

海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金
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	6
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遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	52
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	52
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	52
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 本报告期投资基金情况	53
7.13 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	55

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	57
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
10.8 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	58
10.9 其他重大事件	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金	
基金简称	海富通添利收益一年持有期债券	
基金主代码	019038	
交易代码	019038	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 11 月 7 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	946,113,181.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通添利收益一年持有期债券 A	海富通添利收益一年持有期债券 C
下属分级基金的交易代码	019038	019039
报告期末下属分级基金的份额总额	838,355,251.32 份	107,757,929.90 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过合理运用投资组合优化策略,力争实现基金收益随着时间增长的逐步提升。
投资策略	1、资产配置策略:在投资比例限制的约束下,本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析,对不同大类资产的预期收益和风险进行动态跟踪,从而决定具体资产配置比例。 2、债券投资组合策略:主要采取利率策略、信用债和资产支持证券投资策略、收益率曲线策略以及杠杆策略。 3、股票投资策略:本基金将适度参与股票资产投资。在大类资产配置的框架下,本基金通过定量和定性分析相结合、基本面与模型相结合、基金经理和研究团队相结合的研究方法,甄选优质上市公司构建投资组合,以获得长期持续稳健的投资收益。 另外,本基金的投资策略还包括存托凭证投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、国债期货投资策略、基金的投资策略等。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*8%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*2%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票,还将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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 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
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 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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	海富通基金管理有限公司	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

§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）	
	海富通添利收益一年持	海富通添利收益一年持有

	有期债券 A	期债券 C
本期已实现收益	12,064,613.55	1,318,176.93
本期利润	11,869,679.62	1,399,497.52
加权平均基金份额本期利润	0.0110	0.0099
本期加权平均净值利润率	0.98%	0.89%
本期基金份额净值增长率	0.75%	0.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	海富通添利收益一年持有期债券 A	海富通添利收益一年持有期债券 C
期末可供分配利润	99,986,834.19	11,574,802.15
期末可供分配基金份额利润	0.1193	0.1074
期末基金资产净值	940,741,288.97	119,647,534.16
期末基金份额净值	1.1221	1.1103
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	海富通添利收益一年持有期债券 A	海富通添利收益一年持有期债券 C
基金份额累计净值增长率	12.21%	11.03%

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

海富通添利收益一年持有期债券 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
过去三个月	0.07%	0.10%	1.77%	0.13%	-1.70%	-0.03%
过去六个月	0.75%	0.12%	2.08%	0.12%	-1.33%	0.00%
过去一年	2.24%	0.11%	3.24%	0.10%	-1.00%	0.01%
自基金合同生效起至今	12.21%	0.13%	13.85%	0.11%	-1.64%	0.02%

海富通添利收益一年持有期债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①－③	②－④
----	----------	------------	------------	------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	-0.03%	0.10%	1.77%	0.13%	-1.80%	-0.03%
过去六个月	0.55%	0.12%	2.08%	0.12%	-1.53%	0.00%
过去一年	1.83%	0.11%	3.24%	0.10%	-1.41%	0.01%
自基金合同生效起至今	11.03%	0.13%	13.85%	0.11%	-2.82%	0.02%

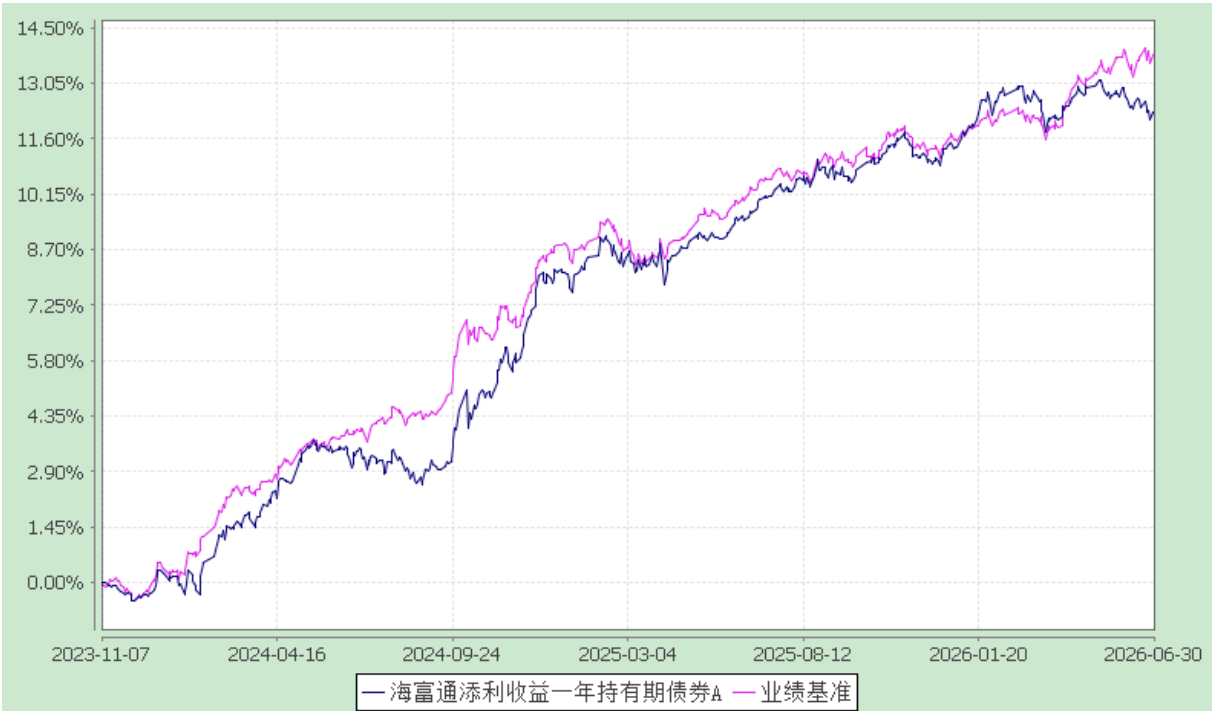
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通添利收益一年持有期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

(2023 年 11 月 7 日至 2026 年 6 月 30 日)

海富通添利收益一年持有期债券 A



海富通添利收益一年持有期债券 C



注：本基金合同于 2023 年 11 月 7 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十二部分（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		
江勇	本基金的基金经理；多资产投资部副总监（主持工作）。	2023-11-07	-	15 年	经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师，资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限公司，曾任混合资产投资部总经理，现任多资产投资部副总监（主持工作）。2018 年 7 月至 2023 年 7 月任海富通上证非周期 ETF 联接基金经理。2018 年 7 月至 2022 年 5 月任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通中证 100 指数(LOF)基金经理。2018 年 7 月至 2020 年 3 月任海富通中证内地低碳指数（现海富通中证 500 增强）基金经理。2020 年 8 月至 2022 年 5 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理。2020 年 8 月至 2023 年 3 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通稳固收益债券的基金经理。2021 年 2 月起兼

					任海富通欣睿混合基金经理。2021 年 6 月至 2024 年 11 月兼任海富通策略收益债券基金经理。2021 年 6 月至 2023 年 10 月兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2021 年 9 月起兼任海富通欣利混合基金经理。2023 年 1 月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2023 年 11 月起兼任海富通添利收益一年持有期债券基金经理。2023 年 12 月起兼任海富通悦享一年持有期混合基金经理。2024 年 3 月至 2025 年 6 月兼任海富通欣盈 6 个月持有期混合基金经理。2024 年 6 月起兼任海富通红利优选混合基金经理。2025 年 7 月起兼任海富通添合收益债券基金经理。
陈轶平	本基金的基金经理；首席固收投资官。	2023-11-07	-	17 年	博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、现金管理部副总监、债券基金部总监、固定收益投资副总监、固定收益投资总监，现任首席固收投资官。2013 年 8 月至 2020 年 7 月任海富通货币基金经理。2014 年 8 月至 2019 年 9 月兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014 年 11 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF（现为海富通上证城投债 ETF）基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 7 月兼任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。2016 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞丰一年定开债券（现为海富通瑞丰债券）基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月

					兼任海富通瑞益债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 10 月兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2017 年 1 月至 2021 年 3 月兼任海富通上证周期产业债 ETF 基金经理。2017 年 2 月至 2023 年 7 月兼任海富通瑞利债券基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 6 月兼任海富通富源债券基金经理。2017 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 9 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 指数增强）基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 9 月兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017 年 7 月至 2018 年 12 月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018 年 4 月至 2026 年 2 月兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018 年 10 月至 2023 年 12 月兼任海富通上证 10 年期地方政府债 ETF 基金经理。2018 年 11 月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。2019 年 1 月至 2023 年 12 月兼任海富通上清所短融债券基金经理。2019 年 11 月起兼任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理。2020 年 4 月至 2022 年 8 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 7 月起兼任海富通上证投资级可转债 ETF 基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通利率债债券基金经理。2022 年 3 月至 2025 年 12 月兼任海富通恒益一年定开债券发起式基金经理。2022 年 7 月起兼任海富通中证短融 ETF 基金经理。2023 年 8 月起兼任海富通盈丰一年定开债券发起式基金经理。2023 年 11 月起兼任海富通添利收益一年持有期债券基金经理。2024 年 11 月起兼任海富通纯债债券基金经理。
--	--	--	--	--	--

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
江勇	公募基金	8	13,843,539,918.03	2018/07/10
	私募资产管理计划	1	12,056,491.94	2026/02/06
	其他组合	2	4,036,784,490.82	2023/08/22
	合计	11	17,892,380,900.79	

注：表内任职日期为基金经理加入公司以来首次开始管理各类产品的时间。

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间交易的样本，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。

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。

4.4 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

回顾 2026 年上半年，国内经济一季度实现“开门红”、二季度温和增长。投资端，基建、制造业投资结构分化，通信电子、信息传输等高成长领域投资加快；地产投资处于筑底阶段。消费方面，高基数效用压制社零增速，服务消费表现较强。出口依托国内产业链优势、AI 产业高景气，保持强劲韧性。通胀方面，受外部输入性因素影响，PPI 回升相对比较明显，CPI 涨幅比较温和。政策层面，财政维持积极基调，全年赤字率拟按 4% 左右安排。货币政策保持适度宽松，上半年未实施降准降息，主要通过公开市场操作引导资金利率围绕政策利率运行。流动性方面，一季度债市资金面整体中性偏松，二季度，资金面在季初偏宽松，央行通过公开市场操作工具连续净回笼，资金面从宽松状态逐步向中性状态回归。

从权益市场来看，上半年上证指数涨幅为 3.16%，沪深 300 为 7.55%，中证 500 为 20.97%，创业板指为 35.58%，科创 50 为 64.25%。行业板块方面，根据申万一级行业分类，表现靠前的板块是电子、通信、建筑材料、机械设备，表现靠后的板块是商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料。从行情节奏看，在年初美联储宽松预期和美国财政脉冲背景下，市场交易流动性宽松和经济复苏受益品种。但是，2 月底美伊战争爆发，油价持续高位震荡运行，美联储宽松预期消退，加息预期升温，此外战争影响了各国年内经济增长预期，此前的交易逻辑逆转。与此同时，美国科技巨头上修 2026 年资本开支，AI 投资拉动全球经济，AI 产业链成为市场的主线行情。整体而言，上半年 A 股以科技成长风格为主，AI 相关行业涨幅居前，市场结构较为分化。

报告期间，股票仓位保持稳定，权益配置上延续价值风格，行业分布上较为均衡，持仓个股较为分散；上半年市场风格分化较大，成长板块表现突出、价值板块则相对承压，受此影响，组合权益部分均衡偏价值的风格阶段性表现偏弱。从上半年贡献来看，电子、通信、基础化工对组合提供了较多正贡献，汽车、非银金融、机械设备对组合有较多拖累。债券方面，本管理人在上半年根据市场情况选择产业债、银行二永债、券商次级债进行配置，同时在利率债波段方面把握机会进行操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通添利收益一年持有期债券 A 净值增长率为 0.75%，同期业绩比较基准收益率为 2.08%。海富通添利收益一年持有期债券 C 净值增长率为 0.55%，同期业绩比较基准收益率为 2.08%。

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，经济增长有支撑。超长期特别国债、地方政府专项债和新型政策性金融工具等资

金将继续加快落地，“六张网”与新质生产力仍是投资亮点，基建与制造业投资有望获得支撑。以旧换新等政策延续托底消费，消费修复斜率偏缓，服务消费相对更强。AI 资本开支与供应链重塑下，中国出口或延续较快增长。通胀方面，油价中枢下降，物价或有所回落。财政政策方面，坚持积极的政策基调，关注特别国债与专项债下半年的发行节奏。货币政策方面，将继续实施好适度宽松的货币政策，加大逆周期和跨周期调节力度。

从债券市场来看，下半年对债券市场偏中性判断。经济总量平稳增长、结构分化的格局大概率延续，基本面弹性空间有限，对债市形成一定支撑。供需方面，政府债集中发行窗口期或阶段性压制债市情绪，但供给难以扭转中长期行情主线，信贷增速放缓背景下银行、保险配置需求仍有支撑。流动性方面，央行完善利率走廊框架，强化短端流动性调控，引导资金价格平稳运行，资金利率波动幅度或收窄。总体来看，在经济新旧动能转换、资金面相对稳定的背景下，下半年债市或以震荡为主。本组合在下半年将继续根据市场情况灵活配置各类债券资产，努力获取稳定收益。

从权益市场来看，市场有望震荡上行。从基本面看，国内经济向新向优，AI 产业链保持高景气度，宏观经济步入补库周期。从流动性看，国内宏观流动性保持宽松，海外宏观流动性短期趋紧但未来有望缓解，此外监管层引导中长线资金入市，整体流动性环境保持稳态。展望未来，我们对 A 股充满信心，将继续跟踪国内政策和经济的变化，以把握市场节奏和投资机会。

未来，本基金将继续在控制风险的基础上，积极寻找市场的结构性机会，力争跑赢市场。从国内各大类资产目前性价比来看，依然是股票具备性价比，且目前国内整体的政策、流动性等依然利好权益市场，企业盈利依然保持改善，权益市场依然可能保持震荡偏强走势。后续将密切关注海外地缘政治局势和国内政策变化对市场的影响，择机调整仓位和组合配置来提升收益。个股配置上，将继续从绝对收益目标出发，结合安全边际和潜在收益弹性，继续选取有性价比的个股来进行配置，为组合提升收益。

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，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金（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。

86 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金

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	30,366,203.16	5,158,923.12
结算备付金		38,196,668.41	17,744,661.38
存出保证金		56,404.03	1,123,165.51
交易性金融资产	6.4.7.2	1,256,534,242.13	1,505,133,330.72
其中：股票投资		69,334,383.65	138,850,901.87
基金投资		12,233,218.26	6,708,903.95
债券投资		1,174,966,640.22	1,359,573,524.90
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	30,000,000.00	-
应收清算款		1,590,511.65	5,070,297.59
应收股利		126,062.79	21,604.90
应收申购款		15,472.77	64,646.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,356,885,564.94	1,534,316,630.18
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		264,000,000.00	25,993,597.27
应付清算款		26,288,373.66	-
应付赎回款		5,341,511.51	394,282.24
应付管理人报酬		540,307.06	777,466.46
应付托管费		89,972.42	129,577.76
应付销售服务费		40,570.32	67,300.95
应付投资顾问费		-	-
应交税费		25,315.36	30,729.35

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	170,691.48	277,156.10
负债合计		296,496,741.81	27,670,110.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	946,113,181.22	1,354,231,525.36
未分配利润	6.4.7.8	114,275,641.91	152,414,994.69
净资产合计		1,060,388,823.13	1,506,646,520.05
负债和净资产总计		1,356,885,564.94	1,534,316,630.18

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.1221 元，C 类基金份额净值 1.1103 元。

基金份额总额 946,113,181.22 份，其中 A 类基金份额 838,355,251.32 份，C 类基金份额 107,757,929.90 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金

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		19,099,395.43	12,024,992.17
1.利息收入		113,729.22	157,337.35
其中：存款利息收入	6.4.7.9	103,030.45	67,131.75
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		10,698.77	90,205.60
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,099,279.55	11,689,596.37
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,797,367.62	2,049,133.39
基金投资收益	6.4.7.11	182,383.19	79,786.88
债券投资收益	6.4.7.12	16,050,209.89	7,580,844.76
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-466,640.35	892,508.04
股利收益	6.4.7.15	1,535,959.20	1,087,323.30
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-113,613.34	178,058.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-

减：二、营业总支出		5,830,218.29	2,393,197.31
1. 管理人报酬		4,081,184.64	1,531,545.89
2. 托管费		679,994.03	255,257.63
3. 销售服务费		315,165.22	184,091.48
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		615,972.44	301,259.36
其中：卖出回购金融资产支出		615,972.44	301,259.36
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		22,144.41	11,031.85
8. 其他费用	6.4.7.19	115,757.55	110,011.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,269,177.14	9,631,794.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,269,177.14	9,631,794.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,269,177.14	9,631,794.86

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金

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	1, 354, 231, 525. 36	-	152, 414, 994. 69	1, 506, 646, 520. 05
二、本期期初净资产	1,354,231,525.36	-	152,414,994.69	1,506,646,520.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-408,118,344.14	-	-38,139,352.78	-446,257,696.92
（一）、综合收益总额	-	-	13,269,177.14	13,269,177.14
（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）	-408,118,344.14	-	-51,408,529.92	-459,526,874.06
其中：1.基金申购	59,312,224.56	-	7,525,721.69	66,837,946.25

款				
2.基金赎回款	-467,430,568.70	-	-58,934,251.61	-526,364,820.31
(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	946,113,181.22	-	114,275,641.91	1,060,388,823.13
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	286,302,249.57	-	22,898,905.88	309,201,155.45
二、本期期初净资产	286,302,249.57	-	22,898,905.88	309,201,155.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	498,946,585.75	-	52,838,364.35	551,784,950.10
(一)、综合收益总额	-	-	9,631,794.86	9,631,794.86
(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)	498,946,585.75	-	43,206,569.49	542,153,155.24
其中: 1.基金申购款	547,484,758.00	-	47,041,600.87	594,526,358.87
2.基金赎回款	-48,538,172.25	-	-3,835,031.38	-52,373,203.63
(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	785,248,835.32	-	75,737,270.23	860,986,105.55

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

海富通添利收益一年持有期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[2023]1643 号《关于准予海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金注册的批复》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《海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）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 398,048,129.12 元。经向中国证监会备案，《海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金基金合同》于 2023 年 11 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 398,146,981.49 份基金份额，A 类基金份额 266,680,567.33 份，C 类基金份额 131,466,414.16 份，其中认购资金利息折合 A 基金份额 53,332.46 份，认购资金利息折合 C 基金份额 45,519.91 份。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。

根据《海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金基金合同》和《海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购基金份额时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括债券（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持债券、政府支持机构 债券、地方政府债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款和其他银行存款等）、国债期货、货币市场工具、股票（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票）、可交换债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、存托凭证、港股通标的股票、经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额（仅限于基金管理人旗下的股票型基金及应计入权益类资产的混合型基金、全市场的股票型 ETF，不包括 QDII 基金和香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的非基金中基金、货币市场基金）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金所指信用债券包括金融债券（不包含政策性金融债）、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、资产支持证券等非国家、地方政府信用担保的债券。

本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金对股票、可交换债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%（其中港股通标的股票投资比例不得超过股票资产的 50%）；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。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产净值的 10%。

本基金业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*8%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*2%+银行活期存款利率(税后)*5%

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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所

得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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]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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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) 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。

b) 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。

对本基金从中国内地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。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公

司”)取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对本基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

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 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。

d)本基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。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。

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。

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	30,366,203.16
等于: 本金	30,365,866.21
加: 应计利息	336.95
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	30,366,203.16

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		72,103,776.90	-	69,334,383.65	-2,769,393.25
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所		3,262,797.87		
	市场	432,408,347.95		435,332,249.27	-338,896.55
	银行间		9,155,390.95		
	市场	727,149,634.86		739,634,390.95	3,329,365.14
合计		1,159,557,982.81	12,418,188.82	1,174,966,640.22	2,990,468.59
资产支持证券		-	-	-	-
基金		13,965,866.57	-	12,233,218.26	-1,732,648.31
其他		-	-	-	-
合计		1,245,627,626.28	12,418,188.82	1,256,534,242.13	-1,511,572.97

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 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	30,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	30,000,000.00	-

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从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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	79,568.62
其中：交易所市场	76,396.79
银行间市场	3,171.83
应付利息	-
预提费用	91,122.86
合计	170,691.48

6.4.7.7 实收基金

海富通添利收益一年持有期债券 A

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	1,183,222,745.80	1,183,222,745.80
本期申购	55,999,112.92	55,999,112.92
本期赎回（以“-”号填列）	-400,866,607.40	-400,866,607.40
本期末	838,355,251.32	838,355,251.32

海富通添利收益一年持有期债券 C

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	171,008,779.56	171,008,779.56
本期申购	3,313,111.64	3,313,111.64
本期赎回（以“-”号填列）	-66,563,961.30	-66,563,961.30
本期末	107,757,929.90	107,757,929.90

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

海富通添利收益一年持有期债券 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	129,443,706.07	5,146,359.45	134,590,065.52
本期期初	129,443,706.07	5,146,359.45	134,590,065.52
本期利润	12,064,613.55	-194,933.93	11,869,679.62
本期基金份额交易产生的变动数	-41,521,485.43	-2,552,222.06	-44,073,707.49
其中：基金申购款	6,611,950.92	529,936.62	7,141,887.54
基金赎回款	-48,133,436.35	-3,082,158.68	-51,215,595.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	99,986,834.19	2,399,203.46	102,386,037.65

海富通添利收益一年持有期债券 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	17,075,014.88	749,914.29	17,824,929.17
本期期初	17,075,014.88	749,914.29	17,824,929.17
本期利润	1,318,176.93	81,320.59	1,399,497.52
本期基金份额交易产生的变动数	-6,818,389.66	-516,432.77	-7,334,822.43
其中：基金申购款	354,211.28	29,622.87	383,834.15
基金赎回款	-7,172,600.94	-546,055.64	-7,718,656.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,574,802.15	314,802.11	11,889,604.26

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	15,051.92
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	87,874.91
其他	103.62
合计	103,030.45

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	255,851,051.11
减：卖出股票成本总额	253,684,388.72
减：交易费用	369,294.77
买卖股票差价收入	1,797,367.62

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	5,443,404.39
减：卖出/赎回基金成本总额	5,260,319.64
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	701.56
基金投资收益	182,383.19

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	14,717,134.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,333,075.72
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	16,050,209.89

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	422,721,262.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	415,816,945.18
减：应计利息总额	5,567,800.71
减：交易费用	3,441.18
买卖债券差价收入	1,333,075.72

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
国债期货投资收益（税前）	-466,190.00
减：交易费用	450.35
合计	-466,640.35

6.4.7.15 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	1,503,826.86
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	32,132.34
合计	1,535,959.20

6.4.7.16 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	-1,153,183.34
——股票投资	-7,670,561.17
——债券投资	7,829,367.08
——资产支持证券投资	-

——基金投资	-1,311,989.25
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	1,039,570.00
——权证投资	-
——国债期货	1,039,570.00
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	-113,613.34

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.18 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务 费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费 （元）	21,416.24
当期持有基金产生的应支付托管费 （元）	4,395.42

注：当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况，根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.19 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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	14,920.26
证券组合费	414.43

债券托管账户维护费	18,000.00
上清所查询服务费	600.00
合计	115,757.55

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、注册登记机构、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
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。关联方国泰海通证券股份有限公司（简称“国泰海通证券”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于2025年3月14日合并组建而成。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

国泰海通证券	426,231,305.16	95.21%	111,581,735.18	60.66%
--------	----------------	--------	----------------	--------

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间内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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰海通证券	185,792.97	94.54%	72,963.30	95.51%
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰海通证券	48,634.92	59.77%	45,660.83	87.52%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金管理人提供的证券投资研究服务等。

2.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。公司的该类佣金协议符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

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	4,081,184.64	1,531,545.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,030,896.69	736,397.70
应支付基金管理人的净管理费	2,050,287.95	795,148.19

注：1 本基金对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分不收取管理费。支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有的本基金管理人自

身管理的基金份额所对应的资产净值后的余额的 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扣除所持有的本基金管理人自身管理的基金份额所对应的资产净值后的余额 x0.60%/当年天数。

2、本基金本报告期末投资于基金管理人所管理的其他基金。

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	679,994.03	255,257.63

注：本基金对基金财产中持有的本基金基金托管人自身托管的基金部分不收取托管费。支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有的本基金基金托管人自身托管的基金份额所对应的资产净值后的余额的 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扣除所持有的本基金托管人自身托管的基金份额所对应的资产净值后的余额 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 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通添利收益一年持有期债券 A	海富通添利收益一年持有期债券 C	合计
中国银行	-	291,673.25	291,673.25
海富通	-	12.07	12.07
国泰海通证券	-	299.94	299.94
合计	-	291,985.26	291,985.26
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	海富通添利收益一年持有期债券A	海富通添利收益一年持有期债券C	合计
中国银行	-	122,497.46	122,497.46
海通证券	-	1,864.87	1,864.87
海富通	-	8.71	8.71
国泰海通证券	-	323.24	323.24

合计	-	124,694.28	124,694.28
----	---	------------	------------

注：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 $\times$ 0.40% / 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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	
	2026年1月1日至2026年6月30日		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	30,366,203.16	15,051.92	3,370,577.75	15,535.27

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国泰海通证 券	118064	联瑞转债	可转债优 先配售	160	16,000.00
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限 期	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
00124 8	华润 新能 源	2026-0 6-25	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	10.11	10.11	500	5,055. 00	5,055. 00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限 期	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
11370 5	豪 26 转债	2026-0 6-15	1 个月 内 (含)	老股 东配 债	100.00	100.01	340	34,000 .00	34,002 .38	-

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

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

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止,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人民币 264,000,000.00 元,于 2026 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,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。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。

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	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	31,376,457.81	123,892,025.21
合计	31,376,457.81	123,892,025.21

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	766,951,533.69	797,560,309.75
AAA 以下	21,601,842.69	30,013,992.26
未评级	355,036,806.03	408,107,197.68
合计	1,143,590,182.41	1,235,681,499.69

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、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可在满足基金合同规定的持有期后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公司的证券不得超过该证券的 10%。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。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%。

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 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	30,366,203.16	-	-	-	30,366,203.16
结算备付金	38,196,668.41	-	-	-	38,196,668.41
存出保证金	56,404.03	-	-	-	56,404.03
交易性金融资产	261,728,033.48	848,536,605.46	64,702,001.28	81,567,601.91	1,256,534,242.13
买入返售金融资产	30,000,000.00	-	-	-	30,000,000.00
应收清算款	-	-	-	1,590,511.65	1,590,511.65
应收股利	-	-	-	126,062.79	126,062.79
应收申购款	-	-	-	15,472.77	15,472.77
资产总计	360,347,309.08	848,536,605.46	64,702,001.28	83,299,649.12	1,356,885,564.94
负债					
卖出回购金融资产款	264,000,000.00	-	-	-	264,000,000.00
应付清算款	-	-	-	26,288,373.66	26,288,373.66
应付赎回款	-	-	-	5,341,511.51	5,341,511.51
应付管理人报酬	-	-	-	540,307.06	540,307.06

应付托管费	-	-	-	89,972.42	89,972.42
应付销售服务费	-	-	-	40,570.32	40,570.32
应交税费	-	-	-	25,315.36	25,315.36
其他负债	-	-	-	170,691.48	170,691.48
负债总计	264,000,000.00	-	-	32,496,741.81	296,496,741.81
利率敏感度缺口	96,347,309.08	848,536,605.46	64,702,001.28	50,802,907.31	1,060,388,823.13
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	5,158,923.12	-	-	-	5,158,923.12
结算备付金	17,744,661.38	-	-	-	17,744,661.38
存出保证金	51,690.71	-	-	1,071,474.80	1,123,165.51
交易性金融资产	267,381,073.97	976,322,382.01	115,870,068.92	145,559,805.82	1,505,133,330.72
应收清算款	-	-	-	5,070,297.59	5,070,297.59
应收股利	-	-	-	21,604.90	21,604.90
应收申购款	-	-	-	64,646.96	64,646.96
资产总计	290,336,349.18	976,322,382.01	115,870,068.92	151,787,830.07	1,534,316,630.18
负债					
卖出回购金融资产款	25,993,597.27	-	-	-	25,993,597.27
应付赎回款	-	-	-	394,282.24	394,282.24
应付管理人报酬	-	-	-	777,466.46	777,466.46
应付托管费	-	-	-	129,577.76	129,577.76
应付销售服务费	-	-	-	67,300.95	67,300.95
应交税费	-	-	-	30,729.35	30,729.35
其他负债	-	-	-	277,156.10	277,156.10
负债总计	25,993,597.27	-	-	1,676,512.86	27,670,110.13
利率敏感度缺口	264,342,751.91	976,322,382.01	115,870,068.92	150,111,317.21	1,506,646,520.05

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	-14,088,680.72	-16,188,771.17
	市场利率下降 25 个基点	14,412,637.31	16,590,955.30

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	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	4,804,950.63	4,804,950.63
资产合计	-	4,804,950.63	4,804,950.63
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞 口净额	-	4,804,950.63	4,804,950.63
项目	上年度末 2025年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计

以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	13,107,896.24	13,107,896.24
资产合计	-	13,107,896.24	13,107,896.24
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	13,107,896.24	13,107,896.24

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%	240,247.53	655,394.81
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-240,247.53	-655,394.81

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的

政府债券不低于基金资产净值的 5%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	69,334,383.6 5	6.54	138,850,901.8 7	9.22
交易性金融资产—基金投资	12,233,218.2 6	1.15	6,708,903.95	0.45
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	81,567,601.9 1	7.69	145,559,805.8 2	9.66

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	2,840,307.36	6,796,923.18
	2.业绩比较基准下降 5%	-2,840,307.36	-6,796,923.18

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	82,364,714.89	155,938,140.72
第二层次	1,174,169,527.24	1,349,195,190.00
第三层次	-	-
合计	1,256,534,242.13	1,505,133,330.72

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。

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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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、债券和基金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，本基金未持有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，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	69,334,383.65	5.11
	其中：股票	69,334,383.65	5.11
2	基金投资	12,233,218.26	0.90
3	固定收益投资	1,174,966,640.22	86.59
	其中：债券	1,174,966,640.22	86.59
	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	30,000,000.00	2.21
	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	68,562,871.57	5.05
8	其他各项资产	1,788,451.24	0.13
9	合计	1,356,885,564.94	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 4,804,950.63 元，占资产净值比例为 0.45%。

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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,413,180.00	0.23
C	制造业	36,442,795.22	3.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	90,695.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,808,386.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	1,990,251.00	0.19

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	620,353.80	0.06
J	金融业	17,696,099.00	1.67
K	房地产业	323,000.00	0.03
L	租赁和商务服务业	1,984,711.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	991,542.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	168,420.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	64,529,433.02	6.09

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	227,824.14	0.02
金融	2,307,475.05	0.22
房地产	2,269,651.44	0.21
合计	4,804,950.63	0.45

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000776	广发证券	137,500	3,217,500.00	0.30
2	002142	宁波银行	99,800	2,963,062.00	0.28
3	601601	中国太保	60,000	1,711,200.00	0.16
3	02601	中国太保	38,400	896,510.36	0.08
4	01336	新华保险	35,300	1,410,964.69	0.13
4	601336	新华保险	19,700	1,175,302.00	0.11
5	000333	美的集团	30,800	2,326,324.00	0.22
6	002078	太阳纸业	166,700	2,082,083.00	0.20
7	600060	海信视像	71,900	2,003,853.00	0.19
8	01109	华润置地	67,500	1,758,813.75	0.17

9	300408	三环集团	10,300	1,719,070.00	0.16
10	600919	江苏银行	159,000	1,714,020.00	0.16
11	601688	华泰证券	79,500	1,639,290.00	0.15
12	002850	科达利	8,000	1,514,400.00	0.14
13	600018	上港集团	317,200	1,497,184.00	0.14
14	603889	新澳股份	276,900	1,414,959.00	0.13
15	600153	建发股份	169,700	1,345,721.00	0.13
16	600285	羚锐制药	69,200	1,341,096.00	0.13
17	688410	山外山	92,374	1,326,490.64	0.13
18	600999	招商证券	56,000	1,181,600.00	0.11
19	601128	常熟银行	187,825	1,093,141.50	0.10
20	603596	伯特利	42,180	1,047,751.20	0.10
21	601001	晋控煤业	59,600	1,036,444.00	0.10
22	300037	新宙邦	10,600	984,210.00	0.09
23	600499	科达制造	70,800	977,040.00	0.09
24	000100	TCL 科技	164,500	957,390.00	0.09
25	600926	杭州银行	64,000	924,800.00	0.09
26	300693	盛弘股份	18,000	877,500.00	0.08
27	002444	巨星科技	26,200	814,820.00	0.08
28	601318	中国平安	16,200	773,388.00	0.07
29	000957	中通客车	77,900	729,144.00	0.07
30	000680	山推股份	72,300	726,615.00	0.07
31	601877	正泰电器	28,700	719,509.00	0.07
32	300759	康龙化成	24,600	711,678.00	0.07
33	605507	国邦医药	47,600	704,480.00	0.07
34	603379	三美股份	9,200	698,188.00	0.07
35	600546	山煤国际	62,600	684,218.00	0.06
36	002236	大华股份	40,900	674,441.00	0.06
37	603939	益丰药房	36,900	663,462.00	0.06
38	000415	渤海租赁	157,000	638,990.00	0.06
39	605123	派克新材	6,500	630,565.00	0.06
40	688188	柏楚电子	5,814	620,353.80	0.06
41	601577	长沙银行	67,700	589,667.00	0.06
42	601628	中国人寿	15,950	563,832.50	0.05
43	300274	阳光电源	3,500	556,570.00	0.05
44	300866	安克创新	5,000	522,500.00	0.05
45	002475	立讯精密	7,400	520,960.00	0.05
46	300855	图南股份	16,300	509,538.00	0.05
47	300453	三鑫医疗	54,100	489,064.00	0.05
48	301376	致欧科技	27,400	485,528.00	0.05
49	000949	新乡化纤	72,700	460,918.00	0.04
50	600256	广汇能源	93,000	459,420.00	0.04
51	000963	华东医药	15,800	444,296.00	0.04
52	688169	石头科技	4,674	443,889.78	0.04

53	601058	赛轮轮胎	38,400	442,752.00	0.04
54	300415	伊之密	21,800	434,038.00	0.04
55	603816	顾家家居	19,400	433,784.00	0.04
56	688155	先惠技术	5,162	417,554.18	0.04
57	000157	中联重科	59,000	411,230.00	0.04
58	002415	海康威视	11,900	406,980.00	0.04
59	301608	博实结	8,046	404,391.96	0.04
60	002448	中原内配	32,400	398,520.00	0.04
61	300750	宁德时代	1,000	393,010.00	0.04
62	002293	罗莱生活	39,700	392,633.00	0.04
63	600150	中国船舶	11,600	391,964.00	0.04
64	603713	密尔克卫	5,300	377,201.00	0.04
65	603112	华翔股份	20,800	347,984.00	0.03
66	002244	滨江集团	42,500	323,000.00	0.03
67	00688	中国海外发展	27,500	288,054.61	0.03
68	601965	中国汽研	23,400	279,864.00	0.03
69	000902	新洋丰	24,000	277,440.00	0.03
70	603338	浙江鼎力	6,200	263,500.00	0.02
71	603486	科沃斯	5,000	253,750.00	0.02
72	600079	ST 人福	14,400	236,736.00	0.02
73	601678	滨化股份	35,700	235,263.00	0.02
74	000729	燕京啤酒	23,200	235,016.00	0.02
75	688029	南微医学	3,115	223,657.00	0.02
76	01908	建发国际集团	19,000	222,783.08	0.02
77	600710	苏美达	22,500	215,100.00	0.02
78	601898	中煤能源	16,600	202,188.00	0.02
79	603605	珀莱雅	3,200	191,744.00	0.02
80	603129	春风动力	700	179,060.00	0.02
81	000885	城发环境	14,000	168,420.00	0.02
82	000425	徐工机械	19,800	160,182.00	0.02
83	300596	利安隆	2,900	152,192.00	0.01
84	600731	湖南海利	29,300	150,016.00	0.01
85	601229	上海银行	17,200	149,296.00	0.01
86	002223	鱼跃医疗	5,700	146,262.00	0.01
87	688717	艾罗能源	1,654	136,570.78	0.01
88	688093	世华科技	3,650	134,685.00	0.01
89	002701	奥瑞金	30,500	129,930.00	0.01
90	09863	零跑汽车	4,000	119,790.42	0.01
91	600020	中原高速	31,400	115,866.00	0.01
92	01999	敏华控股	41,600	108,033.72	0.01
93	688778	厦钨新能	1,841	100,150.40	0.01
94	603606	东方电缆	2,400	99,624.00	0.01
95	603197	保隆科技	3,400	94,996.00	0.01
96	301216	万凯新材	3,900	89,661.00	0.01

97	603393	新天然气	4,000	85,640.00	0.01
98	603345	安井食品	1,000	80,190.00	0.01
99	001207	联科科技	5,300	79,076.00	0.01
100	002483	润邦股份	10,900	53,846.00	0.01
101	603198	迎驾贡酒	1,700	50,320.00	0.00
102	600985	淮北矿业	2,200	30,910.00	0.00
103	300832	新产业	600	25,200.00	0.00
104	600282	南钢股份	1,700	7,803.00	0.00
105	600378	昊华科技	100	7,538.00	0.00
106	001248	华润新能源	500	5,055.00	0.00
107	688016	心脉医疗	2	177.28	0.00

注：中国太保、新华保险同时在 A+H 股上市，合并计算其公允价值参与排序。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600999	招商证券	3,164,158.70	0.21
2	002410	广联达	2,054,071.00	0.14
3	600919	江苏银行	2,032,589.00	0.13
4	300415	伊之密	2,031,476.50	0.13
5	002648	卫星化学	2,000,507.00	0.13
6	000933	神火股份	1,893,781.00	0.13
7	603173	福斯达	1,720,310.00	0.11
8	000830	鲁西化工	1,653,105.00	0.11
9	600153	建发股份	1,644,400.00	0.11
10	600018	上港集团	1,590,428.00	0.11
11	01336	新华保险	1,563,903.82	0.10
12	603181	皇马科技	1,502,202.00	0.10
13	603393	新天然气	1,431,020.00	0.09
14	603198	迎驾贡酒	1,416,575.00	0.09
15	601009	南京银行	1,396,480.00	0.09
16	002150	正泰电源	1,396,086.00	0.09
17	002380	科远智慧	1,384,558.00	0.09
18	600649	城投控股	1,371,339.00	0.09
19	605123	派克新材	1,356,428.00	0.09
20	09988	阿里巴巴-W	1,327,442.03	0.09

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600522	中天科技	4,667,995.00	0.31
2	600961	株冶集团	4,044,045.00	0.27
3	601688	华泰证券	3,643,171.00	0.24
4	600999	招商证券	3,375,247.00	0.22
5	600690	海尔智家	2,912,939.00	0.19
6	601702	华峰铝业	2,732,685.00	0.18
7	002648	卫星化学	2,669,671.00	0.18
8	002150	正泰电源	2,536,075.00	0.17
9	000598	兴蓉环境	2,427,372.00	0.16
10	300596	利安隆	2,313,662.00	0.15
11	600114	东睦股份	2,004,030.00	0.13
12	300196	长海股份	1,993,398.00	0.13
13	002410	广联达	1,899,681.00	0.13
14	601216	君正集团	1,892,435.00	0.13
15	603713	密尔克卫	1,889,014.00	0.13
16	000333	美的集团	1,853,183.00	0.12
17	600352	浙江龙盛	1,849,840.00	0.12
18	600765	中航重机	1,815,360.00	0.12
19	02628	中国人寿	1,800,894.36	0.12
20	601838	成都银行	1,789,413.00	0.12

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	191,838,431.67
卖出股票的收入（成交）总额	255,851,051.11

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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	79,173,176.44	7.47

2	央行票据	-	-
3	金融债券	714,414,341.90	67.37
	其中：政策性金融债	10,604,904.11	1.00
4	企业债券	233,673,007.68	22.04
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	115,386,443.84	10.88
7	可转债（可交换债）	836,170.36	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	31,483,500.00	2.97
10	合计	1,174,966,640.22	110.81

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	232480052	24 浦发银行二级资本债 01A	700,000	72,385,051.51	6.83
2	1928003	19 农业银行二级 01	500,000	54,471,295.89	5.14
3	232480035	24 平安银行二级资本债 01A	500,000	52,047,575.34	4.91
4	232480039	24 广发银行二级资本债 01A	500,000	51,689,767.12	4.87
5	232480050	24 上海银行二级资本债 01	500,000	51,640,465.75	4.87

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

报告期内，本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险，符合既定投资政策及投资目标。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金采用定量分析和定性分析相结合的方式，一方面通过严格的量化规则筛选有潜在投资价值的标的纳入研究范围，另一方面结合所选基金的基金管理人的基本情况和投研文化等定性因素进行二次研判，双重维度筛选出中长期业绩稳定的优秀基金。另外，本基金还将定期对投资组合进行回顾和动态调整，剔除不再符合筛选标准的标的基金，增加符合筛选标准的基金，以实现基金投资组合的优化。

本基金可投资其他公开募集的基金，将在基金投资决策中带来一定的不确定性风险。被投资基金的波动会受到宏观经济环境、行业周期、基金经理管理能力和基金管理人自身经营状况等因素的影响。因此，本基金整体表现可能受所投资基金的影响。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	是否属于基金 管理人及管理 人关联方所管 理的基金
1	515100	景顺长城 中证红利	交易型开 放式	5,323,622. 00	6,915,384. 98	0.65	否

		低波动100ETF					
2	512890	华泰柏瑞中证红利低波动ETF	交易型开放式	2,294,843.00	2,448,597.48	0.23	否
3	563020	易方达中证红利低波动ETF	交易型开放式	1,688,700.00	1,791,710.70	0.17	否
4	159307	博时中证红利低波100ETF	交易型开放式	941,900.00	893,863.10	0.08	否
5	515450	南方标普中国A股大盘红利低波50ETF	交易型开放式	140,200.00	183,662.00	0.02	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，广发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、国家外汇管理局广东省分局的处罚，南京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江苏监管局的处罚，平安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，上海浦东发展银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局、国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚，上海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、国家金融监督管理总局上海监管局的处罚，中国工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外汇管理局北京市分局、中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚，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、中国人民银行的处罚，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。

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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	56,404.03
2	应收清算款	1,590,511.65
3	应收股利	126,062.79
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,472.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,788,451.24

7.13.4 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	113647	禾丰转债	802,167.98	0.08

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§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
海富通添利收益一年持有期债券	5,734	146,207.75	-	-	838,355,251.32	100.00 %

A						
海富通添利收益 一年持有期债券 C	698	154,380.99	-	-	107,757,929.90	100.00 %
合计	6,432	147,094.71	-	-	946,113,181.22	100.00 %

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	海富通添利收益一年持有期债券 A	1,764,969.87	0.2105%
	海富通添利收益一年持有期债券 C	361,963.11	0.3359%
	合计	2,126,932.98	0.2248%

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	海富通添利收益一年持有期债券 A	50~100
	海富通添利收益一年持有期债券 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通添利收益一年持有期债券 A	10~50
	海富通添利收益一年持有期债券 C	0
	合计	10~50

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通添利收益一年持有期债券 A	海富通添利收益一年持有期债券 C
基金合同生效日（2023 年 11 月 7 日）基金份额总额	266,680,567.33	131,466,414.16
本报告期期初基金份额总额	1,183,222,745.80	171,008,779.56
本报告期基金总申购份额	55,999,112.92	3,313,111.64

减：本报告期基金总赎回份额	400,866,607.40	66,563,961.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	838,355,251.32	107,757,929.90

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期持有的基金未发生重大影响事件。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 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。

10.7.3 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。

10.7.4 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。

10.8 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

10.8.1 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	
国泰海通证券	3	426,231,305.16	95.21%	185,792.97	94.54%	-
中信证券	2	21,440,267.62	4.79%	10,720.27	5.46%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金新增华泰证券 2 个交易单元。

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，租用其交易单元供本基金证券交易。

3、交易单元的选择程序：

(1) 由牵头部门依据上述交易单元选择标准及公司内控制度要求，对候选券商开展尽职调查，综合评估其财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力。

(2) 经评估，牵头部门将符合公司制度要求的券商相关材料提交督察长进行合规性审查，再提交基金管理人的总经理办公会审议。

(3) 基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

10.8.2 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

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
国泰海通证券	175,442,338.89	100.00 %	11,403,060,000.00	100.00 %	-	-	17,540,027.59	100.00 %
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 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旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	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	2026-01-12
2	海富通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	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
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安银行股份有限公司为销售机构的公告	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	2026-04-09
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广东顺德农村商业银行股份有限公司为销售机构的公告	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	2026-04-28
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中欧财富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	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	2026-04-28
6	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
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	2026-05-23
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险提示的公告	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	2026-06-13

§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添利收益一年持有期债券型证券投资基金的文件
- (二)海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金基金合同
- (三)海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通添利收益一年持有期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