。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。

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 2026 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	11,451,915.65	-	-	40,481,935.41	51,933,851.06
结算备付金	871.44	-	-	5,950,808.76	5,951,680.20
存出保证金	109.92	-	-	-	109.92

交易性金融资产	341,163,580.98	582,855,352.33	1,180,909,831.51	-	2,104,928,764.82
应收清算款	-	-	-	6,381,404.65	6,381,404.65
应收申购款	-	-	-	158,813.67	158,813.67
资产总计	352,616,477.99	582,855,352.33	1,180,909,831.51	52,972,962.49	2,169,354,624.32
负债					
应付清算款	-	-	-	20,499,836.54	20,499,836.54
应付赎回款	-	-	-	966,531.74	966,531.74
应付管理人报酬	-	-	-	1,066,475.93	1,066,475.93
应付托管费	-	-	-	355,491.97	355,491.97
应交税费	-	-	-	236,867.69	236,867.69
其他负债	-	-	-	91,969.10	91,969.10
负债总计	-	-	-	23,217,172.97	23,217,172.97
利率敏感度缺口	352,616,477.99	582,855,352.33	1,180,909,831.51	29,755,789.52	2,146,137,451.35
上年度末 2025 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	143,515,890.44	-	-	6,475,814.15	149,991,704.59
结算备付金	865.94	-	-	6,077,358.30	6,078,224.24
存出保证金	109.72	-	-	-	109.72
交易性金融资产	433,807,739.88	544,442,816.16	1,042,426,525.36	-	2,020,677,081.40
应收申购款	-	-	-	2,161,879.06	2,161,879.06
资产总计	577,324,605.98	544,442,816.16	1,042,426,525.36	14,715,051.51	2,178,908,999.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	261,294.35	261,294.35
应付管理人报酬	-	-	-	1,088,532.87	1,088,532.87
应付托管费	-	-	-	362,844.28	362,844.28
应交税费	-	-	-	212,486.84	212,486.84
其他负债	-	-	-	166,441.04	166,441.04
负债总计	-	-	-	2,091,599.38	2,091,599.38
利率敏感度缺口	577,324,605.98	544,442,816.16	1,042,426,525.36	12,623,452.13	2,176,817,399.6

					3
--	--	--	--	--	---

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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-22,716,203.70	-24,869,064.93
	市场利率下降 25 个基点	22,721,620.36	24,874,965.42

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末	
	2026年6月30日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
银行存款	27,305,029.34	27,305,029.34
结算备付金	3,955,558.76	3,955,558.76
交易性金融资产	1,988,554,320.98	1,988,554,320.98
应收申购款	204.12	204.12
应收证券清算款	6,381,404.65	6,381,404.65
资产合计	2,026,196,517.85	2,026,196,517.85

以外币计价的 负债		
应付证券清算 款	20,499,836.54	20,499,836.54
应付赎回款	54,168.93	54,168.93
其他负债	298.86	298.86
负债合计	20,554,304.33	20,554,304.33
资产负债表外 汇风险敞口净 额	2,005,642,213.52	2,005,642,213.52
项目	上年度末 2025年12月31日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的 资产		
银行存款	35,264,479.67	35,264,479.67
结算备付金	4,082,108.30	4,082,108.30
交易性金融资 产	2,020,677,081.40	2,020,677,081.40
应收申购款	225.41	225.41
资产合计	2,060,023,894.78	2,060,023,894.78
以外币计价的 负债		
应付赎回款	7,250.98	7,250.98
其他负债	27.27	27.27
负债合计	7,278.25	7,278.25
资产负债表外 汇风险敞口净 额	2,060,016,616.53	2,060,016,616.53

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	100,282,110.68	103,000,830.83
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-100,282,110.68	-103,000,830.83

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 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资(2025 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(2025 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	2,104,928,764.82	2,020,677,081.40

第三层次	-	-
合计	2,104,928,764.82	2,020,677,081.40

6.4.14.2 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 2026 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(2025 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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

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：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,104,928,764.82	97.03
	其中：债券	2,104,928,764.82	97.03
	资产支持证券	-	-

4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	57,885,531.26	2.67
8	其他各项资产	6,540,328.24	0.30
9	合计	2,169,354,624.32	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期末未买入权益资产。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期末未卖出权益资产。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期末未进行权益投资。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
--------	------	--------------

AAA+至 AAA-	-	-
AA+至 AA-	1,139,701,363.12	53.10
A+至 A-	214,340,255.37	9.99
BBB+至 BBB-	356,013,322.41	16.59
BB+至 BB-	-	-
B+至 B-	-	-
未评级	394,873,823.92	18.40

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、惠誉等机构提供的债券信用评级信息，未提供评级信息的可适用内部评级。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	US91282CPJ44	T 4 11/15/35	280,000	185,109,088.58	8.63
2	US91282CMM00	T 4 5/8 02/15/35	260,000	182,692,107.77	8.51
3	US91282CNC19	T 4 1/4 05/15/35	260,000	175,651,147.56	8.18
4	US91282CPA35	T 3 5/8 09/30/30	140,000	94,039,690.59	4.38
5	US91282CNT44	T 4 1/4 08/15/35	120,000	81,860,903.24	3.81

注：（1）债券代码为 ISIN 或当地市场代码。

（2）外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留 2 位小数。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在本报告编制日前一年内曾受到国家

外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚，中国农业发展银行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。

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。

7.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约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	109.92
2	应收清算款	6,381,404.65
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	158,813.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,540,328.24

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

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	持有份额	占总份额

			比例		比例
25,348	89,641.57	1,782,841,013.89	78.46%	489,393,569.39	21.54%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	412,173.95	0.0181%

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 11 月 28 日）基金份额总额	263,399,284.82
本报告期期初基金份额总额	2,243,082,022.86
本报告期基金总申购份额	234,421,238.35
减：本报告期基金总赎回份额	205,268,677.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,272,234,583.28

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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

基金管理人：

2026 年 4 月 30 日，海富通基金管理有限公司发布公告，魏峻先生不再担任公司副总经理。

2026 年 5 月 23 日，海富通基金管理有限公司发布公告，总经理任志强先生自 2026 年 5 月 22 日起兼任公司首席信息官，陶网雄先生不再担任公司首席信息官。

基金托管人：

本报告期内，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

报告期内，无涉及本基金基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人无受调查或处罚情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
BANK OF CHINA (HONG KONG)	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International plc	-	-	-	-	-	-
CICC HK SEC. LTD.	-	-	-	-	-	-
CGS International Holdings	-	-	-	-	-	-

Limited						
Citigroup Global Markets Limited, London.	-	-	-	-	-	-
China Securities (International) Brokerage Co. Ltd	-	-	-	-	-	-
HUATAI FINANCIAL HOLDINGS (HONG KONG) LIMITED	-	-	-	-	-	-
Jane Street Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-
CSI Global Markets Limited	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities (Singapore) PTE LTD	-	-	-	-	-	-
China CITIC Bank International Limited	-	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
GUOTAI JUNAN SECURITIES (HONG KONG) LIMITED	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-

GOLDMAN SACHS (ASIA) SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSUE EUROPE LTD	-	-	-	-	-	-
ICBC International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-
Nomura International plc	-	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金新增租用华泰证券 2 个券商交易单元，中信证券 2 个券商交易单元。

2、交易单元的选择标准：

基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司，并在该机构开立交易账户。

3、交易单元的选择程序：

- 1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。
- 2）基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

10.7.2 基金租用或者通过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		基金交易	
	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	成交 金额	占当期基 金成交总 额的比例
BAN K OF CHI NA (HO NG KON G)	373,6 14,03 5.40	41.14%	-	-	-	-	-	-
Morg an Stanl ey & Co.	78,27 9,428 .46	8.62%	-	-	-	-	-	-

Inter natio nal plc								
CICC HK SEC. LTD.	77,72 7,564 .15	8.56%	-	-	-	-	-	-
CGS Inter natio nal Holdi ngs Limit ed	74,95 2,365 .11	8.25%	-	-	-	-	-	-
Citigr oup Glob al Mark ets Limit ed, Lond on.	73,29 0,935 .43	8.07%	-	-	-	-	-	-
Chin a Secur ities (Inter natio nal) Brok erage Co. Ltd	60,13 2,841 .35	6.62%	-	-	-	-	-	-
HUA TAI FINA NCI AL HOL DIN GS	58,82 2,393 .26	6.48%	-	-	-	-	-	-

(HONG KONG) LIMITED								
Jane Street Hong Kong Limited	40,676,949.43	4.48%	-	-	-	-	209,500.00	100.00%
CSI Global Markets Limited	27,092,893.02	2.98%	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities (Singapore) PTE LTD	24,907,085.14	2.74%	-	-	-	-	-	-
China CITI Bank International Limited	13,566,770.10	1.49%	-	-	-	-	-	-
中信证券	5,004,850.00	0.55%	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered	-	-	-	-	-	-	-	-

Bank								
UBS Secur ities Asia Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
GUO TAI JUN AN SEC URIT IES (HO NG KON G) LIMI TED	-	-	-	-	-	-	-	-
J.P. Morg an Secur ities (Asia Pacifi c) Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
GOL DMA N SAC HS (ASI A) SEC URIT IES LIMI TED	-	-	-	-	-	-	-	-
CRE DIT SUIS	-	-	-	-	-	-	-	-

SUE EUR OPE LTD								
ICBC Inter natio nal Holdi ngs Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Nom ura Inter natio nal plc	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 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全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）人民币份额新增长城证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-06
2	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）调整大额申购业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-09
3	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）节假日暂停申购、赎回业务公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-15
4	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）调整大额申购业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-27
5	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）调整大额申购业务限额并设置总规模上限的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-16
6	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）节假日暂停申购、赎回业务公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31

7	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-30
8	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）节假日暂停申购、赎回业务公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-21
9	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-22
10	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
11	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）调整大额申购业务限额及总规模上限的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-05
12	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）节假日暂停申购、赎回业务公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-29

§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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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 137 只公募基金。截至 2026 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 3108 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。2008 年 3 月，海富通获批从事特定客户资产管理业务。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，中国保险监督管理委员会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人。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。

§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全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）的文件
- (二)海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）基金合同

(三)海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）招募说明书

(四)海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）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它文件

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

二〇二六年八月三十一日