

海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 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	12
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	13
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	14
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的真实、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	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	37
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	37
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	37
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	37
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	38
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	38
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	38
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	38
7.11 投资组合报告附注	38
§ 8 基金份额持有人信息	39

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末上市基金前十名持有人	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.4 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	40
§ 9 开放式基金份额变动	40
§ 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	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8 其他重大事件	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
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	313,351,046.33 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%×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
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	北京西城区复兴门内大街1号

	陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	
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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	杨仓兵	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		-	-

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.6 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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-975,907.34
本期利润	-3,516,754.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0141
本期加权平均净值利润率	-1.50%
本期基金份额净值增长率	-1.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	-27,387,464.01
期末可供分配基金份额利润	-0.0874
期末基金资产净值	293,928,959.29
期末基金份额净值	0.9380
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-6.20%

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)。

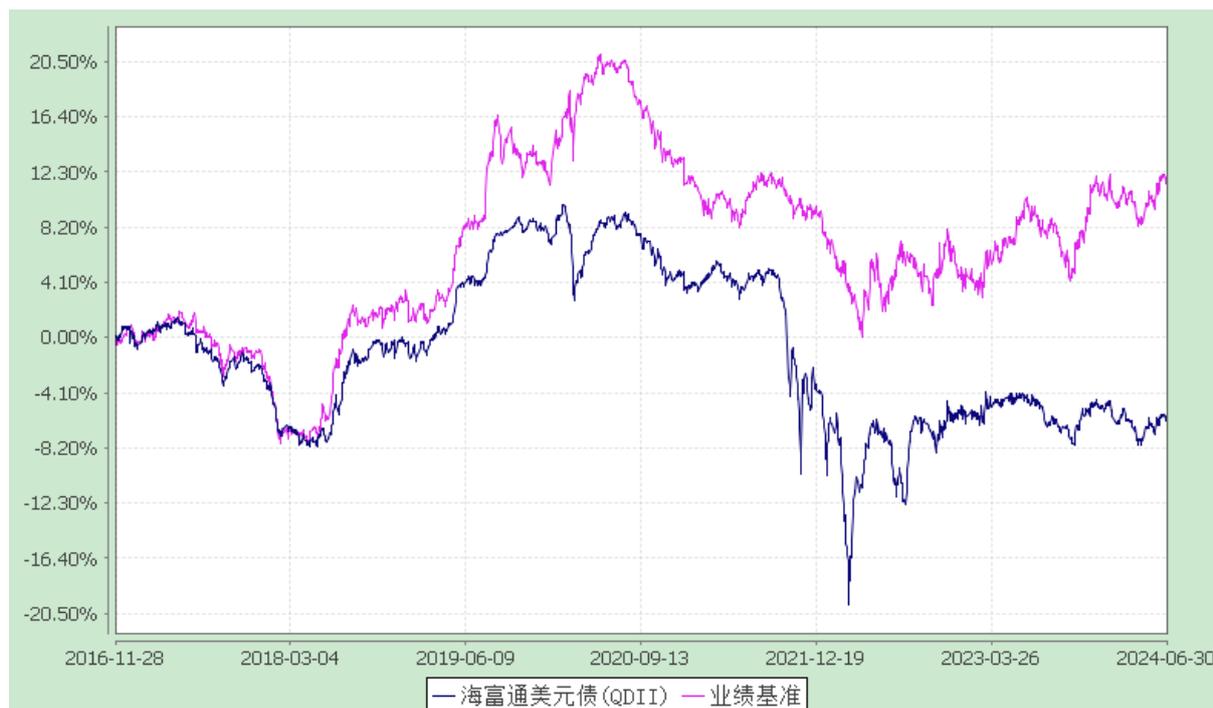
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.69%	0.26%	1.09%	0.32%	-0.40%	-0.06%
过去三个月	-0.03%	0.30%	0.48%	0.36%	-0.51%	-0.06%
过去六个月	-1.33%	0.26%	-0.06%	0.33%	-1.27%	-0.07%
过去一年	-1.44%	0.25%	1.16%	0.38%	-2.60%	-0.13%
过去三年	-10.14%	0.54%	0.74%	0.44%	-10.88%	0.10%
自基金合同生效起至今	-6.20%	0.39%	11.40%	0.35%	-17.60%	0.04%

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 2024 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，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 97 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证

券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通畅享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通盈丰一

年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通瑞鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、海富通优势驱动混合型证券投资基金、海富通 ESG 领先股票型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通数字经济混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
夏妍妍	本基金的基金经理	2021-05-06	2024-03-22	9 年	上海交通大学经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生，西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师，2014 年加入海富通基金管理有限公司，历任固定收益投资部固定收益分析师、基金经理助理。2018 年 1 月至 2023 年 1 月任海富通欣益混合基金经理。2018 年 4 月至 2024 年 3 月兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2018 年 4 月至 2021 年 5 月任海富通融丰定开债券基金经理。2019 年 5 月至 2024 年 3 月兼任海富通安颐收益混合基金经理。2019 年 10 月至 2020 年 11 月兼任海富通瑞丰债券基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 9 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2019 年 10 月至 2023 年 4 月兼任海富通富祥混合基金经理。2019 年

					10月至2024年3月兼任海富通聚合纯债基金经理。2020年5月至2023年10月兼任海富通富盈混合基金经理。2021年5月至2024年3月兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2021年8月至2024年3月兼任海富通瑞兴3个月定开债券基金经理。2022年7月至2024年3月兼任海富通策略收益债券基金经理。
陶斐然	本基金的基金经理	2024-03-20	-	9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。

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。

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

今年上半年，美国经济在高利率和紧财政下开始走弱，但是经济仍有韧性，6 月美国失业率走高，叠加 CPI 同比也回落。但是，失业率上升更多是源于新增劳动力进入市场，非农就业数据依然超预期，且实际薪资增速依然保持较高增长，最新零售数据也超预期，美国消费依然具有韧性。美联储降息来回反复，4 月底前，美联储表态偏鹰派，经济数据整体超预期，推迟了降息预期，美债收益率波动上行；5 月以来，劳动力市场缓慢恢复平衡和通胀增速走弱推动美联储降息预期升温，美债收益率高位下行。2024 年上半年，2 年期美国国债收益率震荡上行 48bps 至 4.71%，10 年期美国国债收益率震荡上行 48bps 至 4.36%。

2024 年上半年，中资美元债发行规模有所改善，但净融资仍为负值。中资美元债券指数整体上涨，信用利差压缩至历史较低水平。因境内地产政策持续加码和境内“资产荒”资金出境需求增强，高收益债券指数上涨幅度更大。分板块来看，根据 Markit iBoxx 亚洲中资美元投资级债券指数，城投、金融和地产分别上涨 3.62%、2.71% 和 2.48%，城投受益于“一揽子化债”政策表现较好；高收益指数中，地产触底反弹表现亮眼，金融次之，城投收益率最低，上涨幅度最小。

本基金上半年适度调整了组合结构，随着规模的增长逐渐增配美国国债和中资美元债，以中短久期投资级中资美元债为底仓，在保证较高票息的情况下，酌情配置长久期美国国债来调整组合久

期。汇率方面，由于上半年美元兑人民币总体偏强势，组合酌情调整了锁汇仓位。

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-1.33%，同期业绩比较基准收益率为-0.06%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场对美联储降息预期时点在今年 9 月，而从基本面的角度来看，美国经济虽然放缓但软着陆的概率较大，短期仍有韧性，通胀或存在抬升的压力，在美国去通胀接近完成、压降赤字之前，美联储何时启动降息或存在变数，这还需要进一步跟踪。这使得收益率可能仍处震荡区间，同时下半年美国大选变化增加了对收益率的扰动。一旦美联储启动降息，这对全球金融市场、各类资产都将产生较为显著的影响。

中资美元债方面，随着城投偿债压力进一步缓解，城投等级利差仍有一定压缩空间；金融主体整体资质较优，预计保持平稳；地产债受市场情绪影响较大，房企经营表现有待观察。

下半年，考虑到美国年内降息预期较强，虽然美国国债利率处于区间震荡阶段，但长期看仍有配置价值。本基金将继续增配投资级信用个券和美国国债，并用调整长久期美国国债的仓位来适度调整组合久期。

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”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	42,446,620.85	25,162,328.54
结算备付金		6,135,123.15	4,425,029.18
存出保证金		109.12	2,559,091.33
交易性金融资产	6.4.7.2	240,123,285.10	123,821,920.34
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		240,123,285.10	123,821,920.34
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	-	53,530.00
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,618,099.59	1,123.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		294,323,237.81	156,023,022.64
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		107,950.36	64,073.60
应付管理人报酬		138,234.37	78,549.07
应付托管费		46,078.11	26,183.02
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		21,826.98	11,857.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	80,188.70	165,182.86
负债合计		394,278.52	345,845.72
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	313,351,046.33	163,773,631.44

未分配利润	6.4.7.8	-19,422,087.04	-8,096,454.52
净资产合计		293,928,959.29	155,677,176.92
负债和净资产总计		294,323,237.81	156,023,022.64

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9380 元，基金份额总额 313,351,046.33 份。其中下属人民币基金份额参考净值人民币 0.9380 元，份额总额 304,010,498.42 份；下属美元基金份额参考净值 0.1316 美元，份额总额 9,340,547.91 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,475,770.90	1,549,077.06
1.利息收入		83,731.21	15,572.57
其中：存款利息收入	6.4.7.9	83,731.21	13,772.73
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		-	-
其他利息收入		-	1,799.84
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,412,889.08	1,185,146.14
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	4,505,525.07	2,001,980.97
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-3,092,635.99	-816,834.83
股利收益	6.4.7.13	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-2,540,847.31	69,769.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,498,189.04	238,150.94
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	66,645.16	40,437.90
减：二、营业总支出		1,040,983.75	686,273.42
1. 管理人报酬		699,464.33	442,369.76
2. 托管费		233,154.73	147,456.59
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		11,885.73	9,828.98
8. 其他费用	6.4.7.16	96,478.96	86,618.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,516,754.65	862,803.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,516,754.65	862,803.64
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,516,754.65	862,803.64

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	163,773,631.44	-	-8,096,454.52	155,677,176.92
二、本期期初净资产	163,773,631.44	-	-8,096,454.52	155,677,176.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	149,577,414.89	-	-11,325,632.52	138,251,782.37
（一）、综合收益总额	-	-	-3,516,754.65	-3,516,754.65
（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）	149,577,414.89	-	-7,808,877.87	141,768,537.02
其中：1.基金申购款	202,509,882.57	-	-11,035,990.97	191,473,891.60
2.基金赎回款	-52,932,467.68	-	3,227,113.10	-49,705,354.58
（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	313,351,046.33	-	-19,422,087.04	293,928,959.29
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	148,002,884.09	-	-7,918,392.42	140,084,491.67
二、本期期初净资产	148,002,884.09	-	-7,918,392.42	140,084,491.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	13,192,682.77	-	128,604.41	13,321,287.18
（一）、综合收益总额	-	-	862,803.64	862,803.64
（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）	13,192,682.77	-	-734,199.23	12,458,483.54
其中：1.基金申购款	30,259,467.01	-	-1,670,682.12	28,588,784.89
2.基金赎回款	-17,066,784.24	-	936,482.89	-16,130,301.35
（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	161,195,566.86	-	-7,789,788.01	153,405,778.85

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

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： $90\% \times$ 巴克莱资本美国综合债券指数收益率 $+10\% \times$ 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 2024 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、

财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入，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，在境内暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益，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，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	12,431,434.65
等于：本金	12,430,242.16
加：应计利息	1,192.49
定期存款	30,015,186.20
等于：本金	30,000,000.00
加：应计利息	15,186.20
其中：存款期限 1 个月以内	20,006,166.68
存款期限 1-3 个月	10,009,019.52
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
合计	42,446,620.85

注：于 2024 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：美元活期存款 139,262.15 美元（折合人民币 992,493.49 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	2,277,370.95		
	市场	236,093,602.62	240,123,285.10	1,752,311.53
	银行间		-	
	市场	-	-	-
合计	236,093,602.62	2,277,370.95	240,123,285.10	1,752,311.53
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	236,093,602.62	2,277,370.95	240,123,285.10	1,752,311.53

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	625.58
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,563.12
合计	80,188.70

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	163,773,631.44	163,773,631.44
本期申购	202,509,882.57	202,509,882.57
本期赎回（以“-”号填列）	-52,932,467.68	-52,932,467.68
本期末	313,351,046.33	313,351,046.33

注：截至2024年6月30日止，本基金于上交所上市的基金份额为155,194,530.00份（2023年12月31日：26,242,131.00份），托管在场外未上市交易的基金份额为158,156,516.33份（2023年12月31日：137,531,500.44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	-14,369,838.77	6,273,384.25	-8,096,454.52
本期期初	-14,369,838.77	6,273,384.25	-8,096,454.52
本期利润	-975,907.34	-2,540,847.31	-3,516,754.65
本期基金份额交易产生的变动数	-12,041,717.90	4,232,840.03	-7,808,877.87
其中：基金申购款	-16,532,892.06	5,496,901.09	-11,035,990.97
基金赎回款	4,491,174.16	-1,264,061.06	3,227,113.10
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-27,387,464.01	7,965,376.97	-19,422,087.04
-----	----------------	--------------	----------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	44,181.89
定期存款利息收入	30,088.98
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5.39
其他	9,454.95
合计	83,731.21

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,301,579.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,203,945.16
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	4,505,525.07

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	47,764,722.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	45,994,405.12
减：应计利息总额	566,372.53
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	1,203,945.16

6.4.7.12 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
外汇期货投资收益	-2,899,240.00
减：交易费用	23,995.99
远期外汇投资收益	-169,400.00
合计	-3,092,635.99

6.4.7.13 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-1,676,467.31
——股票投资	-
——债券投资	-1,676,467.31
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-864,380.00
——权证投资	-
——期货投资	-810,850.00
——远期投资	-53,530.00
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	-2,540,847.31

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	66,645.16
合计	66,645.16

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
银行汇划费	16,915.84
合计	96,478.96

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	699,464.33	442,369.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	61,692.03	33,000.32
应支付基金管理人的净管理费	637,772.30	409,369.44

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 × 0.60% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	233,154.73	147,456.59

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 × 0.20% / 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 2024年1月1日至2024年6月30 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日

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	3.54%	7.13%

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	11,860,016.24	44,181.89	3,693,922.16	9,513.84
中银香港	571,418.41	-	2,276,934.84	-
合计	12,431,434.65	44,181.89	5,970,857.00	9,513.84

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（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 35.06%(2023 年 12 月 31 日：53.46%)。

本基金债券投资的信用评级情况采用标准普尔、惠誉国际提供的债券信用评级信息统计及汇总。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	214,799,755.15	107,291,791.17
未评级	25,323,529.95	16,530,129.17
合计	240,123,285.10	123,821,920.34

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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	41,875,202.44	-	-	571,418.41	42,446,620.85
结算备付金	849.50	-	-	6,134,273.65	6,135,123.15
存出保证金	109.12	-	-	-	109.12
交易性金融资产	70,114,341.64	41,489,649.76	128,519,293.70	-	240,123,285.10
应收申购款	-	-	-	5,618,099.59	5,618,099.59
资产总计	111,990,502.70	41,489,649.76	128,519,293.70	12,323,791.65	294,323,237.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	107,950.36	107,950.36
应付管理人报酬	-	-	-	138,234.37	138,234.37
应付托管费	-	-	-	46,078.11	46,078.11
应交税费	-	-	-	21,826.98	21,826.98
其他负债	-	-	-	80,188.70	80,188.70
负债总计	-	-	-	394,278.52	394,278.52
利率敏感度缺口	111,990,502.70	41,489,649.76	128,519,293.70	11,929,513.13	293,928,959.29
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	25,002,815.23	-	-	159,513.31	25,162,328.54
结算备付金	844.11	-	-	4,424,185.07	4,425,029.18
存出保证金	357.33	-	-	2,558,734.00	2,559,091.33
交易性金融资产	41,830,984.02	71,455,393.65	10,535,542.67	-	123,821,920.34
衍生金融资产	-	-	-	53,530.00	53,530.00
应收申购款	-	-	-	1,123.25	1,123.25
资产总计	66,835,000.69	71,455,393.65	10,535,542.67	7,197,085.63	156,023,022.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	64,073.60	64,073.60
应付管理人报酬	-	-	-	78,549.07	78,549.07
应付托管费	-	-	-	26,183.02	26,183.02

应交税费	-	-	-	11,857.17	11,857.17
其他负债	-	-	-	165,182.86	165,182.86
负债总计	-	-	-	345,845.72	345,845.72
利率敏感度缺口	66,835,000.69	71,455,393.65	10,535,542.67	6,851,239.91	155,677,176.92

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-2,826,455.23	-895,669.98
	市场利率下降 25 个基点	2,827,114.40	895,772.69

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 2024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	992,493.49	992,493.49
结算备付金	4,139,023.65	4,139,023.65
交易性金融资产	240,123,285.10	240,123,285.10
应收申购款	7,121.10	7,121.10

资产合计	245,261,923.34	245,261,923.34
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	245,261,923.34	245,261,923.34
项目	上年度末 2023年12月31日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的 资产		
货币资金	18,136,143.43	18,136,143.43
结算备付金	2,456,705.32	2,456,705.32
交易性金融资 产	123,821,920.34	123,821,920.34
资产合计	144,414,769.09	144,414,769.09
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	144,414,769.09	144,414,769.09

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	12,263,096.17	7,220,738.45

	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-12,263,096.17	-7,220,738.45
--	-------------------	----------------	---------------

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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资(2023 年 12 月 31 日：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	240,123,285.10	123,821,920.34
第三层次	-	-
合计	240,123,285.10	123,821,920.34

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，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	240,123,285.10	81.58
	其中：债券	240,123,285.10	81.58
	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	48,581,744.00	16.51
8	其他各项资产	5,618,208.71	1.91
9	合计	294,323,237.81	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-	137,074,131.52	46.64
A+至 A-	28,992,909.94	9.86
BBB+至 BBB-	48,732,713.69	16.58
BB+至 BB-	-	-

B+至 B-	-	-
未评级	25,323,529.95	8.62

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	US91282CGM73	T 3 1/2 02/15/33	31,000	20,956,702.04	7.13
2	US91282CHC82	T 3 3/8 05/15/33	31,000	20,529,607.11	6.98
3	US912810PW27	T 4 3/8 02/15/38	28,000	20,197,879.79	6.87
4	US91282CJJ18	T 4 1/2 11/15/33	27,000	19,492,766.25	6.63
5	US91282CHT18	T 3 7/8 08/15/33	28,000	19,450,985.24	6.62

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 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在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规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	109.12
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,618,099.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,618,208.71

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 比例	持有份额	占总份额 比例
36,932	8,484.54	179,772,105.17	57.37%	133,578,941.16	42.63%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	申万宏源证券有限公司	11,058,182.00	7.13%
2	北京天道众合投资管理有限公司-天道众合一号私募证券投资基金	8,350,003.00	5.38%
3	东吴基金-东吴证券股份有限公司-东吴基金浩瀚 19 号单一资产管理计划	5,511,694.00	3.55%
4	兴业证券股份有限公司	3,400,030.00	2.19%
5	郭耀华	3,186,000.00	2.05%
6	北京天道众合投资管理有限公司-天道众合二号私募证券投资基金	3,007,946.00	1.94%
7	西安智本私募基金管理有限公司-智本远行 1 号私募证券投资基金	3,000,015.00	1.93%
8	深圳市华晟达投资控股有限公司	2,500,000.00	1.61%
9	祝杰	2,067,983.00	1.33%
10	华泰证券股份有限公司	1,958,782.00	1.26%

注：持有人为场内持有人。

8.3 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	3,683,435.21	1.1755%

8.4 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§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	163,773,631.44
本报告期基金总申购份额	202,509,882.57

减：本报告期基金总赎回份额	52,932,467.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	313,351,046.33

§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

报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Mizuho Securities	-	-	-	-	-	-

Asia Limited						
CICC HK SEC. LTD.	-	-	-	-	-	-
CHINA CITIC BANK INTERNATI ONAL LIMITED	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Limited, London.	-	-	-	-	-	-
GUOTAI JUNAN SECURITIE S (HONG KONG) LIMITED	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International plc	-	-	-	-	-	-
HUATAI FINANCIAL HOLDINGS (HONG KONG) LIMITED	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
BANK OF CHINA (HONG KONG)	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-

GOLDMAN SACHS (ASIA) SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE EUROPE LTD	-	-	-	-	-	-
CSI Global Markets Limited	-	-	-	-	-	-
ICBC International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-
Nomura International plc	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

2、(1)交易单元的选择标准

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

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		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
Mizuho Securities Asia Limited	87,577,116.64	43.48%	-	-	-	-	-	-

CICC HK SEC. LTD.	60,94 5,449 .67	30.26%	-	-	-	-	-	-
CHI NA CITI C BAN K INTE RNA TIO NAL LIMI TED	31,14 4,549 .21	15.46%	-	-	-	-	-	-
Citigr oup Glob al Mark ets Limit ed, Lond on.	6,877 ,545. 46	3.41%	-	-	-	-	-	-
GUO TAI JUN AN SEC URIT IES (HO NG KON G) LIMI TED	5,741 ,245. 44	2.85%	-	-	-	-	-	-
Morg an Stanl ey & Co. Inter	4,917 ,511. 33	2.44%	-	-	-	-	-	-

natio nal plc									
HUA TAI FINA NCI AL HOL DIN GS (HO NG KON G) LIMI TED	4,220 ,379. 48	2.10%	-	-	-	-	-	-	-
Stand ard Chart ered Bank	-	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Secur ities Asia Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BAN K OF CHI NA (HO NG KON G)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
J.P. Morg an Secur ities (Asia Pacifi c) Limit	-	-	-	-	-	-	-	-	-

ed								
GOLDMAN SACHS (ASIA) SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDESUISSE EUROPE LTD	-	-	-	-	-	-	-	-
CSI Global Markets Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura International plc	-	-	-	-	-	-	-	-

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）人民币份额新增华宝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	2024-01-26
2	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）人民币份额新增部分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	2024-01-31
3	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）人民币份额新增部分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	2024-02-07
4	海富通基金管理有限公司关于开展海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）人民币份额直销中心赎回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	2024-02-28
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增奕丰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	2024-03-04
6	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）人民币份额新增国泰君安证券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	2024-03-04
7	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）人民币份额新增金元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	2024-03-12
8	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）暂停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	2024-03-12
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	2024-03-21
10	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	2024-03-23
11	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	2024-03-26
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	2024-05-11
13	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	2024-06-03

		电子披露网站	
14	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	2024-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024/2/2-2024/3/1 1	-	52,492,388.45	-	52,492,388.45	16.75%
	2	2024/1/18-2024/2/1 1	31,890,081.85	-	-	31,890,081.85	10.18%
	3	2024/1/18-2024/1/24 24	26,555,779.71	-	-	26,555,779.71	8.47%

产品特有风险

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

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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

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

务。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

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

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

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

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通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他文件

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日