

海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金  
2024 年中期报告  
2024 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| § 1 重要提示及目录                             | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| § 2 基金简介                                | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 6  |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现                       | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| § 4 管理人报告                               | 8  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 14 |
| § 5 托管人报告                               | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 14 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计）                     | 15 |
| 6.1 资产负债表                               | 15 |
| 6.2 利润表                                 | 16 |
| 6.3 净资产变动表                              | 17 |
| 6.4 报表附注                                | 19 |
| 7 投资组合报告                                | 34 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 34 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 35 |
| 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       | 35 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 35 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 35 |
| 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      | 36 |
| 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   | 36 |
| 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   | 36 |
| 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      | 36 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 36 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 37 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 37 |
| § 8 基金份额持有人信息                           | 37 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 37 |

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 38        |
| 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 ..... | 38        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....              | <b>38</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示</b> .....                | <b>38</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 38        |
| 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 .....  | 38        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 38        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 39        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 39        |
| 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 .....     | 39        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 39        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 40        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....        | <b>40</b> |
| <b>§ 12 备查文件目录</b> .....                | <b>41</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 41        |
| 12.2 存放地点 .....                         | 41        |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 41        |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

|            |                          |
|------------|--------------------------|
| 基金名称       | 海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称       | 海富通裕通 30 个月定开债券          |
| 基金主代码      | 008231                   |
| 交易代码       | 008231                   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                   |
| 基金合同生效日    | 2019 年 12 月 20 日         |
| 基金管理人      | 海富通基金管理有限公司              |
| 基金托管人      | 中国光大银行股份有限公司             |
| 报告期末基金份额总额 | 7,980,884,254.92 份       |
| 基金合同存续期    | 不定期                      |

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金投资于剩余期限或回售期限不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，采用严格的买入持有到期投资策略，力求为投资人带来稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 投资策略   | <p>本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现，本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资产到期日（或回售日）不得晚于封闭运作期到期日。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。基金管理人可以基于持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置。</p> <p>开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p> |
| 业绩比较基准 | 该封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的金融机构 2 年期定期存款利率（税后）×125%                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 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。                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |

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          | 中国光大银行股份有限公司          |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 岳冲                   | 石立平                   |
|             | 联系电话 | 021-38650788         | 010-63639180          |
|             | 电子邮箱 | chongyue@hftfund.com | shiliping@cebbank.com |
| 客户服务电话      |      | 40088-40099          | 95595                 |

|       |                                                                |                               |
|-------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------|
| 传真    | 021-33830166                                                   | 010-63639132                  |
| 注册地址  | 中国（上海）自由贸易试验区<br>陆家嘴环路479号18层<br>1802-1803室以及19层<br>1901-1908室 | 北京市西城区太平桥大街25<br>号、甲25号中国光大中心 |
| 办公地址  | 中国（上海）自由贸易试验区<br>陆家嘴环路479号18层<br>1802-1803室以及19层<br>1901-1908室 | 北京市西城区太平桥大街25号<br>中国光大中心      |
| 邮政编码  | 200120                                                         | 100033                        |
| 法定代表人 | 杨仓兵                                                            | 吴利军                           |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称          | 办公地址                                                               |
|--------|-------------|--------------------------------------------------------------------|
| 注册登记机构 | 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<br>479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层<br>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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 85,178,873.72                        |
| 本期利润          | 85,178,873.72                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0107                               |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.03%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.03%                                |
| 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      | 302,056,065.05                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0378                               |
| 期末基金资产净值      | 8,282,940,319.97                     |
| 期末基金份额净值      | 1.0378                               |
| 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 | 12.29% |
|-------------|--------|

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，由于本基金采用摊余成本法核算，所以，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、上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)。

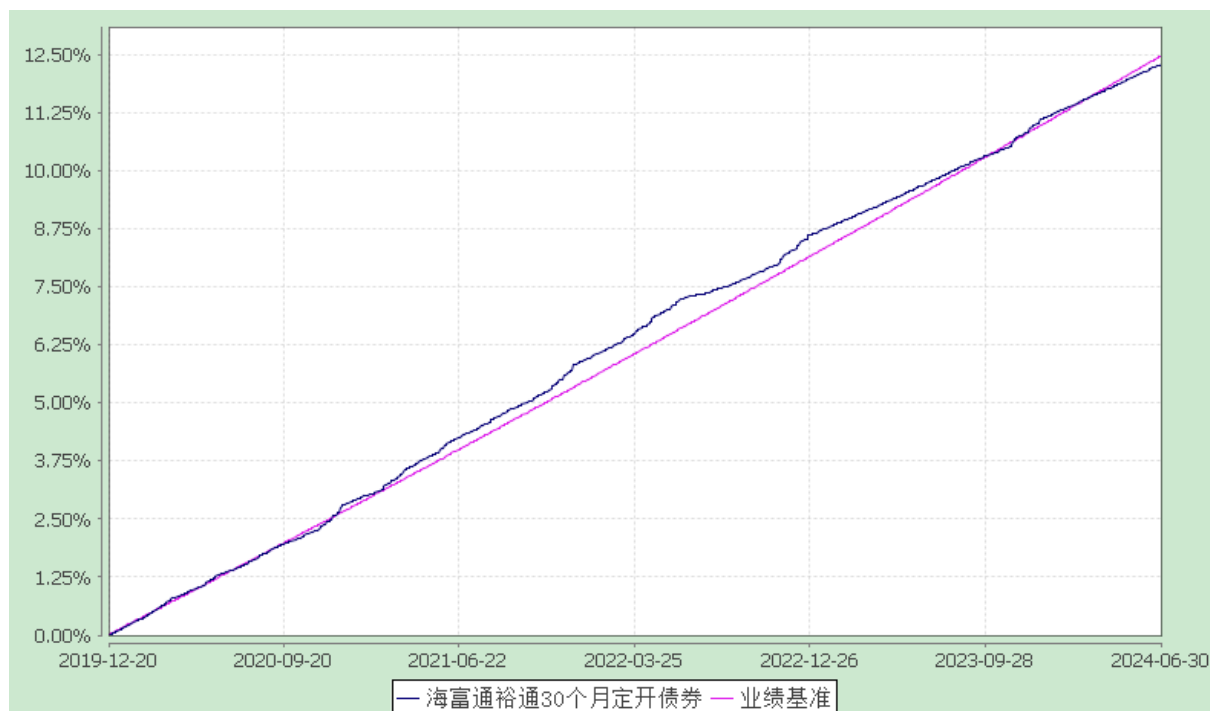
3.2 基金净值表现

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      | 0.16%    | 0.01%       | 0.21%      | 0.01%         | -0.05% | 0.00% |
| 过去三个月      | 0.52%    | 0.01%       | 0.65%      | 0.01%         | -0.13% | 0.00% |
| 过去六个月      | 1.03%    | 0.01%       | 1.30%      | 0.01%         | -0.27% | 0.00% |
| 过去一年       | 2.33%    | 0.01%       | 2.63%      | 0.01%         | -0.30% | 0.00% |
| 过去三年       | 7.66%    | 0.01%       | 8.09%      | 0.01%         | -0.43% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.29%   | 0.01%       | 12.47%     | 0.01%         | -0.18% | 0.00% |

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

海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019 年 12 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于 2019 年 12 月 20 日生效。按基金合同规定，本基金应当自每个封闭期开始之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。自 2022 年 7 月 14 日至 2025 年 1 月 13 日止，为本基金的第二个封闭期。截止本报告期末，本基金第二个封闭期的建仓期已结束。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，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 97 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券

投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券

投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通瑞鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、海富通优势驱动混合型证券投资基金、海富通 ESG 领先股票型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通数字经济混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名  | 职务                         | 任本基金的基金经理<br>（助理）期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|----------------------------|---------------------|------|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                            | 任职日期                | 离任日期 |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 张靖爽 | 本基金的基金<br>经理；债券基<br>金部副总监。 | 2019-12-2<br>0      | -    | 14 年       | 硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中银基金管理有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司投资经理、基金经理助理、研究员。2016 年 7 月至 2017 年 10 月任海富通双利债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海富通纯债债券基金经理。2017 年 8 月起兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）和海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018 年 2 月至 2021 年 2 月任海富通融丰定开债券基金经理。2018 年 11 月至 2020 年 10 月任海富通鼎丰定开债券基金经理。2019 年 5 月至 2022 年 12 月兼任海富通新内需混合基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 4 月任海富通聚合纯债基金经理。2019 年 12 月起兼任海富通裕通 30 个月定开债券基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通裕昇三年定开债券基金经理。2020 年 5 月至 2021 年 7 月兼任海富通瑞弘 6 个月定开债券基金经理。 |

|     |          |            |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----|----------|------------|---|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          |            |   |      | 2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通瑞兴 3 个月定开债券基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 方昆明 | 本基金的基金经理 | 2023-01-18 | - | 14 年 | 硕士。持有基金从业人员资格证书。历任浙商银行投资经理、民生银行投资高级经理、渤海银行上海分行金融市场一部总经理助理、营口银行上海金融中心债券投资交易主管、北京肯特瑞基金销售有限公司产品管理和投资总监、上海富诚海富通资产管理有限公司投资管理部总经理。2021 年 9 月加入海富通基金管理有限公司。2021 年 10 月至 2023 年 11 月任海富通强化回报混合基金经理。2022 年 2 月起兼任海富通集利债券、海富通弘丰定开债券基金经理。2022 年 7 月起兼任海富通上清所短融债券、海富通中债 1-3 年农发基金经理。2023 年 1 月起兼任海富通瑞福债券、海富通裕通 30 个月定开债券基金经理。2023 年 1 月至 2024 年 4 月兼任海富通裕昇三年定开债券基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通一年定开债券、海富通聚合纯债债券基金经理。2024 年 4 月起兼任海富通融丰定开债券基金经理。 |

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内经济企稳回升，实际 GDP 增速达到 5%。整体来看，生产端修复节奏好于需求端，PMI 在 3 月重回扩张区间，但持续性略有不足。投资端方面，制造业与基建投资实现高增，地产投资跌幅走扩。消费增速回落，可选消费与地产后周期消费偏弱。出口方面，出口同比与贸易顺差双双回升。通胀方面，CPI 总体弹性有限，维持在 0-1% 的区间窄幅震荡；PPI 在基数效应下跌幅收窄但仍未转正。货币政策方面，上半年调降 5 年期 LPR25bp，全面降准 0.5 个百分点，体现了货币政策引导降低实体融资成本的目的。财政政策方面，超长期特别国债落地，2024 年将率先发行 1 万亿；同时地方债稳步发行。流动性方面，总体维持合理充裕的状态，但分层的现象较为突出。资金价格方面，上半年 R001 与 R007 均值为 1.84% 和 2.03%。对应债市而言，上半年走出牛市行情。

信用债方面，供求矛盾持续，收益率进一步走低，2.3% 以上合意资产难觅，不过结构特征较去年有所变化。需求端，大行存款流失而理财规模快速增长，市场定价权一定程度向非银倾斜，非银主导的中短端信用债表现较强；供给端，信用债供给总量并不少，主要是收益率低位，超长信用债供给放量，以高等级央国企产业债为主，城投债净融资额持续低位徘徊。整体而言，随着资产荒持续演绎，今年信用债“利率化”趋势加大，市场对信用风险钝化，等级利差、期限利差多数创历史新低。

报告期内，组合以利率债和高等级信用债为主，利用债券的比价效应，买入同期限下的最优债

券资产，并合理分布资产的到期时间。另一方面，通过银行间和交易所两个市场的融资期限和价格分析，不断持续优化融资成本，实现收益最大化。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 1.03%，同期业绩比较基准收益率为 1.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济或维持修复状态。投资方面，基建在超长期特别国债与地方债发力的情况下有望保持较高的景气度；制造业投资在高技术领域或将继续发力；地产投资在政策端可能仍有调整的空间。通胀方面，CPI 有望维持在正增区间；PPI 在需求端弹性有限，基数效应下跌幅有望继续收窄。货币政策方面，流动性的合理充裕或维持，总量层面仍有降准降息的可能性。财政方面，超长期特别国债持续发力，地方债发行有望提速。下半年对债券市场中性偏乐观。资金面与流动性方面，央行重建利率走廊，资金价格的波动或被熨平。基本面方面，当前经济环比动能不足，关注下半年增量政策的出台。目前可预期的风险或来自于政府债券供给，如果地方债集中发行，债券市场可能面临一定的调整风险。综合来看，基本面因素对债市利好；信贷需求偏弱，债券收益率中枢仍然处于下行通道。

信用债方面，实体融资需求修复仍是核心，预计资产荒仍会持续。需求端，需谨防理财规模持续膨胀与净值平滑监管趋严的扰动；供给方面，除利率债外，金融债或有放量，但扰动有限，重点关注城投政策动向。

#### 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，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、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。估值委员会下设估值工作小组，估值工作小组对经济环境发生重大变化或证券发行人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，向估值委员会提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金会计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，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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，中国光大银行股份有限公司在海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

#### 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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

#### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金 2024 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：

财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确。

§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：海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号        | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|----------|------------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |            |                        |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1    | 578,087.31             | 721,951.71               |
| 结算备付金    |            | 22,158,770.57          | 93,504,475.56            |
| 存出保证金    |            | -                      | -                        |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2    | -                      | -                        |
| 其中：股票投资  |            | -                      | -                        |
| 基金投资     |            | -                      | -                        |
| 债券投资     |            | -                      | -                        |
| 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    | -                      | -                        |
| 债权投资     | 6. 4. 7. 5 | 12,931,983,043.26      | 13,302,540,078.14        |
| 其中：债券投资  |            | 12,931,983,043.26      | 13,302,540,078.14        |
| 资产支持证券投资 |            | -                      | -                        |
| 其他投资     |            | -                      | -                        |
| 应收清算款    |            | -                      | 4,912.35                 |
| 应收股利     |            | -                      | -                        |
| 应收申购款    |            | -                      | -                        |
| 递延所得税资产  |            | -                      | -                        |
| 其他资产     | 6.4.7.6    | -                      | -                        |
| 资产总计     |            | 12,954,719,901.14      | 13,396,771,417.76        |
| 负债和净资产   | 附注号        | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>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 |         | 4,670,183,340.27  | 5,197,268,623.97  |
| 应付清算款     |         | 8,045.55          | -                 |
| 应付赎回款     |         | -                 | -                 |
| 应付管理人报酬   |         | 1,017,502.62      | 1,042,840.95      |
| 应付托管费     |         | 339,167.51        | 347,613.62        |
| 应付销售服务费   |         | -                 | -                 |
| 应付投资顾问费   |         | -                 | -                 |
| 应交税费      |         | -                 | -                 |
| 应付利润      |         | -                 | -                 |
| 递延所得税负债   |         | -                 | -                 |
| 其他负债      | 6.4.7.7 | 231,525.22        | 350,892.97        |
| 负债合计      |         | 4,671,779,581.17  | 5,199,009,971.51  |
| 净资产：      |         |                   |                   |
| 实收基金      | 6.4.7.8 | 7,980,884,254.92  | 7,980,884,254.92  |
| 未分配利润     | 6.4.7.9 | 302,056,065.05    | 216,877,191.33    |
| 净资产合计     |         | 8,282,940,319.97  | 8,197,761,446.25  |
| 负债和净资产总计  |         | 12,954,719,901.14 | 13,396,771,417.76 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0378 元，基金份额总额 7,980,884,254.92 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入          |          | 142,420,933.65                           | 144,165,197.14                                |
| 1.利息收入           |          | 142,420,933.65                           | 144,165,197.14                                |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.10 | 590,260.75                               | 355,724.85                                    |
| 债券利息收入           |          | 141,830,672.90                           | 143,809,472.29                                |
| 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           |          | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | -                                        | -                                             |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.11 | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益           |          | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益           | 6.4.7.12 | -                                        | -                                             |
| 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 | -                                        | -                                             |

|                       |                 |               |               |
|-----------------------|-----------------|---------------|---------------|
| 股利收益                  | 6.4.7.15        | -             | -             |
| 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        | -             | -             |
| 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             |                 | 57,242,059.93 | 63,028,660.19 |
| 1. 管理人报酬              |                 | 6,146,016.12  | 5,989,949.91  |
| 2. 托管费                |                 | 2,048,672.04  | 1,996,649.96  |
| 3. 销售服务费              |                 | -             | -             |
| 4. 投资顾问费              |                 | -             | -             |
| 5. 利息支出               |                 | 49,304,482.33 | 54,825,238.92 |
| 其中：卖出回购金融资产支出         |                 | 49,304,482.33 | 54,825,238.92 |
| 6. 信用减值损失             | 6. 4. 7. 1<br>8 | -370,192.22   | 79,251.85     |
| 7. 税金及附加              |                 | -             | -             |
| 8. 其他费用               | 6.4.7.19        | 113,081.66    | 137,569.55    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）   |                 | 85,178,873.72 | 81,136,536.95 |
| 减：所得税费用               |                 | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）     |                 | 85,178,873.72 | 81,136,536.95 |
| 五、其他综合收益的税后净额         |                 | -             | -             |
| 六、综合收益总额              |                 | 85,178,873.72 | 81,136,536.95 |

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                |                |                  |
|----------------------|---------------------------------------|----------------|----------------|------------------|
|                      | 实收基金                                  | 其他综合<br>收益（若有） | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产            | 7,980,884,254.92                      | -              | 216,877,191.33 | 8,197,761,446.25 |
| 二、本期期初净资产            | 7,980,884,254.92                      | -              | 216,877,191.33 | 8,197,761,446.25 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -                                     | -              | 85,178,873.72  | 85,178,873.72    |
| （一）、综合收益总额           | -                                     | -              | 85,178,873.72  | 85,178,873.72    |

|                                          |                                            |            |                |                  |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|------------|----------------|------------------|
| (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)      | -                                          | -          | -              | -                |
| 其中: 1.基金申购款                              | -                                          | -          | -              | -                |
| 2.基金赎回款                                  | -                                          | -          | -              | -                |
| (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                                | 7,980,884,254.92                           | -          | 302,056,065.05 | 8,282,940,319.97 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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                                | 7,980,884,254.92                           | -          | 32,440,462.81  | 8,013,324,717.73 |
| 二、本期期初净资产                                | 7,980,884,254.92                           | -          | 32,440,462.81  | 8,013,324,717.73 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -                                          | -          | 81,136,536.95  | 81,136,536.95    |
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -          | 81,136,536.95  | 81,136,536.95    |
| (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)      | -                                          | -          | -              | -                |
| 其中: 1.基金申购款                              | -                                          | -          | -              | -                |
| 2.基金赎回款                                  | -                                          | -          | -              | -                |
| (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                                | 7,980,884,254.92                           | -          | 113,576,999.76 | 8,094,461,254.   |

|   |  |  |  |    |
|---|--|--|--|----|
| 产 |  |  |  | 68 |
|---|--|--|--|----|

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

海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2041 号《关于准予海富通裕通 30 个月定期开放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《海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，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 5,529,993,975.04 元。经向中国证监会备案，《海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2019 年 12 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,530,269,825.40 份基金份额，其中认购资金利息折合 275,850.36 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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金以 30 个月为一个封闭期，自基金合同生效后，每 30 个月开放一次申购和赎回。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为债券(国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分等)、资产支持证券、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不投资股票，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。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%。但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，本基金的债券资产的投资比例可不受前述限制。开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，封闭期内，本基金不受前述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为：在每个封闭

期起始日的中国人民银行公布并执行的金融机构 2 年期定期存款利率(税后)×125%。

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》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》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 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。

#### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

(d) 本基金城市维护建设税、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<br>2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 578,087.31             |
| 等于：本金          | 549,757.95             |
| 加：应计利息         | 28,329.36              |
| 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             | 578,087.31             |

6.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末未持有交易性金融资产。

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 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |               |                |            |                   |
|--------|-------|------------------------|---------------|----------------|------------|-------------------|
|        |       | 初始成本                   | 利息调整          | 应计利息           | 减：减值准备     | 账面价值              |
| 债券     | 交易所市场 | 3,037,000,000.00       | 4,321,318.25  | 62,126,615.07  | 291,480.06 | 3,103,156,453.26  |
|        | 银行间市场 | 9,600,000,000.00       | 65,368,082.71 | 163,973,479.56 | 514,972.27 | 9,828,826,590.00  |
|        | 小计    | 12,637,000,000.00      | 69,689,400.96 | 226,100,094.63 | 806,452.33 | 12,931,983,043.26 |
| 资产支持证券 |       | -                      | -             | -              | -          | -                 |
| 其他     |       | -                      | -             | -              | -          | -                 |
| 合计     |       | 12,637,000,000.00      | 69,689,400.96 | 226,100,094.63 | 806,452.33 | 12,931,983,043.26 |

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

| 减值准备      | 第一阶段           | 第二阶段                 | 第三阶段                 | 合计           |
|-----------|----------------|----------------------|----------------------|--------------|
|           | 未来 12 个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失(未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失(已发生信用减值) |              |
| 期初余额      | 1,176,644.55   | -                    | -                    | 1,176,644.55 |
| 本期从其他阶段转入 | -              | -                    | -                    | -            |
| 本期转出至其他阶段 | -              | -                    | -                    | -            |
| 本期新增      | 583,440.79     | -                    | -                    | 583,440.79   |
| 本期转回      | 953,633.01     | -                    | -                    | 953,633.01   |
| 其他变动      | -              | -                    | -                    | -            |
| 期末余额      | 806,452.33     | -                    | -                    | 806,452.33   |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 127,743.56             |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 127,743.56             |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 103,781.66             |
| 合计          | 231,525.22             |

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 7,980,884,254.92                      | 7,980,884,254.92 |
| 本期申购          | -                                     | -                |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -                |
| 本期末           | 7,980,884,254.92                      | 7,980,884,254.92 |

6.4.7.9 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           | 216,877,191.33 | -     | 216,877,191.33 |
| 本期期初           | 216,877,191.33 | -     | 216,877,191.33 |
| 本期利润           | 85,178,873.72  | -     | 85,178,873.72  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -              | -     | -              |
| 其中：基金申购款       | -              | -     | -              |
| 基金赎回款          | -              | -     | -              |
| 本期已分配利润        | -              | -     | -              |
| 本期末            | 302,056,065.05 | -     | 302,056,065.05 |

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 63,309.59                             |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 526,951.16                            |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 590,260.75                            |

6.4.7.11 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 |
|----|-------------------------------------|
|----|-------------------------------------|

|          | 日           |
|----------|-------------|
| 银行存款     | -           |
| 买入返售金融资产 | -           |
| 债权投资     | -370,192.22 |
| 其他债权投资   | -           |
| 其他       | -           |
| 合计       | -370,192.22 |

注：本基金采用“预期信用损失”模型确认以摊余成本计量的金融资产的信用损失准备。在预期信用损失的计量中所包含的重大判断和假设主要包括：选择恰当的预期信用损失模型并确定相关参数、减值阶段划分的判断标准以及用于计量预期信用损失的前瞻性信息及其权重的采用等。本基金结合中债金融估值中心有限公司提供的预期信用损失比例和资产负债表日的资产账面余额计算预期信用损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 审计费用      | 34,809.32                  |
| 信息披露费     | 59,672.34                  |
| 证券出借违约金   | -                          |
| 债券托管账户维护费 | 18,600.00                  |
| 合计        | 113,081.66                 |

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、登记机构（自 TA）、基金 |

|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
|                      | 销售机构            |
| 中国光大银行股份有限公司(“光大银行”) | 基金托管人、基金销售机构    |
| 海通证券股份有限公司(“海通证券”)   | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6<br>月30日 |
|------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 6,146,016.12                   | 5,989,949.91                        |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 392,661.19                     | 382,693.53                          |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 5,753,354.93                   | 5,607,256.38                        |

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 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 x0.15%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6<br>月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,048,672.04                   | 1,996,649.96                        |

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 x0.05%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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              |           |
|-------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
|       | 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    |
| 光大银行  | 578,087.31           | 63,309.59 | 558,239.59           | 14,373.73 |

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无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

本基金截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,292,908,100.64 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称     | 回购到期日      | 期末估值<br>单价 | 数量（张）      | 期末估值总额           |
|--------|----------|------------|------------|------------|------------------|
| 180401 | 18 农发 01 | 2024-07-01 | 103.70     | 24,521,000 | 2,542,916,120.77 |
| 合计     |          |            |            | 24,521,000 | 2,542,916,120.77 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,377,275,239.63 元，于 2024 年 11 月 25 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，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于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 84.60%（2023 年 12 月 31 日：87.96%）。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 5,505,494,203.26  | 5,613,833,019.66    |
| AAA 以下 | -                 | -                   |

|     |                   |                   |
|-----|-------------------|-------------------|
| 未评级 | 7,426,488,840.00  | 7,688,707,058.48  |
| 合计  | 12,931,983,043.26 | 13,302,540,078.14 |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。  
2、未评级部分为政策性金融债及无第三方评级机构评级的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间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%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。在开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                   | 578,087.31        | -     | -     | -   | 578,087.31        |
| 结算备付金                  | 22,158,770.57     | -     | -     | -   | 22,158,770.57     |
| 债权投资                   | 12,931,983,043.26 | -     | -     | -   | 12,931,983,043.26 |
| 资产总计                   | 12,954,719,901.14 | -     | -     | -   | 12,954,719,901.14 |
| 负债                     |                   |       |       |     |                   |
| 卖出回购金融资产款              | 4,670,183,340.27  | -     | -     | -   | 4,670,183,340.27  |

|                          |                  |                  |       |               |                   |
|--------------------------|------------------|------------------|-------|---------------|-------------------|
| 应付清算款                    | -                | -                | -     | 8,045.55      | 8,045.55          |
| 应付管理人报酬                  | -                | -                | -     | 1,017,502.62  | 1,017,502.62      |
| 应付托管费                    | -                | -                | -     | 339,167.51    | 339,167.51        |
| 其他负债                     | -                | -                | -     | 231,525.22    | 231,525.22        |
| 负债总计                     | 4,670,183,340.27 | -                | -     | 1,596,240.90  | 4,671,779,581.17  |
| 利率敏感度缺口                  | 8,284,536,560.87 | -                | -     | -1,596,240.90 | 8,282,940,319.97  |
| 上年度末<br>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                     | 721,951.71       | -                | -     | -             | 721,951.71        |
| 结算备付金                    | 93,504,475.56    | -                | -     | -             | 93,504,475.56     |
| 应收清算款                    | -                | -                | -     | 4,912.35      | 4,912.35          |
| 债权投资                     | 7,592,022,846.97 | 5,710,517,231.17 | -     | -             | 13,302,540,078.14 |
| 资产总计                     | 7,686,249,274.24 | 5,710,517,231.17 | -     | 4,912.35      | 13,396,771,417.76 |
| 负债                       |                  |                  |       |               |                   |
| 卖出回购金融资产款                | 5,197,268,623.97 | -                | -     | -             | 5,197,268,623.97  |
| 应付管理人报酬                  | -                | -                | -     | 1,042,840.95  | 1,042,840.95      |
| 应付托管费                    | -                | -                | -     | 347,613.62    | 347,613.62        |
| 其他负债                     | -                | -                | -     | 350,892.97    | 350,892.97        |
| 负债总计                     | 5,197,268,623.97 | -                | -     | 1,741,347.54  | 5,199,009,971.51  |
| 利率敏感度缺口                  | 2,488,980,650.27 | 5,710,517,231.17 | -     | -1,736,435.19 | 8,197,761,446.25  |

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

于本报告期末及上年度末，本基金采用买入并持有至到期的投资策略并采用摊余成本计量金融资产和金融负债，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.3 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

其他金融工具主要包括债权投资、应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债。于 2024 年 6 月 30 日，除持债权投资（交易所市场债券：账面价值 3,103,156,453.26 元，公允价值 3,109,882,615.07 元；银行间市场债券：账面价值 9,828,826,590.00 元，公允价值 9,871,734,479.56 元）以外，本基金持有的其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异。于 2023 年 12 月 31 日，除持债权投资（交易所市场债券：账面价值 3,340,980,789.19 元，公允价值 3,347,485,573.44 元；银行间市场债券：账面价值 9,961,559,288.95 元，公允价值 9,970,031,263.47 元）

以外，本基金持有的其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异。

除特别声明外，本基金按下述原则确认公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

根据中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额                | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|-------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | -                 | -            |
|    | 其中：股票             | -                 | -            |
| 2  | 基金投资              | -                 | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 12,931,983,043.26 | 99.82        |
|    | 其中：债券             | 12,931,983,043.26 | 99.82        |
|    | 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          | -                 | -            |
|    | 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 | 22,736,857.88     | 0.18   |
| 8 | 其他各项资产       | -                 | -      |
| 9 | 合计           | 12,954,719,901.14 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票交易。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 9,828,826,590.00 | 118.66       |
|    | 其中：政策性金融债 | 5,924,487,220.05 | 71.53        |

|    |           |                   |        |
|----|-----------|-------------------|--------|
| 4  | 企业债券      | -                 | -      |
| 5  | 企业短期融资券   | -                 | -      |
| 6  | 中期票据      | -                 | -      |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                 | -      |
| 8  | 同业存单      | -                 | -      |
| 9  | 其他        | 3,103,156,453.26  | 37.46  |
| 10 | 合计        | 12,931,983,043.26 | 156.13 |

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  | 180401  | 18 农发 01   | 35,700,000 | 3,702,218,731.35 | 44.70        |
| 2  | 200203  | 20 国开 03   | 16,100,000 | 1,641,560,506.48 | 19.82        |
| 3  | 2128046 | 21 浦发银行 02 | 7,500,000  | 761,856,244.04   | 9.20         |
| 4  | 2120116 | 21 南京银行 01 | 6,900,000  | 700,561,039.48   | 8.46         |
| 5  | 2128035 | 21 华夏银行 02 | 6,100,000  | 621,154,191.42   | 7.50         |

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

根据合同规定，本基金不投资股指期货。

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

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，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的处罚，中国民生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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末无其他资产。

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>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<br>比例 | 持有份额  | 占总份额<br>比例 |

|     |               |                  |         |          |       |
|-----|---------------|------------------|---------|----------|-------|
| 236 | 33,817,306.16 | 7,980,875,287.34 | 100.00% | 8,967.58 | 0.00% |
|-----|---------------|------------------|---------|----------|-------|

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 836.65    | 0.0000%  |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 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（2019 年 12 月 20 日）基金份额总额 | 5,530,269,825.40 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 7,980,884,254.92 |
| 本报告期基金总申购份额                     | -                |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | -                |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 7,980,884,254.92 |

§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，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

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，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 海通证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：1、报告期内基金租用券商交易单元未发生变化。

2、(1)交易单元的选择标准

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

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | 回购交易 | 权证交易 |
|------|------|------|------|
|------|------|------|------|

|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的<br>比例 | 成交金额              | 占当期回购成交总额的<br>比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的<br>比例 |
|------|------|------------------|-------------------|------------------|------|------------------|
| 海通证券 | -    | -                | 53,463,455,000.00 | 100.00%          | -    | -                |

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旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-05-07 |

§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

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，确认利息收入，并评估减值准备。截止 2024 年 6 月 30 日，根据中债金融估值中心有限公司提供的预期信用损失率，本基金计提减值准备 806,452.33 元，对应减值阶段一。

本报告中投资组合报告公允价值部分均以摊余成本列示。

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裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金的文件
- (二)海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同
- (三)海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其它文件

### 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

二〇二四年八月三十日