富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 6
2.5 信息披露方式 6
2.6 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 8

4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12

§5 托管人报告 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
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 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13

6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 18

§7 投资组合报告 37

7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 37

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 37
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 39
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 39
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 39
7.11 投资组合报告附注 40

§8 基金份额持有人信息 40

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 40
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情况 41

§9 开放式基金份额变动 41

§10 重大事件揭示 41

10.1 基金份额持有人大会决议 41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 41
10.4 基金投资策略的改变 41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 41
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 42
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 42
10.8 其他重大事件 44

§11 影响投资者决策的其他重要信息 46

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 46

§12 备查文件目录 46

12.1 备查文件目录 46
12.2 存放地点 46
12.3 查阅方式 46

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）
基金简称	国富美元债一年持有期债券（QDII）
基金主代码	003972
前端交易代码	003972
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 1 月 25 日
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,757,870,859.52 份
基金合同存续期	不定期

注：根据国海富兰克林基金管理有限公司 2024 年 5 月 25 日发布的《国海富兰克林基金管理有限公司关于富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金于 2024 年 7 月 1 日由富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金变更为富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下，力争总回报最大化，以谋求长期保值增值。
投资策略	（一）封闭期投资策略 1、资产配置策略 本基金通过研究全球市场经济运行趋势，深入分析不同国家和地区财政及货币政策对经济运行的影响，结合对中长期利率走势、通货膨胀及各类债券的收益率、波动性的预期，自上而下地决定债券组合久期，对投资组合类属资产的比例进行最优化配置和动态调整。 2、债券投资策略：包括久期策略、信用债券投资策略、收益率曲线策略、券种配置策略和衍生工具投资。 （二）开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，并可能适度提高现金比例，减小基金净值的波动。
业绩比较基准	95%×巴克莱资本美国综合债券指数收益率＋5%×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，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于较低风险收益特征的证券投资基金。

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	国海富兰克林基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	储丽莉	王小飞
	联系电话	021-3855 5555	021-60637103
	电子邮箱	service@ftsfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680 和 021－38789555	021-60637228
传真		021-6888 3050	021-60635778
注册地址		南宁高新区中国-东盟企业总部基地三期综合楼 A 座 17 层 1707 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 9 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		刘峻	张金良

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	JP Morgan Chase Bank, National Association
	中文	-	摩根大通银行
注册地址		-	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.
办公地址		-	383 Madison Avenue, New York, NY 10179-0001, U.S.A.
邮政编码		-	10179-0001

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国海富兰克林基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 9 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-127,234.22
本期利润	-48,816,983.81
加权平均基金份额本期利润	-0.0262
本期加权平均净值利润率	-2.69%

本期基金份额净值增长率	-2.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-102,843,595.13
期末可供分配基金份额利润	-0.0585
期末基金资产净值	1,696,567,523.70
期末基金份额净值	0.9651
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	3.22%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则－第 1 号《主要财务指标的计算及披露》。

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、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）。

4、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

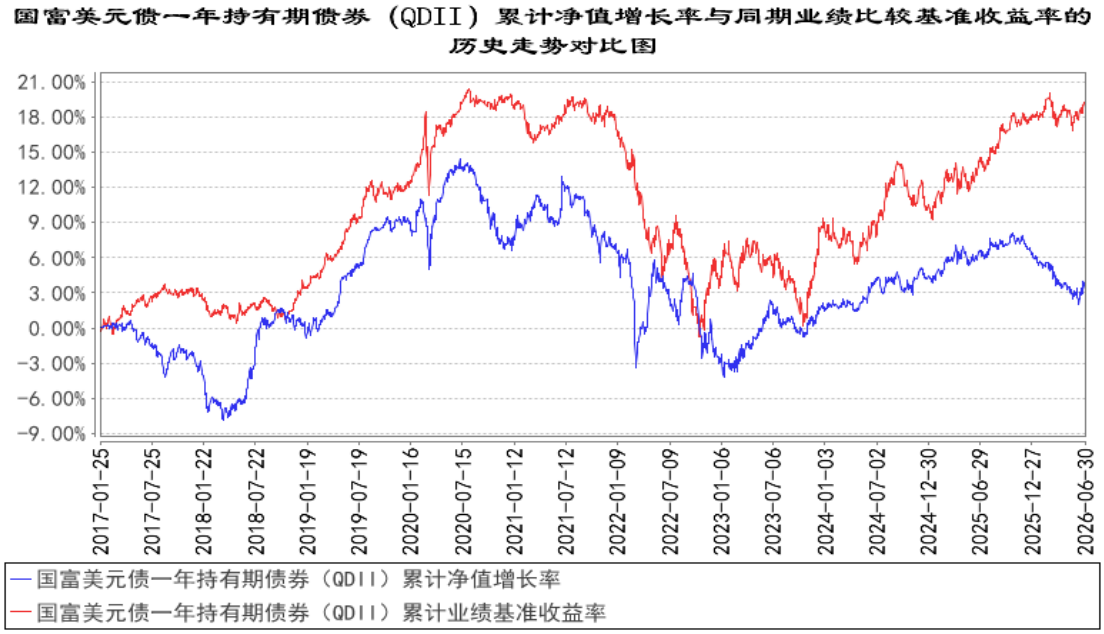
5、上述“期末基金份额净值”为人民币份额的基金份额净值，报告期末美元份额的基金份额净值为 0.1423 美元。

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
过去三个月	-0.76%	0.27%	0.64%	0.24%	-1.40%	0.03%
过去六个月	-2.64%	0.26%	0.60%	0.24%	-3.24%	0.02%
过去一年	-3.21%	0.22%	3.62%	0.22%	-6.83%	0.00%
过去三年	0.92%	0.21%	12.39%	0.32%	-11.47%	-0.11%
过去五年	-8.04%	0.31%	0.52%	0.36%	-8.56%	-0.05%
过去七年	-1.68%	0.31%	8.55%	0.33%	-10.23%	-0.02%
自基金合同生效起至今	3.22%	0.29%	18.73%	0.30%	-15.51%	-0.01%

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



注：1. 本基金的基金合同生效日为 2017 年 1 月 25 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

2. 上述对比图展示的是人民币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。

§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

国海富兰克林基金管理有限公司成立于 2004 年 11 月，由国海证券股份有限公司和富兰克林邓普顿全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建，国海证券股份有限公司持有 51%的股份，邓普顿国际股份有限公司持有 49%的股份。目前公司注册资本 2.2 亿元人民币。

国海证券股份有限公司是国内 A 股市场第 16 家上市券商，是拥有全业务牌照，营业网点遍布中国主要城市的全国性综合类证券公司。富兰克林邓普顿是世界知名基金管理公司，在全球市场具备超过 75 年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系，借助国海证券股份有限公司的综合业务优势，力争成为国内一流的基金管理公司。

国海富兰克林基金管理有限公司具有丰富的基金管理经验，截至 2026 年 6 月末，公司旗下合计管理 50 只公募基金产品。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐成	公司 QDII 投资总监，国富亚洲机会股票(QDII)基金、国富大中华精选混合(QDII)基金、国富美元债一年持有期债券(QDII)基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金、国富全球科技互联混合(QDII)基金及国富港股通远见价值混合基金的基金经理	2017 年 1 月 25 日	-	20 年	徐成先生，CFA，朴茨茅斯大学（英国）金融决策分析硕士。历任永丰金证券（亚洲）有限公司上海办事处研究员，新加坡东京海上国际资产管理有限公司上海办事处研究员、高级研究员、首席代表，国海富兰克林基金管理有限公司 QDII 投资副总监。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司 QDII 投资总监，国富亚洲机会股票(QDII)基金、国富大中华精选混合(QDII)基金、国富美元债一年持有期债券(QDII)基金、国富沪港深成长精选股票基金、国富估值优势混合基金、国富全球科技互联混合(QDII)基金及国富港股通远见价值混合基金的基金经理。
马秋思	国富美元债一年持有期债券(QDII)基金的基金经理兼研究员。2024 年 4 月 30 日起兼任投资	2021 年 11 月 27 日	-	10 年	马秋思女士，悉尼大学金融学硕士。历任易唯思商务咨询有限公司商业分析师。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富美元债一年持有期债券(QDII)基金的基金经理兼研究员。2024 年 4 月 30 日起兼任投资经理。

	经理				

注：1. 表中“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，其中，首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。

2. 表中“证券从业年限”的计算标准为该员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
马秋思	公募基金	1	1,696,567,523.70	2021 年 11 月 27 日
	私募资产管理计划	3	755,739,813.72	2024 年 4 月 30 日
	其他组合	0	-	-
	合计	4	2,452,307,337.42	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

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

报告期内公司严格执行《公平交易管理制度》，明确了公平交易的原则和目标，制订了实现公平交易的具体措施，并在技术上按照公平交易原则实现了严格的交易公平分配。

因本基金的基金经理兼任私募资产管理计划投资经理，本基金管理人依据相关法律法规加强了对本基金公平交易执行情况的监控，报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。

报告期内公司不存在投资组合之间发生交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，前端利率预期出现大幅反转：市场从年初预计“年内降息 50 个基点”急转为当前预期的“加息 37 个基点”。美元走势大起大落，3 月市场普遍看空，如今已整体转为看涨。大宗商品方面，霍尔木兹海峡虽被封锁近四个月，但油价此前的涨幅几乎全部回吐。美股以积极走势为二季度画上句号，标普 500 等主要指数创下六年来最佳季度表现，芯片股延续涨势，费城半导体指数录得史上最优单季涨幅。与此同时，新一批经济数据显示，美国经济增长动能正在增强，这使得投资者对企业盈利前景的信心进一步增强（数据来源彭博，截止 06 月 30 日）。

上半年，美国经济最亮眼的支撑因素是 AI 所带来的企业投资热潮。例如 IT 投资占 GDP 的比重已从 2024 年底的 1.7%升至今年一季度的 2.4%。美国一季度 GDP 终值环比增长 2.1%，高于预期的 1.6%。上半年，10 年期美债收益率的上行 30 个基点，其中实际利率贡献 25 个基点，通胀补偿几乎未变（数据来源彭博，截止 06 月 30 日）。

货币政策方面，6 月 FOMC 会议基调偏鹰派，核心信号是沃什上任后美联储沟通框架转向“少指引、重通胀、重制度改革”。点阵图清晰反映出 FOMC 委员们的风险平衡重心发生转移：政策关注点从就业市场彻底转向通胀问题。本次会议的经济预测摘要（SEP）将 2026 年 GDP 增速小幅下调至 2.2%，失业率预期为 4.3%，核心个人消费支出价格指数（PCE）上调至 3.3%。财政方面，美国财政部的数据显示，2026 年财年前 9 个月赤字规模 1.25 万亿美元，较去年同期下降 1180 亿美元，财政收入增长 5%，财政支出增长 1.3%

上半年美国国债指数（US Treasury Index）小幅上涨 0.279%，美债收益率曲线熊平；2 年期美债收益率上行 70bp 至 4.18%，5 年期美债收益率上行 50bp 至 4.23%，10 年期美债收益率上行 30bp 至 4.47%。中资美元债指数上涨 1.32%，其中投资级和高收益指数分别上涨 1.35%和 1.64%。恒生科技指数下跌 18.92%，而费城半导体指数上涨 101.14%。在岸人民币兑美元升值 2.97%至 6.7845（数据来源彭博，截止 06 月 30 日）。

今年我们增加了可转债的配置，主要集中在中资离岸品种。鉴于上半年港股市场表现低于预期。部分可转债的价格已接近债底，我们认为下行空间有限不大，将择机增配此类标的。2 月，由于中国新年，操作不多，随着美债收益率的下行，月底适当减持了部分长久期美债。3 月底，我们加仓中短端美债，我们认为市场对年内加息的定价过于太鹰派，而中短端美债在这次的调整中上行幅度超过超长端；随着美债收益率的上行，加仓更多集中在中短端美债。4 月，我们增持了投资级中短端的韩国头部存储公司信用债和中国台湾头部半导体代工厂信用债，相对同信用评级中资美元债，可获得 10-15 个基点的信用利差增厚。5-6 月，随着美债收益率的攀升,我们小幅

拉长了组合久期。整体债券仓位的配置思路为：短端以高资质的中资、港资和韩国信用债为主，即使美债上行亦有信用利差保护，中长端则以美债为主，并通过波段交易持续挖掘高景气行业信用债利差收窄的机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为短期内美联储实施加息的操作难度较大，虽然市场对“预防式加息”的预期概率有所上升，但考虑到就业市场后续或有降温，而油价回落、关税影响逐步消退、住房和工资增速维持低位均有助于压低通胀等因素，基准情形仍然是 2026 年下半年维持利率不变。

从美国 3-5 月通胀数据来看，通胀上行压力主要集中在能源端，核心服务和商品价格表现较为温和。同时工资增速并未跟随通胀大幅上行，尚未观察到“工资-通胀”循环的明显迹象。

上月美债利率确已触及 4.5%，并一度摸高至 4.7%（数据来源：彭博）。我们认为，只要不出现通胀明显抬头、沃什政策立场过度鸽派、或 AI 对生产率的显著提升引发市场系统性上修美国中性利率，那么即便明年加息 2 次，10 年期美债利率仍大概率在 4.5%中枢震荡运行。

本基金将继续按照基金合同及相关法律法规要求，努力做好基金投资工作，争取未来更好的长期投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会（简称“估值委员会”），并已制订了《投资产品估值管理办法》。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由总经理或其任命者负责，成员包括投研、风险控制、监察稽核、交易、基金核算方面的部门主管，相关人员均具有丰富的证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未分配的利润。

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

无。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§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：富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	124,464,724.68	17,798,405.61
结算备付金		100,000.00	351,797.62
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,582,297,479.71	2,202,255,548.82
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,582,297,479.71	2,202,255,548.82
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	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		4,455,899.76	-
应收股利		15,971.32	-
应收申购款		175,910.55	480,811.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,711,509,986.02	2,220,886,563.83
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		13,389,348.74	12,032,607.14
应付管理人报酬		1,001,999.55	1,330,562.24
应付托管费		286,285.59	380,160.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		170,608.89	212,254.90
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	94,219.55	190,000.00
负债合计		14,942,462.32	14,145,584.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,757,870,859.52	2,226,148,807.58
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-61,303,335.82	-19,407,828.67
净资产合计		1,696,567,523.70	2,206,740,978.91
负债和净资产总计		1,711,509,986.02	2,220,886,563.83

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,757,870,859.52 份。其中国富美元债一年持有期债券（QDII）人民币份额 1,726,046,969.82 份，份额净值人民币 0.9651 元；国富美元债一年持有期债券（QDII）美元现汇份额 31,823,889.70 份，份额净值美元 0.1423 元。

6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-40,488,812.93	42,181,650.35
1.利息收入		150,353.49	329,494.59
其中：存款利息收入	6.4.7.13	150,353.49	276,172.78
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	53,321.81
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,778,769.67	28,377,138.92
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,363,064.94	-
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	6,386,732.40	28,377,138.92
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	28,972.33	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-48,689,749.59	14,041,396.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,744,897.78	-574,696.77
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	16,711.28	8,316.76
减：二、营业总支出		8,328,170.88	7,209,081.15
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	6,313,075.47	5,463,964.55
2．托管费	6.4.10.2.2	1,803,735.87	1,561,132.71
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7．税金及附加		104,599.03	77,382.68
8．其他费用	6.4.7.24	106,760.51	106,601.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-48,816,983.81	34,972,569.20
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-48,816,983.81	34,972,569.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-48,816,983.81	34,972,569.20

6.3 净资产变动表

会计主体：富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,226,148,807.58	-	-19,407,828.67	2,206,740,978.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,226,148,807.58	-	-19,407,828.67	2,206,740,978.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-468,277,948.06	-	-41,895,507.15	-510,173,455.21
（一）、综合收益总额	-	-	-48,816,983.81	-48,816,983.81
（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）	-468,277,948.06	-	6,921,476.66	-461,356,471.40
其中：1.基金申购款	269,504,815.65	-	-7,309,026.10	262,195,789.55
2.基金赎回款	-737,782,763.71	-	14,230,502.76	-723,552,260.95
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,757,870,859.52	-	-61,303,335.82	1,696,567,523.70
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,540,017,743.09	-	-37,153,364.65	1,502,864,378.44
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,540,017,743.09	-	-37,153,364.65	1,502,864,378.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	289,050,922.47	-	31,861,693.59	320,912,616.06
（一）、综合收益总额	-	-	34,972,569.20	34,972,569.20
（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）	289,050,922.47	-	-3,110,875.61	285,940,046.86
其中：1.基金申购款	291,759,594.25	-	-3,141,000.11	288,618,594.14
2.基金赎回款	-2,708,671.78	-	30,124.50	-2,678,547.28
（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）、其他综合收益结转留存收	-	-	-	-

益				
四、本期期末净资产	1,829,068,665.56	-	-5,291,671.06	1,823,776,994.50

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：

徐荔蓉	于意	肖燕
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）(以下简称“本基金”)是由富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原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 2737 号《关于准予富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金注册的批复》注册，由国海富兰克林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《富兰克林国海美元债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 684,614,710.34 元，业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(2017)第 045 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 684,878,198.01 份基金份额，其中认购资金利息折合 263,487.67 份基金份额。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外托管人为摩根大通银行。

根据基金管理人于 2024 年 5 月 25 日发布的《国海富兰克林基金管理有限公司关于富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》和于 2024 年 7 月 1 日生效的《富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金(QDII)基金合同》，本基金对每份基金份额设置一年的最短持有期，在最短持有期限内，基金份额不能赎回；每份基金份额在其最短持有期限到期后的下一个工作日(含)起，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。对于每份基金份额，最短持有期限为基金份额申购确认日(对申购份额而言)起至基金份额申购确认日的一年对日(如不存在该对日或该对日为非工作日的，则延后至下一工作日)的前一日的期间。对于持有原富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金基金份额，转型后变

更为持有富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）基金份额的，其持有期自原基金份额确认之日起连续计算(对于转型前分红所得的基金份额以该分红的红利发放日作为起始日计算持有期)。

根据《富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）基金合同》和《富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）招募说明书》的规定，本基金根据认购、申购、赎回所使用货币的不同，将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额类别，称为人民币份额；以美元计价并进行认购、申购、赎回的份额类别，称为美元份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括政府债券、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；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；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；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、互换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以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于美元债券的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：95%×巴克莱资本美国综合债券指数收益率＋5%×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国海富兰克林基金管理有限公司于 2026 年 8 月 31 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息

披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3%的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的

规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加；

基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	124,464,724.68
等于：本金	124,459,385.59
加：应计利息	5,339.09
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
减：坏账准备	-
合计	124,464,724.68

注：于 2026 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 16,896,464.50 元，含应计利息 4,832.22 元，美元活期存款 15,855,001.87 元（折合人民币 107,568,260.18 元），含应计利息 74.71 元（折合人民币 506.87 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	境外债券市场	1,636,756,227.50	13,551,121.73	1,582,297,479.71	-68,009,869.52
	合计	1,636,756,227.50	13,551,121.73	1,582,297,479.71	-68,009,869.52
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,636,756,227.50	13,551,121.73	1,582,297,479.71	-68,009,869.52

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
合计	94,219.55

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,226,148,807.58	2,226,148,807.58
本期申购	269,504,815.65	269,504,815.65
本期赎回（以“-”号填列）	-737,782,763.71	-737,782,763.71
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	1,757,870,859.52	1,757,870,859.52

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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	-130,378,364.38	110,970,535.71	-19,407,828.67
本期期初	-130,378,364.38	110,970,535.71	-19,407,828.67
本期利润	-127,234.22	-48,689,749.59	-48,816,983.81
本期基金份额交易产生的变动数	27,662,003.47	-20,740,526.81	6,921,476.66
其中：基金申购款	-16,519,069.76	9,210,043.66	-7,309,026.10
基金赎回款	44,181,073.23	-29,950,570.47	14,230,502.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-102,843,595.13	41,540,259.31	-61,303,335.82

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	150,258.34
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	95.14
其他	0.01
合计	150,353.49

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,363,064.94
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-

合计	3,363,064.94

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	77,276,838.07
减：卖出股票成本总额	73,895,990.21
减：交易费用	17,782.92
买卖股票差价收入	3,363,064.94

6.4.7.15 基金投资收益

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	29,271,475.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-22,884,742.97
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	6,386,732.40

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,542,331,961.99
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,550,222,695.51
减：应计利息总额	14,994,009.45
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-22,884,742.97

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	28,972.33
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	28,972.33

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-48,689,749.59
股票投资	-
债券投资	-48,689,749.59
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-48,689,749.59

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
其他	16,711.28
合计	16,711.28

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	12,420.50
其他手续费	120.46
合计	106,760.51

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

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
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
摩根大通银行(“JP Morgan Chase Bank, National Association”)	境外资产托管人
国海证券股份有限公司(“国海证券”)	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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,313,075.47	5,463,964.55
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,026,470.21	1,675,728.31
应支付基金管理人的净管理费	5,286,605.26	3,788,236.24

注：支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.70%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,803,735.87	1,561,132.71

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

1.基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

2.本报告期和上年度可比期间(2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日)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

1.本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

2.本报告期末和上年度末（2025 年 12 月 31 日）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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
摩根大通银行	72,404,979.00	78,614.73	198,238.03	256,976.92
中国建设银行	52,059,745.68	71,643.61	10,707,939.04	13,073.61

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金在日常投资管理中面临的与各种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等。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险控制部负责投资风险管理与绩效评估。

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和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，主要是发掘各类风险的风险点，判断风险发生的频度和损失，对风险实行分级管理。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，日常的分析报告，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时对各种风险进行监控和评估，并通过风险处置流程，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格、合格境外机构投资者托管人资格或其他经管理人评估资质良好的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境内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，在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

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

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开放期内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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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发行的证券不得超过该证券的 10%。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，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%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的

市值合计未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。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	124,464,724.68	-	-	-	124,464,724.68
结算备付金	100,000.00	-	-	-	100,000.00
交易性金融资产	186,796,705.10	682,873,075.28	712,627,699.33	-	1,582,297,479.71
应收股利	-	-	-	15,971.32	15,971.32
应收申购款	-	-	-	175,910.55	175,910.55
应收清算款	-	-	-	4,455,899.76	4,455,899.76
资产总计	311,361,429.78	682,873,075.28	712,627,699.33	4,647,781.63	1,711,509,986.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,389,348.74	13,389,348.74

应付管理人报酬	-	-	-	1,001,999.55	1,001,999.55
应付托管费	-	-	-	286,285.59	286,285.59
应交税费	-	-	-	170,608.89	170,608.89
其他负债	-	-	-	94,219.55	94,219.55
负债总计	-	-	-	14,942,462.32	14,942,462.32
利率敏感度缺口	311,361,429.78	682,873,075.28	712,627,699.33	-10,294,680.69	1,696,567,523.70
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	17,798,405.61	-	-	-	17,798,405.61
结算备付金	351,797.62	-	-	-	351,797.62
交易性金融资产	791,594,033.39	723,560,589.21	687,100,926.22	-	2,202,255,548.82
应收申购款	-	-	-	480,811.78	480,811.78
资产总计	809,744,236.62	723,560,589.21	687,100,926.22	480,811.78	2,220,886,563.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,032,607.14	12,032,607.14
应付管理人报酬	-	-	-	1,330,562.24	1,330,562.24
应付托管费	-	-	-	380,160.64	380,160.64
应交税费	-	-	-	212,254.90	212,254.90
其他负债	-	-	-	190,000.00	190,000.00
负债总计	-	-	-	14,145,584.92	14,145,584.92
利率敏感度缺口	809,744,236.62	723,560,589.21	687,100,926.22	-13,664,773.14	2,206,740,978.91

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1.市场利率下降 25 个基点	16,604,898.82	19,547,082.61
	2.市场利率上升 25 个基点	-16,602,017.91	-19,542,953.38

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产或负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基

金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	107,568,260.18	-	-	107,568,260.18
交易性金融资产	1,582,297,479.71	-	-	1,582,297,479.71
应收股利	15,971.32	-	-	15,971.32
应收申购款	24,278.74	-	-	24,278.74
应收清算款	4,455,899.76	-	-	4,455,899.76
资产合计	1,694,361,889.71	-	-	1,694,361,889.71
以外币计价的负债				
应付赎回款	16,143.58	-	-	16,143.58
负债合计	16,143.58	-	-	16,143.58
资产负债表外汇风险敞口净额	1,694,345,746.13	-	-	1,694,345,746.13
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	14,741,433.89	-	-	14,741,433.89

交易性金融资产	2,202,255,548.82	-	-	2,202,255,548.82
应收申购款	39,283.16	-	-	39,283.16
资产合计	2,217,036,265.87	-	-	2,217,036,265.87
以外币计价的负债				
应付赎回款	29,709.59	-	-	29,709.59
负债合计	29,709.59	-	-	29,709.59
资产负债表外汇风险敞口净额	2,217,006,556.28	-	-	2,217,006,556.28

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1.所有外币相对人民币升值 5%	84,717,287.31	110,850,327.81
	2.所有外币相对人民币贬值 5%	-84,717,287.31	-110,850,327.81

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金持有的证券所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运

用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于本期末，本基金无交易性权益类投资(上年度末：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(上年度末：同)。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	1,582,297,479.71	2,202,255,548.82
第三层次	-	-
合计	1,582,297,479.71	2,202,255,548.82

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这

些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,582,297,479.71	92.45
	其中：债券	1,582,297,479.71	92.45
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	124,564,724.68	7.28
8	其他各项资产	4,647,781.63	0.27
9	合计	1,711,509,986.02	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	MICRON TECHNOLOGY INC	MU US	20,144,003.62	0.91
2	Wolfspeed Inc	WOLF US	15,599,111.78	0.71
3	Alphabet Inc	GOOG US	14,424,375.53	0.65
4	TSMC	TSM UN	8,898,217.39	0.40
5	INTEL CORP	INTC US	7,561,854.23	0.34
6	MKS Inc	MKSI US	7,187,941.03	0.33
7	Innio NV	INIO US	23,784.11	0.00
8	Shanghai Seer Intelligent Technology Co Ltd	6106 HK	17,566.23	0.00
9	Circuit Fabology Microelectronics Equipment Co Ltd	9630 HK	10,967.34	0.00
10	SG Micro Corp	3661 HK	7,394.59	0.00

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

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	MICRON TECHNOLOGY INC	MU US	23,455,590.73	1.06
2	Wolfspeed Inc	WOLF US	14,403,855.19	0.65
3	Alphabet Inc	GOOG US	14,077,442.59	0.64
4	TSMC	TSM UN	9,611,470.54	0.44
5	MKS Inc	MKSI US	8,738,877.45	0.40
6	INTEL CORP	INTC US	6,912,356.44	0.31
7	Innio NV	INIO US	30,038.40	0.00
8	Shanghai Seer Intelligent Technology Co Ltd	6106 HK	19,992.31	0.00
9	Circuit Fabology Microelectronics Equipment Co Ltd	9630 HK	18,079.33	0.00
10	SG Micro Corp	3661 HK	9,135.09	0.00

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

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	73,875,215.85
卖出收入（成交）总额	77,276,838.07

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
AAA 至 A-	1,285,669,766.71	75.78
BBB+至 BBB-	287,432,083.11	16.94
未评级	9,195,629.89	0.54

注：上述债券投资组合主要适用标准普尔、穆迪、惠誉等国际权威机构评级。其中无债项评级的债券，其发行人信用评级补充如下：

未评级债券发行人信用评级 公允价值（人民币元） 占基金资产净值比例（%）

BBB+至 BBB- 9,195,629.89 0.54

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	US91282CFF32	T 2 3/4 08/15/32	149,259,000	138,463,878.92	8.16
2	US91282CLW90	T 4 1/4 11/15/34	115,336,500	114,655,999.59	6.76
3	US91282CFV81	T 4 1/8 11/15/32	108,552,000	108,034,129.08	6.37
4	US91282CNN73	T 3 7/8 07/31/30	101,767,500	102,128,416.81	6.02
5	US91282CEP23	T 2 7/8 05/15/32	108,552,000	101,067,848.17	5.96

注：1、债券代码为 ISIN 码或当地市场代码。

2、数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金本期投资的前十名证券中，无报告期内发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

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

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	4,455,899.76
3	应收股利	15,971.32
4	应收利息	-
5	应收申购款	175,910.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,647,781.63

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	USG01719AP11	BABA 0 09/15/32	27,313,888.16	1.61
2	XS2849520650	ZJMGCL 1 06/25/29	9,195,629.89	0.54

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
6,113	287,562.71	1,487,211,063.61	84.60	270,659,795.91	15.40

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	13,788,401.10	0.784381

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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 1 月 25 日）基金份额总额	684,878,198.01
本报告期期初基金份额总额	2,226,148,807.58
本报告期基金总申购份额	269,504,815.65
减：本报告期基金总赎回份额	737,782,763.71
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,757,870,859.52

§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

（一）基金管理人重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人无重大人事变动。

（二）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期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

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人没有受到调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员没有受到调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
Sanford C. Bernstein (HK) Limited	-	135,446,023.13	89.61	10,641.68	65.95	-
Macquarie Capital Asia Limited	-	15,599,111.78	10.32	5,093.15	31.56	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	28,558.16	0.02	285.34	1.77	-
Citigroup Global Markets Limited	-	27,214.40	0.02	21.77	0.13	-
Goldman	-	23,772.53	0.02	-	-	-

Sachs						
Soochow Securities Hong Kong Financial Holdings Ltd.	-	19,992.31	0.01	20.00	0.12	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	7,394.59	0.00	73.95	0.46	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

注：1、管理人对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其他相关因素后决定的。报告期内，本基金交易单元无变更。

2、上表列示交易单元数量为截至本报告期末本基金租用数量，成交金额及佣金为本报告期间数。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	44,386,126.81	1.96	-	-	-	-	-	-

Goldman Sachs	390,042,841.80	17.24	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas	209,262,694.33	9.25	-	-	-	-	-	-
Bank of America Merrill Lynch	359,020,844.52	15.87	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	65,387,068.80	2.89	-	-	-	-	-	-
Daiwa Capital Markets Hongkong Limited	192,266,712.30	8.50	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	41,731,980.84	1.84	-	-	-	-	-	-
HONGKONG AND SHANGHAI BANKING CORPORATION LIMITED	254,938,878.14	11.27	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	69,753,838.50	3.08	-	-	-	-	-	-
JPMorgan Chase & Co.	43,228,501.48	1.91	-	-	-	-	-	-
Jefferies International Limited	49,455,454.85	2.19	-	-	-	-	-	-
Nomura	354,513,923.02	15.67	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank	188,357,729.92	8.33	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下部分基金于 2026 年非港股通交易日暂停基金交易业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 1 月 15 日
2	国海富兰克林基金管理有限公司关于	中国证监会规定报刊及	2026 年 1 月 15 日

	富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）于 2026 年境外主要市场节假日暂停基金交易业务的公告	规定网站	
3	富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 1 月 22 日
4	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 1 月 22 日
5	富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）2025 年年度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 31 日
6	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 31 日
7	国海富兰克林基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 31 日
8	关于增加深圳前海微众银行股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构及相关费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 17 日
9	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 22 日
10	富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 22 日
11	国海富兰克林基金管理有限公司对外行使表决权（2025 年度）情况信息披露	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 30 日
12	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下公募基金产品开展直销中心认购、申购（含定投）、转换费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 5 月 30 日
13	关于增加深圳腾元基金销售有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 6 月 6 日
14	富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金（QDII）更新招募说明书（2026 年 1 号）	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 6 月 30 日

§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

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富兰克林国海美元债定期开放债券型证券投资基金设立的文件（于 2024 年 7 月 1 日转型为一年持有期债券型证券投资基金，基金名称变更为“富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金(QDII)”）；

2、《富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金(QDII)基金合同》；

3、《富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金(QDII)招募说明书》；

4、《富兰克林国海美元债一年持有期债券型证券投资基金(QDII)托管协议》；

5、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站：www.ftsfund.com。

12.3 查阅方式

1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件。

2、登陆基金管理人网站 www.ftsfund.com 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日