

海富通稳固收益债券型证券投资基金
2026 年第 1 季度报告
2026 年 3 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年四月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 海富通稳固收益债券 |
| 基金主代码 | 519030 |
| 交易代码 | 519030 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010 年 11 月 23 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,415,095,392.85 份 |
| 投资目标 | 通过合理运用投资组合优化策略，力争实现基金收益随着时间增长的逐步提升。 |
| 投资策略 | 本基金的整体投资策略分为三个层次：第一层次，即资产配置策略，将以优化投资组合保险策略为核心，实现基金投资目标；第二层次，即债券投资策略，将采用自上而下的策略，以久期管理为核心；第三层次，即股票投资策略，包括新股申购策略和积极的精选个股策略。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于中低风险品种。其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |
| 基金管理人 | 海富通基金管理有限公司 |

| | | |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 海富通稳固收益债券 A | 海富通稳固收益债券 C |
| 下属两级基金的交易代码 | 018042 | 519030 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 3,765,491,940.80 份 | 649,603,452.05 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2026 年 1 月 1 日-2026 年 3 月 31 日) | |
|----------------|---|----------------|
| | 海富通稳固收益债券 A | 海富通稳固收益债券 C |
| 1.本期已实现收益 | 45,608,421.06 | 6,359,980.92 |
| 2.本期利润 | -1,475,806.94 | -370,944.61 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0005 | -0.0007 |
| 4.期末基金资产净值 | 5,154,495,021.11 | 878,823,135.12 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.3689 | 1.3529 |

注：（1）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。

（2）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。

（3）海富通稳固收益债券型证券投资基金于2023年3月11日刊登公告，自2023年3月15日起增加A类基金份额，该类别仅开通场外申购赎回业务，收取申购费，不收取销售服务费。原有基金份额全部转换为本基金C类基金份额。

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

1、海富通稳固收益债券 A：

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

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.64% | 0.24% | 0.67% | 0.01% | -0.03% | 0.23% |
| 过去六个月 | 0.82% | 0.21% | 1.36% | 0.01% | -0.54% | 0.20% |
| 过去一年 | 6.36% | 0.22% | 2.75% | 0.01% | 3.61% | 0.21% |
| 过去三年 | 13.19% | 0.27% | 8.49% | 0.01% | 4.70% | 0.26% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.75% | 0.27% | 8.62% | 0.01% | 5.13% | 0.26% |

2、海富通稳固收益债券 C:

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.54% | 0.24% | 0.67% | 0.01% | -0.13% | 0.23% |
| 过去六个月 | 0.62% | 0.21% | 1.36% | 0.01% | -0.74% | 0.20% |
| 过去一年 | 5.94% | 0.22% | 2.75% | 0.01% | 3.19% | 0.21% |
| 过去三年 | 11.84% | 0.27% | 8.49% | 0.01% | 3.35% | 0.26% |
| 过去五年 | 18.91% | 0.26% | 14.54% | 0.01% | 4.37% | 0.25% |
| 自基金合同生效起至今 | 119.49% | 0.45% | 63.25% | 0.01% | 56.24% | 0.44% |

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

海富通稳固收益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的历史走势对比图

1. 海富通稳固收益债券 A

(2023 年 3 月 15 日至 2026 年 3 月 31 日)



2. 海富通稳固收益债券 C

(2010 年 11 月 23 日至 2026 年 3 月 31 日)



注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分（二）投资范围、（五）投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----------------------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 江勇 | 本基金的基金经理；混合资产投资部总经理。 | 2020-10-29 | - | 14 年 | 经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师，资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限公司，现任混合资产投资部总经理。2018 年 7 月至 2023 年 7 月任海富通上证非周期 ETF 联接基金经理。2018 年 7 月至 2022 年 5 月任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通中证 100 指数 (LOF) 基金经理。2018 年 7 月至 2020 年 3 月任海富通中证内地低碳指数（现海富通中证 500 增强）基金经理。2020 年 8 月至 2022 年 5 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理。2020 年 8 月至 2023 年 3 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通稳固收益债券的基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通欣睿混合基金经理。2021 年 6 月至 2024 年 11 月兼任海富通策略收益债券基金经理。2021 年 6 月至 2023 年 10 月兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2021 年 9 月起兼任海富通欣利混合基金经理。2023 年 1 月起兼任海富通强化回报混 |

| | | | | | |
|-----|--------------------|------------|---|------|--|
| | | | | | 合基金经理。2023 年 11 月起兼任海富通添利收益一年持有期债券基金经理。2023 年 12 月起兼任海富通悦享一年持有期混合基金经理。2024 年 3 月至 2025 年 6 月兼任海富通欣盈 6 个月持有期混合基金经理。2024 年 6 月起兼任海富通红利优选混合基金经理。2025 年 7 月起兼任海富通添合收益债券基金经理。 |
| 陈轶平 | 本基金的基金经理；固定收益投资总监。 | 2015-12-18 | - | 17 年 | 博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资总监。2013 年 8 月至 2020 年 7 月任海富通货币基金经理。2014 年 8 月至 2019 年 9 月兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014 年 11 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF（现为海富通上证城投债 ETF）基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 7 月兼任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。2016 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞丰一年定开债券（现为海富通瑞丰债券）基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016 年 11 |

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

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 2023 年 11 月起兼任海富通添利收益一年持有期债券基金经理。2024 年 11 月起兼任海富通纯债债券基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值(元) | 任职时间 |
|----|----------|---------|-------------------|------------|
| 江勇 | 公募基金 | 8 | 14,666,485,730.39 | 2018/07/10 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 12,150,833.95 | 2026/02/06 |
| | 其他组合 | 2 | 3,897,461,443.20 | 2023/08/22 |
| | 合计 | 11 | 18,576,098,007.54 | |

注：表内任职日期为基金经理加入公司以来首次开始管理各类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

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同向交易的样本，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

国内经济方面，2026 年一季度经济实现“开门红”。经济数据方面，生产加快，工业增加值同比回升。投资方面，财政发力，基建和制造业同比增速明显回升；地产投资在筑底阶段。超长假期带动消费增长，消费潜力仍有释放空间。中国产业链优势持续，出口保持韧性。财政政策方面，政府工作报告确定 2026 年赤字率拟按 4% 左右安排，拟发行 1.6 万亿元特别国债，新增 8000 亿政策性金融工具。货币政策保持适度宽松，总量型货币政策保持稳定。

海外经济方面，中东地区地缘冲突对全球经济增长预期形成一定拖累。美以伊冲突背景下，原油价格高位波动，部分能源对外依存度较高的国家经济增长承压。同时，在高油价背景下，全球通胀预期升温，美联储、欧央行、英央行等对货币政策态度转向观望或偏鹰派。

从 A 股市场看，一季度市场先扬后抑。年初市场延续上涨行情，但随着中东冲突持续升温，市场高位回落。整体来看，一季度中小盘表现相对占优，上证指数涨跌幅为 -1.94%，上证 50 为 -6.76%，沪深 300 为 -3.89%，中证 800 为 -2.28%，中证 1000 为 0.32%，中证 2000 为 1.22%。行业板块方面，根据申万一级行业分类，一季度表现靠前的板块是煤炭、石油石化、综合、公用事业、建筑材料，表现靠后的板块是非银金融、商贸零售、美容护理、计算机、房地产。

对应债市而言，一季度债券市场震荡。季初受股债跷跷板和债券供给预期的影响，利率先上行。随后，政府债券供给低于预期，银行、保险等配置意愿增强，债市以上涨为主。春节前在银行等配置盘的驱动下，长端利率下行至关键点位。春节后配置节奏出现边际放缓，交易盘偏谨慎，收益率有所上行。此后，中东冲突爆发，油价大幅上涨，国内通胀预期上升，债市表现偏震荡。全季度来看，10 年期国债到期收益率累计下行约 3bp。

信用债方面，短久期信用债表现更好。公募基金费率新规落地，二永债等交易性资产的需求有所提振，率先迎来修复行情，普信债的行情随后跟进，信用债各评级、各期限收益率多数下行，积极情绪向中长久期蔓延；春节后，信用债收益率曲线持续走陡。综合来看，3 年期以内信用债因资金偏松、存在一定套息空间等原因表现更好。可转债方面，一季度经历了从春季躁动到地缘冲击的剧烈变化。在资金面推动下，中证转债指数 1 月大幅上涨，但 3 月基本回吐全部涨幅。经过调整，转债估值压力有所释放，但绝对水平仍处高区间。

报告期间，本基金股票仓位相对保持稳定，权益配置上延续价值风格，行业分布上较为均衡，持仓个股较为分散。从一季度贡献来看，医药、通信、化工、有色对组合提供了较多正贡献，电子、非银金融、交通运输对组合有较多拖累；从行业配置上看，医药、银行、电力设备配置有所增加，有色、家电、非银金融配置有所下降。债券方面，本基金维持了中高等级信用债配置底仓。根据对债券市场和资金面环境变化的判断，组合整体维持相对偏短久期，并使用利率债动态调整，参与市场波段机会。同时，基于权

益和可转债相对性价比情况分析，分散投资可转债个券，并继续维持相对较低的可转债投资比例，目标在控制波动的前提下获取权益上涨收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通稳固收益债券 A 净值增长率为 0.64%，同期业绩比较基准收益率为 0.67%。海富通稳固收益债券 C 净值增长率为 0.54%，同期业绩比较基准收益率为 0.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,035,457,216.66 | 16.24 |
| | 其中：股票 | 1,035,457,216.66 | 16.24 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 5,265,092,629.07 | 82.56 |
| | 其中：债券 | 5,265,092,629.07 | 82.56 |
| | 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 | 75,290,946.10 | 1.18 |
| 8 | 其他资产 | 1,070,685.95 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 6,376,911,477.78 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|---------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |

| | | | |
|---|------------------|------------------|-------|
| B | 采矿业 | 21,826,140.35 | 0.36 |
| C | 制造业 | 658,542,821.34 | 10.92 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 19,080,447.00 | 0.32 |
| E | 建筑业 | 3,457,368.00 | 0.06 |
| F | 批发和零售业 | 26,448,512.00 | 0.44 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 42,878,916.00 | 0.71 |
| H | 住宿和餐饮业 | 2,480,688.00 | 0.04 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 38,626,451.45 | 0.64 |
| J | 金融业 | 165,589,701.68 | 2.74 |
| K | 房地产业 | 20,928,601.04 | 0.35 |
| L | 租赁和商务服务业 | 21,661,614.80 | 0.36 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 11,863,588.00 | 0.20 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,072,367.00 | 0.03 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,035,457,216.66 | 17.16 |

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 600919 | 江苏银行 | 2,433,200 | 26,570,544.00 | 0.44 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 52,400 | 21,049,080.00 | 0.35 |
| 3 | 000776 | 广发证券 | 935,018 | 16,792,923.28 | 0.28 |
| 4 | 601601 | 中国太保 | 449,400 | 16,668,246.00 | 0.28 |
| 5 | 300274 | 阳光电源 | 99,200 | 14,955,392.00 | 0.25 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 244,500 | 13,882,710.00 | 0.23 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 7 | 002142 | 宁波银行 | 446,900 | 13,608,105.00 | 0.23 |
| 8 | 000157 | 中联重科 | 1,418,000 | 12,194,800.00 | 0.20 |
| 9 | 601009 | 南京银行 | 1,054,600 | 12,011,894.00 | 0.20 |
| 10 | 002352 | 顺丰控股 | 315,300 | 11,994,012.00 | 0.20 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 798,195,537.91 | 13.23 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 2,253,031,620.98 | 37.34 |
| | 其中：政策性金融债 | 431,623,007.81 | 7.15 |
| 4 | 企业债券 | 638,250,112.91 | 10.58 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 1,519,600,872.32 | 25.19 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 56,014,484.95 | 0.93 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 5,265,092,629.07 | 87.27 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 244588 | 26 浦创 K1 | 1,900,000 | 190,256,578.09 | 3.15 |
| 2 | 019792 | 25 国债 19 | 1,886,000 | 190,024,265.86 | 3.15 |
| 3 | 244611 | 26 银河 G2 | 1,700,000 | 170,958,054.79 | 2.83 |
| 4 | 019773 | 25 国债 08 | 1,632,000 | 165,366,401.75 | 2.74 |
| 5 | 244512 | 26 中证 G2 | 1,600,000 | 161,144,837.26 | 2.67 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金暂未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京市燃气集团有限责任公司在本报告编制日前一年内曾受到国家税务总局北京市西城区税务局第一税务所的处罚。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 457,399.26 |

| | | |
|---|---------|--------------|
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 613,286.69 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,070,685.95 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|---------|--------------|---------------|
| 1 | 113647 | 禾丰转债 | 2,412,694.05 | 0.04 |
| 2 | 118005 | 天奈转债 | 1,946,762.02 | 0.03 |
| 3 | 127085 | 韵达转债 | 1,161,994.27 | 0.02 |
| 4 | 127067 | 恒逸转 2 | 1,031,881.25 | 0.02 |
| 5 | 127070 | 大中转债 | 932,792.16 | 0.02 |
| 6 | 113679 | 芯能转债 | 911,148.77 | 0.02 |
| 7 | 127068 | 顺博转债 | 898,056.53 | 0.01 |
| 8 | 127083 | 山路转债 | 886,606.99 | 0.01 |
| 9 | 127040 | 国泰转债 | 866,458.75 | 0.01 |
| 10 | 127030 | 盛虹转债 | 850,591.88 | 0.01 |
| 11 | 110084 | 贵燃转债 | 849,624.60 | 0.01 |
| 12 | 127059 | 永东转 2 | 844,716.71 | 0.01 |
| 13 | 113049 | 长汽转债 | 837,551.28 | 0.01 |
| 14 | 113052 | 兴业转债 | 831,907.38 | 0.01 |
| 15 | 123064 | 万孚转债 | 818,667.59 | 0.01 |
| 16 | 123122 | 富瀚转债 | 796,271.37 | 0.01 |
| 17 | 113656 | 嘉诚转债 | 784,792.67 | 0.01 |
| 18 | 113691 | 和邦转债 | 669,787.84 | 0.01 |
| 19 | 113648 | 巨星转债 | 595,697.30 | 0.01 |
| 20 | 127098 | 欧晶转债 | 521,867.08 | 0.01 |
| 21 | 113048 | 晶科转债 | 506,515.77 | 0.01 |
| 22 | 113660 | 寿 22 转债 | 477,247.25 | 0.01 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 23 | 113056 | 重银转债 | 466,768.68 | 0.01 |
| 24 | 123107 | 温氏转债 | 461,261.63 | 0.01 |
| 25 | 113042 | 上银转债 | 443,898.58 | 0.01 |
| 26 | 123247 | 万凯转债 | 421,523.78 | 0.01 |
| 27 | 123243 | 严牌转债 | 412,804.47 | 0.01 |
| 28 | 113677 | 华懋转债 | 409,726.49 | 0.01 |
| 29 | 127025 | 冀东转债 | 381,159.62 | 0.01 |
| 30 | 110076 | 华海转债 | 374,829.11 | 0.01 |
| 31 | 127092 | 运机转债 | 352,895.48 | 0.01 |
| 32 | 113646 | 永吉转债 | 345,450.48 | 0.01 |
| 33 | 128137 | 洁美转债 | 345,369.48 | 0.01 |
| 34 | 127103 | 东南转债 | 343,122.54 | 0.01 |
| 35 | 123213 | 天源转债 | 326,491.62 | 0.01 |
| 36 | 127037 | 银轮转债 | 324,384.27 | 0.01 |
| 37 | 123180 | 浙矿转债 | 318,223.04 | 0.01 |
| 38 | 113051 | 节能转债 | 317,864.22 | 0.01 |
| 39 | 111013 | 新港转债 | 315,230.64 | 0.01 |
| 40 | 118033 | 华特转债 | 315,081.37 | 0.01 |
| 41 | 127090 | 兴瑞转债 | 315,000.25 | 0.01 |
| 42 | 127056 | 中特转债 | 313,256.85 | 0.01 |
| 43 | 127078 | 优彩转债 | 313,031.85 | 0.01 |
| 44 | 110087 | 天业转债 | 309,598.67 | 0.01 |
| 45 | 127064 | 杭氧转债 | 308,188.16 | 0.01 |
| 46 | 123216 | 科顺转债 | 307,576.38 | 0.01 |
| 47 | 118022 | 锂科转债 | 306,095.93 | 0.01 |
| 48 | 111002 | 特纸转债 | 303,836.64 | 0.01 |
| 49 | 113054 | 绿动转债 | 300,739.40 | 0.00 |
| 50 | 113058 | 友发转债 | 299,307.61 | 0.00 |
| 51 | 118038 | 金宏转债 | 298,715.55 | 0.00 |
| 52 | 127046 | 百润转债 | 298,416.91 | 0.00 |
| 53 | 127082 | 亚科转债 | 298,123.93 | 0.00 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 54 | 123091 | 长海转债 | 297,590.04 | 0.00 |
| 55 | 118034 | 晶能转债 | 296,813.83 | 0.00 |
| 56 | 111001 | 山玻转债 | 296,587.80 | 0.00 |
| 57 | 113067 | 燃 23 转债 | 296,205.86 | 0.00 |
| 58 | 113638 | 台 21 转债 | 295,928.22 | 0.00 |
| 59 | 113659 | 莱克转债 | 295,746.92 | 0.00 |
| 60 | 113059 | 福莱转债 | 294,995.35 | 0.00 |
| 61 | 123214 | 东宝转债 | 293,908.72 | 0.00 |
| 62 | 128134 | 鸿路转债 | 293,650.92 | 0.00 |
| 63 | 118041 | 星球转债 | 293,614.31 | 0.00 |
| 64 | 123121 | 帝尔转债 | 293,175.91 | 0.00 |
| 65 | 111000 | 起帆转债 | 292,588.49 | 0.00 |
| 66 | 127062 | 垒知转债 | 292,475.67 | 0.00 |
| 67 | 113053 | 隆 22 转债 | 292,436.08 | 0.00 |
| 68 | 123150 | 九强转债 | 289,327.22 | 0.00 |
| 69 | 113643 | 风语转债 | 289,319.93 | 0.00 |
| 70 | 113627 | 太平转债 | 288,843.78 | 0.00 |
| 71 | 127054 | 双箭转债 | 288,166.72 | 0.00 |
| 72 | 118032 | 建龙转债 | 287,938.85 | 0.00 |
| 73 | 127060 | 湘佳转债 | 287,188.75 | 0.00 |
| 74 | 123192 | 科思转债 | 287,163.40 | 0.00 |
| 75 | 118025 | 奕瑞转债 | 287,032.61 | 0.00 |
| 76 | 113674 | 华设转债 | 286,563.43 | 0.00 |
| 77 | 127095 | 广泰转债 | 286,270.56 | 0.00 |
| 78 | 113655 | 欧 22 转债 | 286,169.23 | 0.00 |
| 79 | 113654 | 永 02 转债 | 285,119.82 | 0.00 |
| 80 | 113649 | 丰山转债 | 284,486.10 | 0.00 |
| 81 | 111005 | 富春转债 | 284,225.93 | 0.00 |
| 82 | 127050 | 麒麟转债 | 283,871.48 | 0.00 |
| 83 | 127069 | 小熊转债 | 283,364.22 | 0.00 |
| 84 | 123085 | 万顺转 2 | 282,960.92 | 0.00 |

| | | | | |
|-----|--------|---------|------------|------|
| 85 | 127102 | 浙建转债 | 282,337.06 | 0.00 |
| 86 | 128142 | 新乳转债 | 282,063.00 | 0.00 |
| 87 | 127027 | 能化转债 | 282,025.06 | 0.00 |
| 88 | 123236 | 家联转债 | 281,710.72 | 0.00 |
| 89 | 123088 | 威唐转债 | 280,972.98 | 0.00 |
| 90 | 123225 | 翔丰转债 | 280,859.89 | 0.00 |
| 91 | 113633 | 科沃转债 | 280,334.59 | 0.00 |
| 92 | 123112 | 万讯转债 | 280,302.10 | 0.00 |
| 93 | 113062 | 常银转债 | 280,242.42 | 0.00 |
| 94 | 118003 | 华兴转债 | 280,182.57 | 0.00 |
| 95 | 113605 | 大参转债 | 279,564.89 | 0.00 |
| 96 | 110085 | 通 22 转债 | 279,247.66 | 0.00 |
| 97 | 111003 | 聚合转债 | 278,979.59 | 0.00 |
| 98 | 113667 | 春 23 转债 | 278,961.14 | 0.00 |
| 99 | 123193 | 海能转债 | 278,874.84 | 0.00 |
| 100 | 128141 | 旺能转债 | 278,741.02 | 0.00 |
| 101 | 113658 | 密卫转债 | 278,120.38 | 0.00 |
| 102 | 123092 | 天壕转债 | 278,014.78 | 0.00 |
| 103 | 118036 | 力合转债 | 276,393.51 | 0.00 |
| 104 | 123194 | 百洋转债 | 275,527.85 | 0.00 |
| 105 | 123215 | 铭利转债 | 274,044.00 | 0.00 |
| 106 | 113037 | 紫银转债 | 273,727.05 | 0.00 |
| 107 | 113632 | 鹤 21 转债 | 273,507.18 | 0.00 |
| 108 | 128124 | 科华转债 | 272,333.37 | 0.00 |
| 109 | 113634 | 珀莱转债 | 272,116.27 | 0.00 |
| 110 | 128129 | 青农转债 | 270,938.46 | 0.00 |
| 111 | 127041 | 弘亚转债 | 270,165.76 | 0.00 |
| 112 | 110093 | 神马转债 | 269,535.79 | 0.00 |
| 113 | 111018 | 华康转债 | 269,484.97 | 0.00 |
| 114 | 113597 | 佳力转债 | 266,565.98 | 0.00 |
| 115 | 123119 | 康泰转 2 | 263,719.94 | 0.00 |

| | | | | |
|-----|--------|---------|------------|------|
| 116 | 127049 | 希望转 2 | 263,330.82 | 0.00 |
| 117 | 110075 | 南航转债 | 263,288.16 | 0.00 |
| 118 | 127045 | 牧原转债 | 263,270.15 | 0.00 |
| 119 | 113584 | 家悦转债 | 263,246.71 | 0.00 |
| 120 | 127026 | 超声转债 | 262,682.43 | 0.00 |
| 121 | 110090 | 爱迪转债 | 256,036.44 | 0.00 |
| 122 | 110073 | 国投转债 | 251,850.14 | 0.00 |
| 123 | 113616 | 韦尔转债 | 250,628.52 | 0.00 |
| 124 | 113588 | 润达转债 | 222,183.99 | 0.00 |
| 125 | 127053 | 豪美转债 | 221,005.26 | 0.00 |
| 126 | 127088 | 赫达转债 | 220,500.52 | 0.00 |
| 127 | 113673 | 岱美转债 | 208,902.10 | 0.00 |
| 128 | 118031 | 天 23 转债 | 207,385.41 | 0.00 |
| 129 | 118042 | 奥维转债 | 203,306.86 | 0.00 |
| 130 | 127089 | 晶澳转债 | 201,311.14 | 0.00 |
| 131 | 113681 | 镇洋转债 | 191,010.03 | 0.00 |
| 132 | 123172 | 漱玉转债 | 188,161.95 | 0.00 |
| 133 | 110086 | 精工转债 | 188,026.44 | 0.00 |
| 134 | 113640 | 苏利转债 | 186,141.88 | 0.00 |
| 135 | 111009 | 盛泰转债 | 185,030.44 | 0.00 |
| 136 | 123183 | 海顺转债 | 184,544.07 | 0.00 |
| 137 | 123149 | 通裕转债 | 182,008.05 | 0.00 |
| 138 | 113644 | 艾迪转债 | 180,878.52 | 0.00 |
| 139 | 123165 | 回天转债 | 178,981.74 | 0.00 |
| 140 | 123151 | 康医转债 | 178,511.68 | 0.00 |
| 141 | 123235 | 亿田转债 | 177,411.37 | 0.00 |
| 142 | 123154 | 火星转债 | 176,005.08 | 0.00 |
| 143 | 123071 | 天能转债 | 173,928.58 | 0.00 |
| 144 | 118010 | 洁特转债 | 172,956.97 | 0.00 |
| 145 | 111014 | 李子转债 | 172,449.87 | 0.00 |
| 146 | 118024 | 冠宇转债 | 171,530.36 | 0.00 |

| | | | | |
|-----|--------|---------|------------|------|
| 147 | 128136 | 立讯转债 | 171,224.41 | 0.00 |
| 148 | 113636 | 甬金转债 | 170,574.95 | 0.00 |
| 149 | 123113 | 仙乐转债 | 168,676.16 | 0.00 |
| 150 | 113666 | 爱玛转债 | 158,808.84 | 0.00 |
| 151 | 111004 | 明新转债 | 128,160.50 | 0.00 |
| 152 | 123109 | 昌红转债 | 81,280.00 | 0.00 |
| 153 | 113670 | 金 23 转债 | 44,321.38 | 0.00 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 海富通稳固收益债券 A | 海富通稳固收益债券 C |
|---------------|------------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,296,463,808.15 | 380,814,659.44 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,249,661,584.54 | 407,989,021.26 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 780,633,451.89 | 139,200,228.65 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 3,765,491,940.80 | 649,603,452.05 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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 136 只公募基金。截至 2026 年 3 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 2833 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人。2008 年 3 月，海富通获批从事特定客户资产管理业务。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保险监督管理委员会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通稳固收益债券型证券投资基金的文件
- (二)海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同
- (三)海富通稳固收益债券型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通稳固收益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他文件

9.2 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

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇二六年四月二十二日