海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF） 2019年半年度报告摘要

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：二〇一九年八月二十八日

1 重要提示

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。本半年度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2019年8月27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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通美元债(QDII)
场内简称	美元债
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	80,687,072.73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，除了需要承担与国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	奚方荣	王永民
	联系电话	021-38650891	010-66594896
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942

2.4 信息披露方式

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

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（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	2,610,848.71
本期利润	4,343,870.23
加权平均基金份额本期利润	0.0448
本期基金份额净值增长率	4.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0186
期末基金资产净值	84,355,417.58
期末基金份额净值	1.0455

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)。

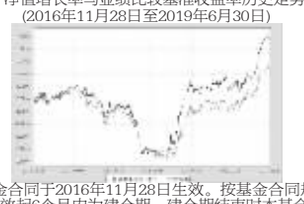
3.2 基金净值表现

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	0.48%	0.13%	0.62%	0.22%	-0.14%	-0.09%
过去三个月	3.72%	0.16%	5.04%	0.29%	-1.32%	-0.13%
过去六个月	4.99%	0.21%	5.54%	0.31%	-0.55%	-0.10%
过去一年	9.95%	0.25%	11.01%	0.32%	-1.06%	-0.07%
自基金合同生效起至今	4.55%	0.23%	8.51%	0.30%	-3.96%	-0.07%

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2019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四部分（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2019年6月30日，本基金管理人共管理61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、上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通安顾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、海富通双福债券型证券投资基金、海富通季季增利理财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、海富通雷祥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、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、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、海富通富睿混合型证券投资基金、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、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）、海富通量化前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、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、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、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、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）。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈轶平	本基金的基金经理；海富通债券基金经理；海富通货币基金经理；海富通季季增利理财债券基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通一年定开债券基金经理；海富通上证城投债ETF基金经理；海富通富获祥混合基金经理；海富通上证周期产业债ETF基金经理；海富通瑞合纯债基金经理；海富通富睿混合基金经理；海富通瑞福债券基金经理；海富通瑞祥一年定开债券基金经理；海富通恒丰定开债券基金经理；海富通上证10年期地方政府债ETF基金经理；海富通弘丰定开债券基金经理；海富通鼎丰定期开放债券基金经理；固定收益投资副总监。	2016-11-28	-	10年	博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任Mainet Investment Group LLC数量金融分析师，瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011年10月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监。现任固定收益投资副总监，2013年8月起任海富通货币基金经理，2014年8月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理，2014年11月起兼任海富通上证可质押城投债ETF（现为海富通上证城投债ETF）基金经理，2015年12月起兼任海富通稳固收益债券基金经理，2015年12月至2017年9月兼任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理，2016年4月起兼任海富通一年定开债券基金经理，2016年7月起兼任海富通富祥混合基金经理，2016年8月起兼任海富通瑞丰一年定开债券（现为海富通瑞丰债券）基金经理，2016年8月至2017年11月兼任海富通瑞益债券基金经理，2016年11月起兼任海富通天元债（QDII）基金经理，2017年1月起兼任海富通上证周期产业债ETF基金经理，2017年2月起兼任海富通瑞利债券基金经理，2017年3月至2018年6月兼任海富通富源债券基金经理，2017年3月起兼任海富通瑞合纯债基金经理，2017年5月起兼任海富通富睿混合基金经理，2017年7月起兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券），海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017年7月至2018年12月兼任海富通欣悦混合基金经理，2018年4月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018年10月起兼任海富通上证10年期地方政府债ETF基金经理。2018年11月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理，2019年1月起兼任海富通上海所短融债券基金经理。
陆丛凡	本基金的基金经理助理；海富通上证可质押城投债ETF基金经理助理；海富通聚利债券基金经理助理；海富通上证周期产业债ETF基金经理助理；海富通富睿混合基金经理助理；海富通恒丰定开债券基金经理助理；海富通上证10年期地方政府债ETF的基金经理助理；海富通上海所短融债券的基金经理助理。	2017-02-07	2019-07-03	7年	硕士，持有基金从业人员资格证书。曾任瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交量分析师，2015年4月加入海富通基金管理有限公司，2015年6月至2019年7月任海富通固定收益摆臂基金经理助理，2019年7月起任海富通上证城投债ETF、海富通上证10年期地方政府债ETF、海富通上海所短融债券的基金经理。

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为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

3、本公司于2019年7月3日发布公告，自2019年7月3日起，陆丛凡先生不再担任本基金的基金经理助理。

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遵规守信情况的说明

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

公司根据证监会2011年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度，公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部门、监察稽核部和风险管理部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证本报告期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

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

在6月美联储议息会议上，美联储宣布维持基准利率不变，但由于经济前景的不确定性上升，美联储态度偏鸽，指向未来有降息的可能。在会议声明中，美联储表示将密切关注经济相关指标并采取适当措施来维持经济增长。2018年美联储主席鲍威尔表态支持渐进加息，美联储逐步加息至2.25-2.5%区间，但目前美联储潜在的降息意愿表明其态度已经发生彻底的转向。美联储议息会议是在欧央行行长发布声明后召开的，后者在声明中称，若欧洲经济增长没有改善，欧央行将采取降息措施或购买更多欧元区债券。欧美央行释放宽松信号，致使季末政府债券收益率处于低位。降息预期影响了市场定价，短期政府债券收益率的跌幅超过了对应长期政府债券收益率，收益率曲线走陡。上半年，10年期美国国债收益率下行68BP至2.01%，2年期亦下行了73BP。

在一季度强势反弹后，美元债市场稍有休整，并于二季度进一步走强。中国高收益房地产债表现有所分化。对于评级较高的高收益房地产债券，长期限债券普遍表现优于短期限。与此相反，在评级较低的高收益房地产债券中，短期限债券维持相对稳定但长期限债券有所回调。对于投资级债券而言，二季度美国国债的走强导致信用利差被动走阔。但信用利差走阔的幅度小于美国国债下行的幅度，投资级债券收益率仍下行至2018年以来最低点。在中美贸易摩擦不断升级的影响下，信息科技板块尤其是硬件制造商发行的美元债表现不佳。此外，受一级新发影响，资产管理公司发行的美元债规模扩大，而国企债券表现突出。

上半年，我们卖出部分短期限债券并投资于永续债以提高收益率。同时，我们拉长了部分高收益房地产债久期。为了降低政策风险和个别发行人的负面风险的影响，投资组合分散投资于不同的行业和发行人。

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4.99%，同期业绩比较基准收益率为5.54%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中美之间的长期贸易紧张关系削弱了全球范围内的商业投资、消费者信心以及贸易流通。由于制造业与贸易高度相关，贸易对发达国家PMI的负面影响越来越显著。结合温和的通货膨胀，美联储态度偏鸽，指向未来有降息的可能。实际上，澳大利亚、印度等其他国家的央行在经济放缓之后已经开始下调政策利率。宽松的货币周期降低了固定收益市场的利率风险。

中国近期的经济数据显示出目前国内需求较为疲软，而中美贸易战也拖累了外部需求。为了遏制经济增长放缓，财政部允许将部分地方政府专项债作为符合条件的重大项目资本金用于基础设施建设。货币政策方面，中国人民银行持续向银行体系注入充足的流动性，在岸债券收益率亦有所下行。因此，目前相同发行人发行的中资美元债收益率要高于在岸人民币债券收益率，或吸引更多拥有海外投资额度的在岸投资者配置美元债。

年初，中国房地产开发商获得了发改委批准的发行配额，并积极地开拓美元债市场。随着土地成交溢价率上行，政府放缓了在岸和离岸债券发行的审批速度，以遏制开发商拿地积极性。因此，近期众多开发商开始积极寻找其他替代的融资渠道。其他融资渠道会提高开发商的融资成本，同时考虑到愈加严格的债券发行审批流程，开发商可利用的年度配额受限，或导致未来中国房地产债供应量的下降。在今年前半年发行短期限债券后，开发商或将利用剩余的配额来发行长期限债券以平滑债务期限结构。

在经济增长放缓及货币政策稳健宽松的背景下，今年的利率风险较低。受贸易关系长期紧张的影响，美国国债收益率已位于较低水平，我们将密切关注拉长久期的机会。对于投资级债券，考虑到BBB级利差水平较高，相较A级债券，我们更偏好BBB级债券。对于高收益债券，中国房地产行业仍然是我们首选的板块，我们将有选择地拉长部分地产债的久期。而对于非房地产类的高收益债券，市场对部分流动性紧张的发行人持谨慎态度，而我们将密切关注国有企业。

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。

4.8 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 托管人对本半年度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”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：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,137,142.35	7,922,918.95
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	77,850,931.47	105,157,950.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		77,850,931.47	105,157,950.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,450,752.68	-
应收利息	6.4.7.5	1,383,396.30	1,464,549.41
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		85,822,222.80	114,535,418.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,269,713.99	298,535.67
应付管理人报酬		64,287.19	87,324.04
应付托管费		17,857.56	24,256.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		13,306.16	16,730.38
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	101,640.32	352,000.00
负债合计		1,466,805.22	778,846.77
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	80,687,072.73	114,238,510.84
未分配利润	6.4.7.10	3,668,344.85	-481,938.85
所有者权益合计		84,355,417.58	113,756,571.99
负债和所有者权益总计		85,822,222.80	114,535,418.76

注：1、报告截止日2019年06月30日，基金份额净值1.0455元，基金份额总额80,687,072.73份。其中下属人民币基金份额参考净值人民币1.0455元，份额总额43,382,841.67份；下属美元基金份额参考净值美元0.1521元，份额总额37,304,231.06份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		5,010,920.16	-2,759,038.86
1.利息收入		2,726,531.85	3,589,221.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,224.79	8,684.08
债券利息收入		2,720,307.06	3,580,537.55
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）		604,673.28	-9,079,670.85
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	604,673.28	-9,079,670.85
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,733,021.52	2,514,662.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-85,627.97	151,943.96
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	32,321.48	64,803.57
减：二、费用		667,049.93	1,002,461.12
1. 管理人报酬		436,860.99	629,895.42
2. 托管费		121,350.32	174,970.97
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		8,977.07	12,889.96
7. 其他费用	6.4.7.19	99,861.55	184,704.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,343,870.23	-3,761,499.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,343,870.23	-3,761,499.98

6.3 所有者权益（基金净值）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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	114,238,510.84	-481,938.85	113,756,571.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,343,870.23	4,343,870.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-33,551,438.11	-193,586.53	-33,745,024.64
其中：1.基金申购款	2,770,830.22	94,244.52	2,865,074.74
2.基金赎回款	-36,322,268.33	-287,831.05	-36,610,099.38
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	80,687,072.73	3,668,344.85	84,355,417.58

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	183,718,639.47	-5,990,407.34	177,728,232.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,761,499.98	-3,761,499.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-54,409,174.95	3,400,854.30	-51,008,320.65
其中：1.基金申购款	80,840.21	-5,318.42	75,521.79
2.基金赎回款	-54,490,015.16	3,406,172.72	-51,083,842.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	129,309,464.52	-6,351,053.02	122,958,411.50

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：陶网雄，会计机构负责人：胡正万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第2277号《关于准予海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币139,713,588.15元，美元17,977,789.63元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1495号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）基金合同》于2016年11月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为263,399,284.82份，其中认购资金利息折合42,026.34份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

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

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于2019年8月27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》、各项具体会计准则及相关规定(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（年度报告和半年度报告）》、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2019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2019年6月30日的财务状况以及2019年上半年度的经营成果和基金净值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[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》及其他相关境内外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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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费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 关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间