

未经审计 2026 年半年度报告

海通精选基金系列
(在香港成立的伞子式单位信托基金)

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日期间

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

目录

	页码
管理及行政	1
致份额持有人的基金管理人报告	2
财务状况表 (未经审计)	3 - 4
全面收益表 (未经审计)	5
份额持有人应占净资产变动表 (未经审计)	6 - 7
现金流量表 (未经审计)	8
投资组合 (未经审计)	9 - 19
投资组合变动表 (未经审计)	20 - 21
有关金融衍生工具的详情 (未经审计)	22 - 23
回购协议详情 (未经审计)	24
业绩表现记录 (未经审计)	25 - 30
收益分配披露	31

海通亚洲总收益债券基金
（海通精选基金系列的子基金）

管理及行政

基金管理人

海通国际资产管理（香港）有限公司
香港
黄竹坑香叶道 2 号 One Island South 15 楼

受托人兼基金注册登记机构

汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司
香港
皇后大道中 1 号

基金管理人的董事

王胜祖
周洪亮

审计师

罗兵咸永道会计师事务所
香港
中环
太子大厦 22 楼

律师

的近律师行
香港
中环
遮打道 18 号
历山大厦 5 楼

海通亚洲总收益债券基金
（海通精选基金系列的子基金）

致份额持有人的基金管理人报告

市场回顾

2026 年上半年，亚洲信贷表现非常强韧，在地缘政治风险加剧和货币政策格局不断变化的复杂宏观经济背景下稳步前行。美伊冲突爆发后，紧张局势升级，推动全球原油价格飙升，再次引发广泛的通胀压力。与此同时，美联储领导层更迭，凯文·沃什（Kevin Warsh）出任美联储主席。

固定收益市场方面，期内 10 年期美国国债收益率上升 29 个基点，从年初的 4.17% 升至 6 月底的 4.46%。在 6 月和 7 月的联邦公开市场委员会（FOMC）会议上，美联储主席沃什均维持联邦基金目标利率区间不变，释放出明确的鹰派信号，强调尽管宏观不确定性犹存，美联储仍决心遏制通胀压力再度抬头。

从基本面来看，得益于主要发行人审慎的资产负债表管理以及可控的违约风险，亚洲企业信贷基本面仍整体保持稳固。在整体利率波动的环境下，技术面持续稳健，加上区内投资者寻求收益的持续需求，为亚洲信贷息差提供了有力支撑。

市场展望

展望 2026 年下半年，宏观经济环境仍充满不确定性。美伊冲突有可能再度升级，这可能使能源价格持续承压，并导致通胀压力挥之不去。在此背景下，沃什领导的美联储预计将延续审慎鹰派的政策立场，在确信通胀趋势回归目标水平之前，将维持价格稳定作为首要任务。

鉴于这些动态，美国长期国债收益率短期内可能在高位维持区间震荡。我们对投资组合久期维持审慎立场，并将继续主动管理利率风险，同时密切关注地缘政治发展。信贷方面，得益于亚洲地区稳健的经济基本面和发行人稳健的资产负债表，我们预计亚洲信贷市场将保持韧性。此外，我们战略性地进行多元化布局，拓展进入澳元计价本地货币市场，以把握优质套利机会。我们的策略仍以严格的信贷选择为核心，注重维持投资组合的流动性充足，同时积极捕捉具备吸引力的收益增强机会。

海通国际资产管理（香港）有限公司
[日期]

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

财务状况表 (未经审计)

截至 2026 年 6 月 30 日

	(未经审计) 于 2026 年 6 月 30 日 美元	(经审计) 于 2025 年 12 月 31 日 美元
百分比		
流动资产		
按公允价值计入损益的金融资产	609,711,038	586,624,756
衍生金融工具	53,795	773,980
申购份额的应收款项	1,606	23,347,908
出售投资的应收款项	28,329,023	12,000
应收利息	8,885,398	8,330,235
其他应收款项	-	32
保证金存款	1,280,000	780,000
现金及现金等价物	42,735,236	17,799,332
总资产	690,996,096	637,668,243
负债		
流动负债		
衍生金融工具	264,155	6,719
赎回份额应付款项	32,128,906	24,360,162
购买投资应付款项	18,585,229	-
回购协议应付款项	25,674,514	-
应付利息	64,438	-
应付收益分配	2,992,495	4,362,850
其他应付款项	688,692	700,856
负债 (不包括份额持有人应占净资产)	80,398,429	29,430,587
份额持有人应占净资产 (根据本基金的原版招募说明书)	610,597,667	608,237,656
已发行份额数目		
- A 类 (美元) 收益分配份额	1,713	38,582
- A 类 (港元) 收益分配份额	71,754	100
- A 类 (人民币) 收益分配份额	100	100
- A 类 (人民币对冲) 收益分配份额	100	100
- D 类 (美元) 收益分配份额	146,768	369
- D 类 (港元) 收益分配份额	5,329	5,367
- H 类 (人民币) 收益分配份额	23,523,170	31,688,122
- H 类 (人民币对冲) 收益分配份额	25,358,784	18,279,608
- I 类 (美元) 收益分配份额	3,015,162	2,908,566
- I 类 (港元) 收益分配份额	2,040,432	1,993,024

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

财务状况表 (未经审计) (续)

截至 2026 年 6 月 30 日

	(未经审计) 于 2026 年 6 月 30 日 美元	(经审计) 于 2025 年 12 月 31 日 美元
份额净值		
- A 类 (美元) 收益分配份额	64.46	62.23
- A 类 (港元) 收益分配份额	8.27	7.99
- A 类 (人民币) 收益分配份额	9.88	9.54
- A 类 (人民币对冲) 收益分配份额	8.67	8.29
- D 类 (美元) 收益分配份额	41.33	39.90
- D 类 (港元) 收益分配份额	56.47	54.52
- H 类 (人民币) 收益分配份额	9.5362	9.4357
- H 类 (人民币对冲) 收益分配份额	8.1078	7.7590
- I 类 (美元) 收益分配份额	48.61	47.87
- I 类 (港元) 收益分配份额	13.24	12.77

附注：半年度报告采用与基金年度报告相同的会计政策和计算方法。

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

全面收益表 (未经审计)

2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日期间

	(未经审计) 报告期间 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日 美元	(未经审计) 报告期间 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日 美元
收入		
银行存款利息收入	113,994	55,896
债券利息收入	17,890,941	2,981,937
出售按公允价值计入损益的金融资产及衍生金融工具的已变现收益/(亏损)	2,452,726	(1,064,027)
出售按公允价值计入损益的金融资产及衍生金融工具的未变现(亏损)/收益	(9,995,459)	3,467,387
外币收益/(亏损) 净额	7,474,876	(1,948,487)
净收入总额	17,937,078	3,492,706
支出		
管理费 附注 2	3,199,381	633,035
受托人费用 附注 1	404,572	83,871
行政管理人费用	2,993	-
保管及银行收费 附注 1	52,751	9,317
审计师酬金	14,628	9,554
会计费 附注 1	2,976	2,976
手续费 附注 1	18,909	16,241
交易费	-	3
其他经营支出 附注 1	136,525	88,034
总经营支出	3,832,735	843,031
收益分配前净收入	14,104,343	2,649,675
财务成本		
利息支出	(197,035)	-
向份额持有人作出的收益分配	(3,014,700)	(1,015,600)
份额持有人应占净资产增加	10,892,608	1,634,075

附注 1 于截至 2026 年及 2025 年 6 月 30 日止期间，除向受托人或其关联人士支付受托人费用、保管及银行收费及手续费外，向受托人或其关联人士支付的其他款项分别如下：

	(未经审计) 报告期间 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日 美元	(未经审计) 报告期间 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日 美元
会计费	2,976	2,976
其他经营支出	132,610	82,068

附注 2 于截至 2026 年及 2025 年 6 月 30 日止期间，除向基金管理人支付管理费外，未向基金管理人或其关联人士支付其他款项。

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

份额持有人应占净资产变动表 (未经审计)
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日期间

	(未经审计) 报告期间 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日 美元	(未经审计) 报告期间 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日 美元
于 1 月 1 日份额持有人应占净资产	608,237,656	14,051,170
申购份额所得款项	288,384,454	287,228,289
赎回份额所付款项	(296,917,051)	(48,900,694)
份额交易净额 (减少) / 增加	(8,532,597)	238,327,595
份额持有人应占净资产增加	10,892,608	1,634,075
于 6 月 30 日份额持有人应占净资产	610,597,667	254,012,840
已发行份额数目	份额	份额
A 类 (美元) 收益分配份额		
期初已发行份额	38,582	1,713
发行份额	-	842
赎回份额	(36,869)	(842)
期末已发行份额	1,713	1,713
A 类 (港元) 收益分配份额		
期初已发行份额	100	100
发行份额	71,654	-
赎回份额	-	-
期末已发行份额	71,754	100
A 类 (人民币) 收益分配份额		
期初已发行份额	100	100
发行份额	-	-
赎回份额	-	-
期末已发行份额	100	100
A 类 (人民币对冲) 收益分配份额		
期初已发行份额	100	100
发行份额	-	-
赎回份额	-	-
期末已发行份额	100	100

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

份额持有人应占净资产变动表 (未经审计)
(续)

2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日期间

	(未经审计) 报告期间 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	(未经审计) 报告期间 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日
已发行份额数目 (续)	份额	份额
D 类 (美元) 收益分配份额		
期初已发行份额	369	392
发行份额	146,399	12
赎回份额	-	(37)
期末已发行份额	146,768	367
D 类 (港元) 收益分配份额		
期初已发行份额	5,367	6,175
发行份额	13	65,705
赎回份额	(51)	(66,498)
期末已发行份额	5,329	5,382
H 类 (美元) 收益分配份额		
期初已发行份额	-	10
发行份额	-	-
赎回份额	-	(10)
期末已发行份额	-	-
H 类 (人民币) 收益分配份额		
期初已发行份额	31,688,122	202,692
发行份额	7,084,681	11,620,861
赎回份额	(15,249,633)	(761,655)
期末已发行份额	23,523,170	11,061,898
H 类 (人民币对冲) 收益分配份额		
期初已发行份额	18,279,608	1,110
发行份额	18,644,174	9,888,778
赎回份额	(11,564,998)	(2,260,058)
期末已发行份额	25,358,784	7,629,830
I 类 (美元) 收益分配份额		
期初已发行份额	2,908,566	253,158
发行份额	1,033,513	2,244,535
赎回份额	(926,917)	(466,492)
期末已发行份额	3,015,162	2,031,201
I 类 (港元) 收益分配份额		
期初已发行份额	1,993,024	-
发行份额	1,027,128	-
赎回份额	(979,720)	-
期末已发行份额	2,040,432	-

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

现金流量表 (未经审计)

2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日期间

	(未经审计) 报告期间 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日 美元	(未经审计) 报告期间 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日 美元
经营活动所得现金流量		
份额持有人应占净资产增加	10,892,608	1,634,075
就以下各项作出调整:		
利息收入	(18,004,935)	(3,037,833)
利息支出	197,035	-
向份额持有人作出的收益分配	3,014,700	1,015,600
	(3,900,592)	(388,158)
出售投资的应收款项净变动	(28,317,023)	(3,237,473)
购买投资的应付款项净变动	18,585,229	4,825,958
保证金存款净变动	(500,000)	(780,000)
回购协议的应付款项净变动	25,674,514	-
其他应收款项净变动	32	(162)
按公允价值计入损益的金融资产净变动	(23,086,282)	(236,943,937)
衍生金融工具净变动	977,621	(148,505)
其他应付款项净变动	(12,164)	213,539
经营活动使用的现金	(10,578,665)	(236,458,738)
已收利息	17,449,772	(93,126)
经营活动所得/(使用)的现金流量净额	6,871,107	(236,551,864)
筹资活动所得现金流量		
向份额持有人支付的收益分配	(4,362,850)	(253,158)
支付利息	(132,597)	-
申购份额所得款项	311,708,551	286,904,544
赎回份额所付款项	(289,148,307)	(48,354,153)
筹资活动所得现金流量净额	18,064,797	238,297,233
现金及现金等价物增加净额	24,935,904	1,745,369
期初现金及现金等价物	17,799,332	753,118
期末现金及现金等价物	42,735,236	2,498,487
现金及现金等价物余额分析:		
现金存款	42,735,236	2,498,487

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

投资组合 (未经审计)

2026 年 6 月 30 日

	持仓	公允价值 美元	所占 净资产的 百分比
集合投资计划 (证监会认可或合格计划)			
(1.68%)			
香港(0.21%)			
海通港元货币市场基金	94,182	1,298,297	0.21
		1,298,297	0.21
爱尔兰(1.47%)			
Janus Hend Haitong Asia Ex-Japan High Yield Corp USD Bond Screened UCITS ETF	700,000	5,797,540	0.95
Tabula Haitong Asia Pacific Select Bond Fund	274,821	3,165,687	0.52
		8,963,227	1.47
集合投资计划总计		10,261,524	1.68
挂牌债券(98.17%)			
澳大利亚(8.35%)			
Ampol Ltd (Ser Mtn) (Reg S) (Reg) Var 30/10/2055	250,000	165,083	0.03
Apa Infrastructure Ltd (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 5.125% 16/09/2034	4,500,000	4,471,605	0.73
Ausnet Services Holdings (Ser Mtn) (Reg) (Reg S) FRN 04/02/2056	300,000	203,912	0.03
Ausnet Services Holdings (Ser Mtn) (Reg) Var 04/02/2056	500,000	341,255	0.06
Aust & NZ Banking Group (Ser Regs) (Reg S) Var 18/06/2036	2,500,000	2,559,075	0.42
Aust & NZ Banking Group (Ser Regs) (Reg S) Var 30/09/2035	2,000,000	1,982,680	0.32
CDC Data Centers Au Pty (Ser Mtn) FRN 12/06/2056	2,500,000	1,733,512	0.28
Cimic Finance USA Pty Ltd (Ser Regs) (Reg S) 7% 25/03/2034	4,700,000	5,015,840	0.82
Macquarie Bank Ltd (Ser Regs) (Reg S) 6.798% 18/01/2033	1,000,000	1,079,960	0.18
Macquarie Bank Ltd (Ser Regs) (Reg S) Var 13/08/2036	2,000,000	2,003,780	0.33
Mineral Resources Ltd (Ser Regs) (Reg S) 7% 01/04/2031	800,000	829,024	0.14
National Australia Bank (Ser Regs) (Reg S) 5.902% 14/01/2036	2,500,000	2,576,350	0.42
NBN Co Ltd (Ser Mtn) (Reg S) 5.85% 19/03/2036	500,000	348,289	0.06
Newcastle Coal Infrastructure (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 4.7% 12/05/2031	3,426,000	3,200,963	0.52
Norfina Ltd (Ser Mtn) FRN 17/06/2031	3,000,000	2,064,862	0.34
QBE Insurance Group Ltd (Ser Emtn) (Reg) (Reg S) Var 03/10/2035	1,500,000	1,534,335	0.25
QBE Insurance Group Ltd (Ser Emtn) (Reg) (Reg S) Var 10/11/2037	2,000,000	1,983,740	0.32
Santos Finance Ltd (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 5.75% 13/11/2035	4,000,000	4,056,560	0.66
Santos Finance Ltd (Ser Regs) (Reg S) 6.875% 19/09/2033	1,000,000	1,091,250	0.18
Sydney Airport Finance (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 5.248% 26/03/2036	2,000,000	1,989,060	0.33
Westpac Banking Corp (Ser Gmtm) (Reg) Var 20/11/2035	3,000,000	3,037,590	0.50
Westpac Banking Corp NY (Ser) (Reg) 4.45% 12/06/2031	2,000,000	1,991,920	0.33
Westpac Banking Corp Var 18/11/2036	1,000,000	895,860	0.15
Woodside Finance Ltd (Reg) 5.1% 12/09/2034	2,000,000	1,979,740	0.32
Woodside Finance Ltd 5.4% 19/05/2030	1,750,000	1,783,495	0.29
Woodside Finance Ltd 6% 19/05/2035	2,000,000	2,091,480	0.34
		51,011,220	8.35

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

投资组合 (未经审计) (续)

2026 年 6 月 30 日

	持仓	公允价值 美元	所占 净资产的 百分比
挂牌债券(98.17%) (续)			
<u>百慕大(1.63%)</u>			
Convex Group Ltd (Reg) (Reg S) Var 21/01/2046	1,500,000	1,469,460	0.24
Li & Fung Ltd (Reg S) (Reg) 8.375% 05/02/2029	1,000,000	1,020,540	0.17
RLGH Finance Bermuda Ltd (Reg S) (Reg) 6.75% 02/07/2035	4,300,000	4,463,271	0.73
RLGH Finance Bermuda Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	3,000,000	3,008,520	0.49
		9,961,791	1.63
<u>英属维尔京群岛(3.10%)</u>			
CAS Capital No2 Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	2,500,000	2,514,850	0.41
China Cinda 2020 I Mngmn (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 3.125% 18/03/2030			
	2,000,000	1,891,520	0.31
CS Treasury Mgmt Service (Ser Regs) (Reg S) 9% Perp 31/12/2049	4,000,000	4,123,200	0.67
Fortune Star BVI Ltd (Reg S) (Reg) 6.8% 09/09/2029	1,000,000	990,010	0.16
NWD MTN Ltd (Reg S) (Reg) 8.625% 08 /02/2028	2,500,000	2,422,200	0.40
Peak Re BVI Holding Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	4,510,000	4,517,261	0.74
Studio City Co Ltd (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 6.125% 15/05/2031	2,500,000	2,477,850	0.41
		18,936,891	3.10
<u>开曼群岛(6.03%)</u>			
Al Rajhi Sukuk Ltd (Ser Emtn) (Reg) (Reg S) Var 16/03/2036	3,500,000	3,481,065	0.57
BSF Finance (Ser Emtn) (Reg) (Reg S) Var 03/09/2035	2,000,000	1,968,160	0.32
China Resources Land Ltd (Reg S) (R Eg) 4.125% 20/11/2028	1,400,000	1,378,594	0.23
FWD Group Holdings Ltd (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 7.635% 02/07/2031			
	2,000,000	2,178,220	0.36
FWD Group Holdings Ltd (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 5.252% 22/09/2030	1,000,000	995,270	0.16
Gaci First Investment (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 5% 15/09/2035	2,800,000	2,739,128	0.45
Greentown China Hldgs (Reg S) (Reg) 7% 19/05/2029	2,000,000	1,952,040	0.32
Greentown China Hldgs (Reg S) (Reg) 8.45% 24/02/2028	2,000,000	2,018,940	0.33
Kuaishou Technology (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 4.75% 22/01/2036	1,000,000	959,770	0.16
Melco Resorts Finance (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 6.5% 24/09/2033	2,000,000	1,964,640	0.32
Mongolian Mining Corp (Ser Regs) (Reg S) 8.44% 03/04/2030	3,000,000	3,065,520	0.50
New World China Land Ltd (Reg S) (Reg) 4.75% 23/01/2027	5,500,000	5,322,460	0.87
Omniyat Sukuk 1 Ltd (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 7.25% 16/03/2029	1,000,000	966,690	0.16
Riyad Sukuk (Ser Emtn) (Reg) (Reg S) Var 14/07/2035	1,500,000	1,512,585	0.25
Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg) 3.925% 19/01/2038	1,000,000	901,810	0.15
Wynn Macau Ltd (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 6.75% 15/02/2034	4,000,000	3,979,760	0.65
Zhongsheng Group (Reg S) (Reg) 5.98 % 30/01/2028	1,500,000	1,430,820	0.23
		36,815,472	6.03

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

投资组合 (未经审计) (续)

2026 年 6 月 30 日

	持仓	公允价值 美元	所占 净资产的 百分比
挂牌债券(98.17%) (续)			
<u>中国内地(10.02%)</u>			
AAC Technologies Holding (Reg S) (Reg) 3.75% 02/06/2031	1,600,000	1,502,960	0.25
BOC Aviation USA Corp (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 4.625% 04/09/2031	1,200,000	1,200,792	0.20
CDB Financial Leasing (Reg) (Reg S) Var 10/11/2035	3,000,000	2,983,470	0.49
Central Plaza Dev Ltd (Reg S) (Reg) 6.8% 07/04/2029	2,000,000	1,999,780	0.33
Central Plaza Dev Ltd (Reg S) (Reg) 7.15% 21/03/2028	5,900,000	5,949,206	0.97
CFAMC IV Co., Ltd.(Ser Emtn) (Reg S) 3.375% 24/02/2030	2,700,000	2,559,789	0.42
Chengdu ETDZ State Owned (Reg S) (Reg) 6.5% 18/11/2027	2,500,000	2,491,775	0.41
Chongqing Nanan Urban Construction And Development Group Co Ltd	500,000	499,690	0.08
CNAC HK Finbridge Co Ltd (Reg) (Reg S) 3% 22/09/2030	10,000,000	9,393,500	1.54
Far East Horizon Ltd (Ser Emtn) (Re G S) (Reg) 5.875% 05/03/2028	2,500,000	2,517,525	0.41
Fortune Star BVI Ltd (Reg S) (Reg) 5.05% 27/01/2027	800,000	793,568	0.13
Fortune Star BVI Ltd (Reg S) (Reg) 8.5% 19/05/2028	2,000,000	2,055,780	0.34
Hanrui Overseas Invst (Reg S) (Reg) 6.28% 23/01/2028	500,000	501,740	0.08
Hebei Shunde Inv (Reg S) (Reg) 8.5% 21/06/2027	4,000,000	4,080,000	0.67
Huarong Finance 2019 Co Ltd (Reg S) 4.5% 29/05/2029	3,150,000	3,118,153	0.51
Kaifeng Develop INV (Ser) (Reg S) (Reg) 6.5% 04/06/2028	3,000,000	2,974,260	0.49
Lenovo Group Ltd (Ser Regs) (Reg S) 3.421% 02/11/2030	4,000,000	3,780,720	0.62
Nexen Inc (Reg) 5.875% 10/03/2035	1,700,000	1,847,594	0.30
Prosus NV (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 3.061% 13/07/2031	1,700,000	1,549,159	0.25
Prosus NV (Ser Regs) (Reg S) 4.193% 19/01/2032	3,000,000	2,862,960	0.47
Shanghai Port Grp Dev Co (Reg S) (Reg) 2.85% 11/09/2029	1,000,000	951,170	0.16
Soar Wind Ltd (Ser Emtn) (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	700,000	700,490	0.11
UETD Con&Dev Cap Invest (Reg S) (Reg) 7.5% 28/08/2027	2,800,000	2,824,500	0.46
WH Financial Holdings (Reg S) (Reg) 5.4% 05/11/2027	2,000,000	2,015,600	0.33
		61,154,181	10.02
<u>芬兰(0.41%)</u>			
Nordea Bank ABP (Ser Regs) (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	2,500,000	2,519,675	0.41
		2,519,675	0.41
<u>法国(2.52%)</u>			
BNP Paribas (Ser Regs) (Reg S) (Reg) Var 31/12/2049	2,000,000	2,108,520	0.35
BNP Paribas (Ser Regs) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	3,500,000	3,751,475	0.61
BNP Paribas (Ser Regs) (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	4,000,000	4,025,840	0.66
BNP Paribas (Ser Regs) Var Perp	1,950,000	1,798,543	0.29
BPCE Sa (Ser Regs) (Reg S) Var 18/01/2035	2,000,000	2,086,320	0.34
Credit Agricole SA (Ser Regs) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	1,435,000	1,439,520	0.24
Electricite De France Sa (Ser Mtn) (Reg) 5.636% 28/08/2035	300,000	201,916	0.03
		15,412,134	2.52

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

投资组合 (未经审计) (续)

2026 年 6 月 30 日

	持仓	公允价值 美元	所占 净资产的 百分比
挂牌债券(98.17%) (续)			
<u>德国(1.16%)</u>			
Allianz Se (Ser Regs) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	5,000,000	5,075,950	0.83
Deutsche Bank NY (Reg) FRN 04/08/2031	2,000,000	2,008,080	0.33
		7,084,030	1.16
<u>英国(5.22%)</u>			
Barclays Plc (Ser Emtn) (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	3,500,000	2,435,356	0.40
Biocon Biologics Global (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 6.67% 09/10/2029	3,000,000	3,021,570	0.50
HSBC Holdings Plc (Reg) Var 31/12/2049	3,000,000	3,079,680	0.50
HSBC Holdings Plc (Ser 1) (Reg) Var Perp 31/12/2049	8,000,000	8,058,080	1.32
HSBC Holdings Plc (Ser) (Reg) Var Perp 31/12/2049	3,200,000	3,261,792	0.53
Lloyds Banking Group Plc (Reg) Var Perp 31/12/2049	2,000,000	1,984,900	0.33
Lloyds Banking Group Plc (Ser)(Reg) Var 13/06/2036	1,000,000	1,032,460	0.17
Natwest Group PL Var Perp 31/12/204 9	2,000,000	1,848,220	0.30
Natwest Group Plc (Reg) Var Perp 31/12/2049	2,000,000	2,083,900	0.34
Rothsay Life (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	1,000,000	998,220	0.16
Standard Chartered Plc (Ser Regs) (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	3,000,000	3,019,740	0.50
Vedanta Resources (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 9.125% 15/10/2032	1,000,000	1,063,270	0.17
		31,887,188	5.22
<u>香港(5.44%)</u>			
Bank of East Asia Ltd (Ser Emtn) (R Eg) (Reg S) Var 27/06/2034	4,000,000	4,145,920	0.68
Bank Of East Asia Ltd (Ser Emtn) (Reg) (Reg S) Var 13/05/2032	5,000,000	5,011,000	0.82
China Citic Bank Intl (Ser Emtn) (R Eg) (Reg S) Var 05/12/2033	500,000	515,237	0.09
CLP Power Hong Kong Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	6,250,000	6,396,563	1.05
CN Ping An Insurance Oversea (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 6.125% 16/05/2034	4,565,000	4,848,578	0.79
Hongkong Intl Qingdao (Reg S) (Reg) 5.75% 12/09/2027	1,000,000	1,011,140	0.16
MTR Corp CI Ltd (Ser Emtn) (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	6,500,000	6,704,230	1.10
MTR Corp Ltd (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 5.25% 01/04/2055	500,000	500,560	0.08
Nanyang Commercial Bank (Reg) (Regs) Var 06/08/2034	4,000,000	4,087,600	0.67
		33,220,828	5.44

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

投资组合 (未经审计) (续)

2026 年 6 月 30 日

	持仓	公允价值 美元	所占 净资产的 百分比
挂牌债券(98.17%) (续)			
印度(5.83%)			
10 Renew Power Subsidiary (Ser Regs) (Reg) 4.5% 14/07/2028	1,200,000	1,161,108	0.19
Adani Electricity Mumbai (Ser Regs) (Reg) 3.867% 22/07/2031	3,381,000	3,099,025	0.51
Adani Green Energy Up (Ser Regs) (Reg) 6.7% 12/03/2042	2,000,000	1,943,738	0.32
Adani International Cont (Ser Regs) (Reg) 3% 16/02/2031	1,000,000	677,776	0.11
Adani Ports And Special (Ser Regs) (Reg) 3.828% 02/02/2032	500,000	456,540	0.08
Adani Ports And Special (Ser Regs) (Reg) 4.375% 03/07/2029	2,500,000	2,431,425	0.40
Adani Transmission Ltd (Ser Regs) (Reg) 4.25% 21/05/2036	3,000,000	1,727,644	0.28
GMR Hyderabad Internatio Ser Regs 4.25% 27/10/2027	400,000	394,388	0.06
Indiabulls Housing Fin (Ser Regs) (Reg) 9.7% 03/07/2027	900,000	925,965	0.15
IRB Infrastructure Deve (Ser Regs) (Reg) 7.11% 11/03/2032	3,200,000	3,247,552	0.53
Muthoot Finance Ltd (Ser Regs) (Reg) 6.375% 02/03/2030	4,500,000	4,498,830	0.74
Muthoot Finance Ltd (Ser Regs) (Reg) 6.375% 23/04/2029	1,700,000	1,704,709	0.28
Piramal Capital & House (Ser Emtm) (Reg) 7.8% 29/01/2028	1,500,000	1,530,990	0.25
Power Finance Corp Ltd (Reg) 4.5% 18/06/2029	2,300,000	2,265,891	0.37
Power Finance Corp Ltd (Ser Gmtm) (Reg) 3.35% 16/05/2031	1,000,000	924,140	0.15
Power Finance Corp Ltd (Ser Regs) (Reg) 3.95% 23/04/2030	2,710,000	2,605,909	0.43
Rec Ltd Ser Emtm (Reg) 4.625% 22/03/2028	1,400,000	1,390,830	0.23
Reliance Industries Ltd (Ser Regs) (Reg) 2.875% 12/01/2032	1,500,000	1,350,630	0.22
Sammaan Capital Ltd (Ser Regs) (Reg) 8.95% 28/08/2028	1,000,000	1,040,480	0.17
State Bank India/London (Ser Emtm) (Reg) 4.5% 09/09/2030	1,200,000	1,179,288	0.19
Vedanta Resources (Ser Regs) (Reg) 10.875% 17/09/2029	1,000,000	1,064,480	0.17
		35,621,338	5.83
印度尼西亚(4.22%)			
Bank Mandiri Pt (Ser Emtm) (Reg) 4.9% 24/03/2028	300,000	299,610	0.05
Bank Mandiri PT (Ser Emtm) (Reg) 5.25% 10/04/2031	500,000	499,050	0.08
Cikarang Listrindo Pt (Ser Regs) (Reg) 5.65% 12/03/2035	3,800,000	3,786,396	0.62
Freeport Indonesia Pt (Ser Regs) (Reg) 5.315% 14/04/2032	2,900,000	2,886,022	0.47
Krakatau Posco PT (Reg) 6.3 75% 11/06/2027	200,000	201,034	0.03
Krakatau Posco Pt (Reg) 6.3 75% 11/06/2029	2,700,000	2,718,306	0.45
Medco Cypress Tree Pte (Ser Regs) (Reg) 8.625% 19/05/2030	1,500,000	1,566,345	0.26
Minejasa Capital BV Ser Regs 4.625% 10/08/2030	1,500,000	960,445	0.16
Minejasa Capital BV Ser Regs 5.625% 10/08/2037	4,000,000	3,818,440	0.62
Pertamina Hulu Energi Pt (Ser Regs) (Reg) 5.25% 21/05/2030	4,000,000	4,006,200	0.66
Perusahaan Listrik Negar (Ser Regs) (Reg) 4.75% 03/02/2031	1,000,000	979,190	0.16
PT Indonesia Asahan Alumini And Pt Mineral Industri Indonesia	1,200,000	1,209,792	0.20
PT Pakuwon Jati (Reg) 4.875% 29/0 4/2028	1,000,000	979,830	0.16
Pt Pertamina (Persero) (Ser Regs) (Reg) 2.3% 09/02/2031	1,000,000	881,320	0.14
PT Sarana Multi Infra (Ser Emtm) (Reg) 5% 13/05/2031	1,000,000	987,250	0.16
		25,779,230	4.22

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

投资组合 (未经审计) (续)

2026 年 6 月 30 日

	持仓	公允价值 美元	所占 净资产的 百分比
挂牌债券(98.17%) (续)			
爱尔兰(0.24%)			
SMBC Aviation Capital Fi (Ser Regs) (Reg S) 5.1% 01/04/2030	1,000,000	1,005,710	0.17
SMBC Aviation Capital Fi (Ser Regs) (Reg S) 5.3% 03/04/2029	444,000	449,279	0.07
		1,454,989	0.24
日本(12.96%)			
Asahi Mutual Life Insurance (Reg S) Va R Perp 31/12/2049	700,000	718,795	0.12
Chugoku Electric Power (Reg S) (Reg) 5.742% 14/01/2035	3,000,000	3,090,330	0.51
Dai-Ichi Life Holdings (Ser Regs) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	4,000,000	4,080,160	0.67
Fukoku Mutual Life Insurance (Reg S) Var Perp 31/12/2049	1,000,000	1,054,940	0.17
Hikari Tsushin Inc (Reg S) (Reg) 6.13% 18/09/2035	4,200,000	4,236,456	0.69
Hokkaido Electric Power (Reg S) (Reg) 4.587% 04/09/2030	1,000,000	989,470	0.16
Honda Motor Co Ltd (Reg) 5.337% 08/07/2035	2,000,000	2,007,000	0.33
Kioxia Holdings Corp (Ser Regs) (Reg S) 6.25% 24/07/2030	6,000,000	6,204,600	1.02
Kioxia Holdings Corp (Ser Regs) (Reg S) 6.625% 24/07/2033	7,000,000	7,349,160	1.20
Kyushu Electric Power Co (Reg S) (Reg) 5.246% 09/09/2035	6,000,000	5,989,980	0.98
Marubeni Corp (Ser Regs) (Reg S) 5.383% 01/04/2035	2,700,000	2,760,264	0.45
Meiji Yasuda Life Insurance (Ser Regs) (Reg S) Var 11/09/2054	2,000,000	1,992,060	0.33
Mitsubishi UFJ Fin Grp (Reg) Var 16 /01/2036	1,500,000	1,542,855	0.25
Mitsubishi UFJ Fin Grp Var Perp 31/12/2049	2,000,000	1,998,940	0.33
Mizuho Financial Group (Reg) FRN 13/07/2032	2,000,000	2,003,238	0.33
Nippon Life Insurance (Ser Regs) (Reg S) Var 16/09/2051	500,000	443,770	0.07
Nippon Life Insurance (Ser Regs) (Reg S) Var 13/09/2053	2,000,000	2,075,900	0.34
Nippon Life Insurance (Ser Regs) (Reg S) Var 16/04/2054	1,700,000	1,729,002	0.28
Nippon Life Insurance (Ser Regs) (Reg S) Var 30/04/2055	2,000,000	2,099,120	0.34
Nomura Holdings Inc (Reg) Var 10/06 /2036	3,000,000	2,938,350	0.48
Nomura Holdings Inc Var Perp 31/12/2049	1,000,000	1,027,100	0.17
Orix Corp (Reg) 5.4% 25/02/2035	4,500,000	4,576,005	0.75
Rakuten Group Inc (Ser Regs) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	2,000,000	2,054,640	0.34
Rakuten Group Inc (Ser Regs) Var Perp 31/12/2049	815,000	775,611	0.13
Softbank Group Corp (Reg S) (Reg) 7.5% 10/07/2035	1,200,000	1,225,020	0.20
Sumitomo Mitsui Trst (Ser Regs) (Reg S) Var 11/09/2036	2,099,000	2,076,205	0.34
Sumitomo Life Insurance (Ser Regs) (Reg S) Var 10/09/2055	2,000,000	1,994,660	0.33
Sumitomo Life Insurance (Ser Regs) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	1,100,000	1,102,904	0.18
Sumitomo Mitsui Finance (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 5.236% 01/05/2030	300,000	303,954	0.05
Sumitomo Mitsui Finl Grp (Reg) 5.45 4% 15/01/2032	500,000	513,005	0.08
Sumitomo Mitsui Finl Grp (Reg) FRN 07/07/2032	2,000,000	2,000,530	0.33
Sumitomo Mitsui Finl Grp (Reg) Var Perp 31/12/2049	4,000,000	4,024,110	0.66
Sumitomo Mitsui TT BK Lt (Ser Regs) (Reg S) 4.85% 10/09/2034	1,000,000	989,070	0.16
Takeda Pharmaceutical (Reg) 5.3% 05 /07/2034	1,135,000	1,154,125	0.19
		79,121,329	12.96

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

投资组合 (未经审计) (续)
2026 年 6 月 30 日

	持仓	公允价值 美元	所占 净资产的 百分比
挂牌债券(98.17%) (续)			
<u>卢森堡(0.34%)</u>			
Greensaif Pipelines Bidc (Ser Regs) (Reg) (Reg S) 6.1027% 23/08/2042	2,000,000	2,046,720	0.34
		2,046,720	0.34
<u>澳门(1.54%)</u>			
Sands China Ltd (Reg) 4.375% 18/06/ 2030	1,500,000	1,454,730	0.24
Sands China Ltd 5.9% (Reg) 08/08/2028	1,500,000	1,511,400	0.24
Studio City Finance Ltd (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 5% 15/01/2029	2,500,000	2,393,675	0.39
Studio City Finance Ltd (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 6.5% 15/01/2028	2,800,000	2,797,088	0.46
TAI Fung Bank Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	1,200,000	1,268,184	0.21
		9,425,077	1.54
<u>马来西亚(0.74%)</u>			
GENM Capital Labuan (Ser Regs) 3.882% 19/04/2031	2,250,000	2,030,603	0.33
Petronas Capital Ltd (Ser Regs) (Reg S) 4.95% 03/01/2031	2,000,000	2,029,080	0.33
Petronas Capital Ltd (Ser Regs) (Reg) 3.5% 21/04/2030	500,000	482,005	0.08
		4,541,688	0.74
<u>毛里求斯(0.15%)</u>			
UPL Corp Ltd (Reg S) 4.625% 16/06/2030	1,000,000	928,790	0.15
		928,790	0.15
<u>蒙古(0.49%)</u>			
Golomt Bank JSC (Ser Regs) (Reg S) 7.95% 14/05/2029	3,000,000	3,021,810	0.49
		3,021,810	0.49
<u>荷兰(1.60%)</u>			
Ing Groep NV (BR) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	700,000	747,705	0.12
Ing Groep Nv (Ser .)(Reg) Var Perp 31/12/2049	3,500,000	3,603,250	0.59
ING Groep Nv (Ser) (Br) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	3,800,000	3,725,710	0.61
Prosus Nv (Ser Gmtn) (Reg S) (Reg) 4.343% 15/07/2035	1,500,000	1,700,691	0.28
		9,777,356	1.60

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

投资组合 (未经审计) (续)

2026 年 6 月 30 日

	持仓	公允价值 美元	所占 净资产的 百分比
挂牌债券(98.17%) (续)			
<u>新西兰(0.26%)</u>			
Contact Energy Ltd (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 3.537% 03/11/2032	1,400,000	1,580,235	0.26
		1,580,235	0.26
<u>菲律宾(0.61%)</u>			
Bank of Philippine Islan (Ser Emtn) (Reg S) 5.625% 07/04/2035	1,200,000	1,226,292	0.20
Jollibee Worldwide Pte L (Reg S) 5.332% 02/04/2030	300,000	305,601	0.05
Petron Corp (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	1,200,000	1,217,280	0.20
SAN Miguel Global Power (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	1,000,000	1,002,370	0.16
		3,751,543	0.61
<u>卡塔尔(0.07%)</u>			
ABQ Finance (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 4.95% 25/03/2030	400,000	401,056	0.07
		401,056	0.07
<u>沙特阿拉伯(3.69%)</u>			
EIG Pearl Holdings Sarl (Ser Regs) (Reg S) 3.545% 31/08/2036	800,000	704,749	0.11
EIG Pearl Holdings Sarl (Ser Regs) (Reg) (Reg S) 4.387% 30/11/2046	1,400,000	1,143,352	0.19
Gaci First Investment (Reg S) (Reg) 5.625% 29/07/2034	1,000,000	1,022,060	0.17
Greensaif Pipelines Bidc (Ser Regs) (Reg) (Reg S) 5.8528% 23/02/2036	5,000,000	5,116,250	0.84
Saudi Arabian Oil Co (Ser Regs) (Re G S) 6.375% 02/06/2055	1,000,000	1,017,030	0.17
Saudi Arabian Oil Co (Ser Regs) (Reg S) 5.375% 02/06/2035	4,000,000	4,030,840	0.66
Saudi Awwal Bank (Ser Emtn) (Reg) (Reg S) Var 04/09/2035	1,000,000	994,960	0.16
Saudi National Bank (Ser Emtn) (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	4,500,000	4,446,675	0.73
SNB Funding Ltd (Ser Emtn) (Reg) (Reg S) Var 24/06/2035	4,000,000	4,034,440	0.66
		22,510,356	3.69
<u>新加坡(1.35%)</u>			
Fubon Life Singapore (Reg S) (Reg) 5.45% 10/12/2035	1,000,000	988,570	0.16
GLP Pte Ltd (Reg S) (Reg) 9.75% 20/05/2028	1,500,000	1,276,485	0.21
Nanshan Life Pte Ltd (Reg) (Reg S) Var 17/03/2041	3,700,000	3,625,371	0.59
Oversea-Chinese Banking (Ser Regs) (Reg) (Reg S) Var 08/09/2035	2,000,000	1,968,332	0.32
Singapore Airlines Ltd (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 5.25% 21/03/2034	400,000	408,760	0.07
		8,267,518	1.35

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

投资组合 (未经审计) (续)

2026 年 6 月 30 日

	持仓	公允价值 美元	所占 净资产的 百分比
挂牌债券(98.17%) (续)			
<u>韩国(6.92%)</u>			
Export-Import Bank Korea (Reg) 4.875% 14/01/2030	3,300,000	3,359,301	0.55
Hana Securities Co Ltd (Reg S) (Reg) 4.875% 02/06/2031	3,000,000	2,978,190	0.49
Hana Securities Co Ltd (Reg S) (Reg) 5% 30/04/2028	1,000,000	1,002,780	0.16
Hanwha Life Insurance (Ser Regs) (Reg) (Reg S) Var 24/06/2055	4,000,000	4,126,560	0.68
Korea East-West Power Co (Reg S) (Reg) 4% 04/05/2031	500,000	487,550	0.08
Korea National Oil Corp (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 4.75% 31/03/2030	1,500,000	1,509,870	0.25
Korea Tobacco & Ginseng (Reg S) (Reg) 5% 02/05/2028	300,000	301,992	0.05
Kyobo Life Insurance Co (Ser Regs) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	9,305,000	9,401,028	1.54
LG Energy Solution (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 5.375% 02/04/2030	1,500,000	1,515,000	0.25
LG Energy Solution (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 5.875% 02/04/2035	3,500,000	3,571,050	0.58
Mirae Asset Securities (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 5.125% 06/07/2029	2,000,000	2,000,820	0.33
Mirae Asset Securities (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 5.25% 06/07/2031	2,000,000	1,998,180	0.33
Posco Holdings Inc (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 5.125% 07/05/2030	1,000,000	1,008,430	0.17
Shinhan Bank (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 5.75% 15/04/2034	2,000,000	2,072,060	0.34
Shinhan Financial Group (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 4.5% 30/07/2030	2,000,000	1,985,120	0.32
SK Hynix Inc (Ser Regs) (Reg S) 6.5 % 17/01/2033	1,000,000	1,089,500	0.18
Tongyang Life Insurance Co (Reg S) Var 07/05/2035	1,200,000	1,237,908	0.20
Woori Bank (Ser Regs) (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	2,500,000	2,588,350	0.42
		42,233,689	6.92
<u>西班牙(0.43%)</u>			
Banco Santander SA (Reg) FRN 06/11/2030	2,600,000	2,611,440	0.43
		2,611,440	0.43
<u>超国家(1.10%)</u>			
African Development Bank (Reg) Var Perp 31/12/2049	4,311,000	4,245,559	0.70
African Development Bank Var Perp 31/12/2049	2,500,000	2,459,800	0.40
		6,705,359	1.10
<u>瑞士(1.16%)</u>			
UBS Group AG (Ser Mtn) (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	750,000	512,527	0.09
UBS Group AG (Ser Regs) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	6,700,000	6,550,636	1.07
		7,063,163	1.16

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

投资组合 (未经审计) (续)

2026 年 6 月 30 日

	持仓	公允价值 美元	所占 净资产的 百分比
挂牌债券(98.17%) (续)			
<u>台湾(1.07%)</u>			
Nanshan Life Pte Ltd (Reg S) (Reg) 5.45% 11/09/2034	4,000,000	3,897,120	0.64
Shin Kong Life SG Pte (Reg S) 6.95% 26/06/2035	2,500,000	2,620,950	0.43
		6,518,070	1.07
<u>泰国(1.81%)</u>			
Bangkok Bank PCL (Ser Regs) (Reg S) Var 23/09/2036	1,500,000	1,365,735	0.22
Bangkok Bank PCL/HK (Ser Regs) (Reg S) Var 25/03/2040	1,500,000	1,530,900	0.25
Bangkok Bank PCL/HK (Ser Regs) (Reg) (Reg S) Var 25/09/2034	4,000,000	3,811,360	0.62
GC Treasury Centre Co (Ser Regs) (R Eg S) Var Perp 31/12/2049	2,200,000	2,186,646	0.36
Thaioil TRSRY Center (Ser Regs) (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	2,200,000	2,167,682	0.36
		11,062,323	1.81
<u>土耳其(0.13%)</u>			
Turk Ihracat Kr Bk (Ser Regs) (Reg S) 6.375% 03/10/2030	800,000	784,928	0.13
		784,928	0.13
<u>阿联酋(3.49%)</u>			
Abu Dhabi Development Holdings (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 4.375% 02/10/2031	1,000,000	977,300	0.16
Abu Dhabi Development Holdings (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 4.5% 06/05/2030	1,500,000	1,485,690	0.24
Abu Dhabi Development Holdings (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 5% 06/05/2035	500,000	492,975	0.08
Abu Dhabi Development Holdings (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 5.375% 08/05/2029	1,000,000	1,016,660	0.17
Aldar Investment Prop (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 5.25% 25/03/2035	200,000	196,828	0.03
Aldar Properties PJSC (Reg S) Var 1 5/04/2055	3,000,000	2,989,290	0.49
Aldar Properties Pjsc (Ser Regs) (Reg S) Var 14/04/2056	2,000,000	1,897,720	0.31
Alpha Star Holding (Reg S) (Reg) 8.375% 12/04/2027	2,000,000	2,019,400	0.33
DP World Crescent Ltd (Ser Regs) (Reg S) 5.5% 08/05/2035	2,500,000	2,507,800	0.41
Galaxy Pipeline Assets (Ser Regs) (Reg S) 2.625% 31/03/2036	1,400,000	1,223,362	0.20
Galaxy Pipeline Assets (Ser Regs) (Reg S) 2.94% 30/09/2040	2,000,000	1,412,247	0.23
Ittihad International In (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 7.375% 13/11/2030	1,000,000	1,013,280	0.17
Masdar Abu Dhabi (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 4.875% 21/05/2030	300,000	299,286	0.05
Masdar Abu Dhabi (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 4.875% 25/07/2033	1,500,000	1,475,445	0.24
Masdar Abu Dhabi (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 5.375% 21/05/2035	1,300,000	1,313,546	0.22
Sobha Sukuk I Holding (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) 7.125% 11/09/2030	1,000,000	966,750	0.16
		21,287,579	3.49

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

投资组合 (未经审计) (续)
2026 年 6 月 30 日

	持仓	公允价值 美元	所占 净资产的 百分比
挂牌债券(98.17%) (续)			
美国(4.09%)			
Ford Motor Credit Co Llc (Reg) 6.5% 07/02/2035	3,500,000	3,578,925	0.59
General Motors Co (Reg) 6.25% 15/04/2035	2,000,000	2,093,420	0.34
Hanwha Futureproof Corp (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 4.75% 30/04/2028	400,000	401,252	0.07
Hyundai Capital America (Ser Regs) (Reg S) 5.15% 27/03/2030	500,000	503,205	0.08
Karoon USA Finance Inc (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 10.5% 14/05/2029	500,000	515,785	0.09
Komatsu Finance America (Ser Regs) (Reg S) (Reg) 4.196% 18/09/2030	500,000	489,525	0.08
Takeda US Fin (Reg) 5.2% 07/07/2035	3,500,000	3,490,340	0.57
US Treasury 3.625% 31/12/2030	3,500,000	3,414,414	0.56
US Treasury 4.375% 31/12/2029	8,500,000	8,548,808	1.40
US Treasury 4.625% 15/02/2046	2,000,000	1,914,844	0.31
		24,950,518	4.09
挂牌债券总计		599,449,514	98.17
投资总计 (集合投资计划及挂牌债券)		609,711,038	99.85
远期外汇合约(-0.03%)		(210,360)	(0.03)
投资及衍生金融工具总额 (投资总成本 610,145,380 美元)		609,500,678	99.82
其他净资产		1,096,989	0.18
截至 2026 年 6 月 30 日总净资产		610,597,667	100.00

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

投资组合变动表 (未经审计)
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日期间

	截至 2026 年 6 月 30 日 持仓占净资产 百分比	截至 2025 年 12 月 31 日 持仓占净资产 百分比
<u>集合投资计划</u>		
香港	0.21	1.60
爱尔兰	1.47	1.39
集合投资计划总计	1.68	2.99
<u>挂牌债券</u>		
澳大利亚	8.35	8.25
百慕大	1.63	1.17
英属维尔京群岛	3.10	0.96
开曼群岛	6.03	6.48
中国内地	10.02	10.91
芬兰	0.41	0.42
法国	2.52	0.76
德国	1.16	0.75
英国	5.22	2.74
香港	5.44	6.22
印度	5.83	5.81
印度尼西亚	4.22	4.83
爱尔兰	0.24	0.24
日本	12.96	12.53
科威特	-	0.17
卢森堡	0.34	0.34
澳门	1.54	2.62
马来西亚	0.74	0.95
毛里求斯	0.15	-
蒙古	0.49	-
墨西哥	-	0.17
荷兰	1.60	0.64
新西兰	0.26	0.32
阿曼	-	0.03
菲律宾	0.61	2.06
卡塔尔	0.07	0.56
沙特阿拉伯	3.69	3.47
新加坡	1.35	1.43
韩国	6.92	5.74
西班牙	0.43	-
超国家	1.10	1.04
瑞典	-	0.20
瑞士	1.16	0.84
台湾	1.07	1.18
泰国	1.81	1.75
土耳其	0.13	0.13
阿联酋	3.49	3.32

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

投资组合变动表(未经审计)(续)
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日期间

	截至 2026 年 6 月 30 日 持仓占净资产 百分比	截至 2025 年 12 月 31 日 持仓占净资产 百分比
<u>挂牌债券(续)</u>		
美国	4.09	4.43
挂牌债券总计	98.17	93.46
总计(集合投资计划及挂牌债券)	99.85	96.45

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

有关金融衍生工具的详情 (未经审计)
截至 2026 年 6 月 30 日止期间

外汇合约

截至 2026 年 6 月 30 日本子基金的未平仓外汇远期和即期合约的详情如下:

待交付合约	交换为	结算日期	交易对手方	公允价值 美元
<u>金融资产</u>				
离岸人民币 127,504,036 元	18,724,434 美元	2026 年 7 月 2 日	香港 上海汇丰银行有限公司	41,614
离岸人民币 35,392,812 元	5,200,000 美元	2026 年 7 月 2 日	香港 上海汇丰银行有限公司	9,115
离岸人民币 6,806,370 元	1,000,000 美元	2026 年 7 月 2 日	香港 上海汇丰银行有限公司	1,762
离岸人民币 27,741 元	4,077 美元	2026 年 7 月 3 日	香港 上海汇丰银行有限公司	6
离岸人民币 23,789,220 元	3,500,000 美元	2026 年 7 月 3 日	香港 上海汇丰银行有限公司	1,298
离岸人民币 1,000 元	147 美元	2026 年 7 月 31 日	香港 上海汇丰银行有限公司	.*
离岸人民币 1,000 元	147 美元	2026 年 7 月 31 日	香港 上海汇丰银行有限公司	.*
				53,795

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

有关金融衍生工具的详情(未经审计)(续)
截至2026年6月30日止期间

外汇合约(续)

待交付合约	交换为	结算日期	交易对手方	公允价值 美元
<u>金融负债</u>				
147 美元	离岸人民币 1,000 元	2026 年 7 月 3 日	香港 上海汇丰银行有限公司	—*
离岸人民币 23,779,035 元	3,500,000 美元	2026 年 7 月 3 日	香港 上海汇丰银行有限公司	201
离岸人民币 5,802 元	857 美元	2026 年 7 月 31 日	香港 上海汇丰银行有限公司	1
2,954 美元	离岸人民币 20,066 元	2026 年 7 月 31 日	香港 上海汇丰银行有限公司	5
18,758,022 美元	离岸人民币 127,504,036 元	2026 年 7 月 31 日	香港 上海汇丰银行有限公司	41,981
4,084 美元	离岸人民币 27,741 元	2026 年 7 月 31 日	香港 上海汇丰银行有限公司	6
离岸人民币 1,504,657,557 元	222,124,462 美元	2026 年 7 月 31 日	香港 上海汇丰银行有限公司	221,961
				264,155
* 表示小于 1				

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

回购协议详情 (未经审计)

(A) 回购协议的公允价值和资产净值百分比

截至 2026 年 6 月 30 日止期间

公允价值	资产净值的百分比
美元	%
25,674,514	4.20%

(B) 回购协议的前 10 大交易对手方

截至 2026 年 6 月 30 日止期间

排名	交易对手方	交易对手方类型	公允价值 美元
1	摩根大通	经纪商	25,674,514

(C) 交易数据

截至 2026 年 6 月 30 日止期间

证券名称	证券 类型	交易对手方	国家	到期日	结算/清算	公允价值 美元	资产 净值的 百分比
CNAC HK Finbridge Co Ltd (Reg) (Reg S) 3% 22/09/2030	挂牌债券	摩根大通	英国	未锁定期限	三方	8,691,700	1.42
Export-Import Bank Korea (Reg) 4.875% 14/01/2030	挂牌债券	摩根大通	英国	未锁定期限	三方	3,139,224	0.51
Petronas Capital Ltd (Ser Regs) (Reg S) 4.95% 03/01/2031	挂牌债券	摩根大通	英国	未锁定期限	三方	1,884,160	0.31
US Treasury 3.625% 31/12/2030	挂牌债券	摩根大通	英国	未锁定期限	三方	3,412,850	0.56
US Treasury 4.375% 31/12/2029	挂牌债券	摩根大通	英国	未锁定期限	三方	8,546,580	1.40

(D) 回购协议产生的收入和支出

截至 2026 年 6 月 30 日止期间

	美元
支出	
直接和间接支出	-
应计利息	64,438

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

业绩表现记录 (未经审计)

2026 年 6 月 30 日

	2026 年 6 月 30 日 美元	2025 年 12 月 31 日 美元	2024 年 12 月 31 日 美元	2023 年 12 月 31 日 美元
净资产				
A 类 (美元) 收益分配份额	110,407	2,401,231	100,275	550
A 类 (港元) 收益分配份额	593,873	799	750	703
A 类 (人民币) 收益分配份额	988	954	898	840
A 类 (人民币对冲) 收益分配份额	867	830	764	760
D 类 (美元) 收益分配份额	6,066,202	14,720	14,731	435,263
D 类 (港元) 收益分配份额	300,956	292,599	316,720	389,469
H 类 (美元) 收益分配份额	-	-	60	55
H 类 (人民币) 收益分配份额	224,322,744	299,001,723	1,755,485	1,663,417
H 类 (人民币对冲) 收益分配份额	205,604,513	141,831,574	7,971	8,873
I 类 (美元) 收益分配份额	27,021,493	139,236,428	11,853,516	13,452,173
I 类 (港元) 收益分配份额	146,575,624	25,456,798	-	-
份额净值				
A 类 (美元) 收益分配份额	64.46	62.23	58.54	55.00
A 类 (港元) 收益分配份额	8.27	7.99	7.50	7.03
A 类 (人民币) 收益分配份额	9.88	9.54	8.97	8.39
A 类 (人民币对冲) 收益分配份额	8.67	8.29	7.64	7.60
D 类 (美元) 收益分配份额	41.33	39.90	37.54	40.73
D 类 (港元) 收益分配份额	56.47	54.52	51.29	50.31
H 类 (美元) 收益分配份额	-	-	6.0535	5.6000
H 类 (人民币) 收益分配份额	9.5362	9.4357	8.6608	8.1266
H 类 (人民币对冲) 收益分配份额	8.1078	7.7590	7.1825	7.1646
I 类 (美元) 收益分配份额	48.61	47.87	46.82	45.73
I 类 (港元) 收益分配份额	13.24	12.77	-	-

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

业绩表现记录(未经审计)(续)

2026 年 6 月 30 日

	最高发行价	最低赎回价
<u>财务期间</u>		
<u>截至 2026 年 6 月 30 日止期间</u>		
A 类(美元)收益分配份额	63.67 美元	62.14 美元
A 类(港元)收益分配份额	64.07 港元	62.41 港元
A 类(人民币)收益分配份额	人民币 67.47 元	人民币 65.63 元
A 类(人民币对冲)收益分配份额	人民币 59.04 元	人民币 57.55 元
D 类(美元)收益分配份额	40.82 美元	39.84 美元
D 类(港元)收益分配份额	437.45 港元	426.33 港元
H 类(人民币)收益分配份额	人民币 65.1456 元	人民币 63.3663 元
H 类(人民币对冲)收益分配份额	人民币 55.3187 元	人民币 53.8774 元
I 类(美元)收益分配份额	49.01 美元	47.82 美元
I 类(港元)收益分配份额	102.58 港元	99.92 港元
<u>截至 2025 年 12 月 31 日止年度</u>		
A 类(美元)收益分配份额	63.03 美元	58.05 美元
A 类(港元)收益分配份额	62.88 港元	57.73 港元
A 类(人民币)收益分配份额	人民币 68.79 元	人民币 64.88 元
A 类(人民币对冲)收益分配份额	人民币 58.92 元	人民币 55.17 元
D 类(美元)收益分配份额	40.42 美元	37.22 美元
D 类(港元)收益分配份额	429.32 港元	394.59 港元
H 类(美元)收益分配份额	6.1979 美元	6.0192 美元
H 类(人民币)收益分配份额	人民币 66.3395 元	人民币 62.6246 元
H 类(人民币对冲)收益分配份额	人民币 55.3238 元	人民币 51.8545 元

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

业绩表现记录(未经审计)(续)
2026 年 6 月 30 日

	最高发行价	最低赎回价
<u>财务期间(续)</u>		
<u>截至 2025 年 12 月 31 日止年度(续)</u>		
I 类(美元)收益分配份额	49.97 美元	46.44 美元
I 类(港元)收益分配份额	100.56 港元	99.81 港元
<u>截至 2024 年 12 月 31 日止年度</u>		
A 类(美元)收益分配份额	59.24 美元	55.32 美元
A 类(港元)收益分配份额	58.98 港元	55.23 港元
A 类(人民币)收益分配份额	人民币 65.84 元	人民币 60.17 元
A 类(人民币对冲)收益分配份额	人民币 56.87 元	人民币 54.18 元
D 类(美元)收益分配份额	41.88 美元	37.13 美元
D 类(港元)收益分配份额	404.50 港元	394.60 港元
H 类(美元)收益分配份额	6.107 美元	5.63 美元
H 类(人民币)收益分配份额	人民币 63.55 元	人民币 58.28 元
H 类(人民币对冲)收益分配份额	人民币 53.52 元	人民币 51.05 元
I 类(美元)收益分配份额	48.35 美元	46.00 美元

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

业绩表现记录(未经审计)(续)

2026 年 6 月 30 日

	最高发行价	最低赎回价
<u>财务期间(续)</u>		
<u>截至 2023 年 12 月 31 日止年度</u>		
A 类(美元)收益分配份额	63.40 美元	51.17 美元
A 类(港元)收益分配份额	63.31 港元	51.31 港元
A 类(人民币)收益分配份额	人民币 66.16 元	人民币 57.03 元
A 类(人民币对冲)收益分配份额	人民币 63.78 元	人民币 50.57 元
D 类(美元)收益分配份额	50.39 美元	38.63 美元
D 类(港元)收益分配份额	490.01 港元	373.92 港元
H 类(美元)收益分配份额	6.401 美元	5.21 美元
H 类(人民币)收益分配份额	人民币 64.22 元	人民币 55.28 元
H 类(人民币对冲)收益分配份额	人民币 63.4195 元	人民币 47.75 元
I 类(美元)收益分配份额	55.04 美元	44.49 美元
<u>截至 2022 年 12 月 31 日止年度</u>		
A 类(美元)收益分配份额	76.63 美元	49.10 美元
A 类(港元)收益分配份额	76.58 港元	49.29 港元
A 类(人民币)收益分配份额	人民币 74.48 元	人民币 52.93 元
A 类(人民币对冲)收益分配份额	人民币 77.27 元	人民币 49.75 元
D 类(美元)收益分配份额	66.30 美元	39.49 美元
D 类(港元)收益分配份额	649.09 港元	386.76 港元
H 类(美元)收益分配份额	7.68 美元	4.95 美元
H 类(人民币)收益分配份额	人民币 72.35 元	人民币 51.40 元
H 类(人民币对冲)收益分配份额	人民币 76.98 元	人民币 49.47 元
I 类(美元)收益分配份额	69.12 美元	44.24 美元

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

业绩表现记录(未经审计)(续)

2026 年 6 月 30 日

	最高发行价	最低赎回价
<u>财务期间(续)</u>		
<u>截至 2021 年 12 月 31 日止年度</u>		
A 类(美元)收益分配份额	101.29 美元	66.69 美元
A 类(港元)收益分配份额	101.20 港元	66.60 港元
A 类(人民币)收益分配份额	人民币 101.16 元	人民币 65.19 元
A 类(人民币对冲)收益分配份额	人民币 101.34 元	人民币 67.05 元
D 类(美元)收益分配份额	96.15 美元	58.69 美元
D 类(港元)收益分配份额	942.63 港元	574.67 港元
H 类(美元)收益分配份额	10.0666 美元	6.6797 美元
H 类(人民币)收益分配份额	人民币 98.3289 元	人民币 63.3212 元
H 类(人民币对冲)收益分配份额	人民币 100.6786 元	人民币 66.8489 元
I 类(美元)收益分配份额	99.49 美元	63.66 美元
<u>截至 2020 年 12 月 31 日止年度</u>		
D 类(美元)收益分配份额	99.76 美元	82.49 美元
D 类(港元)收益分配份额	983.90 港元	811.48 港元
H 类(人民币)收益分配份额	人民币 102.9265 元	人民币 86.3493 元
I 类(美元)收益分配份额	101.37 美元	82.75 美元
<u>截至 2019 年 12 月 31 日止年度</u>		
D 类(美元)收益分配份额	100.30 美元	97.03 美元
D 类(港元)收益分配份额	1,004.24 港元	967.52 港元
H 类(人民币)收益分配份额	人民币 102.0866 元	人民币 99.2788 元
I 类(美元)收益分配份额	99.64 美元	90.80 美元

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

业绩表现记录(未经审计)(续)
2026年6月30日

	最高发行价	最低赎回价
<u>财务期间(续)</u>		
<u>截至2018年12月31日止年度</u>		
A类(港元)收益分配份额	786.98 港元	758.91 港元
I类(美元)收益分配份额	101.48 美元	90.50 美元
<u>截至2017年12月31日止年度</u>		
A类(港元)收益分配份额	805.50 港元	777.66 港元
I类(美元)收益分配份额	104.01 美元	100.79 美元
I类(港元)收益分配份额	802.41 港元	777.01 港元
<u>自2016年5月23日(初始运作日期)起期间</u> <u>2016年12月31日</u>		
A类(港元)收益分配份额	796.12 港元	776.84 港元
I类(美元)收益分配份额	103.24 美元	99.95 美元
I类(港元)收益分配份额	800.47 港元	776.31 港元

海通亚洲总收益债券基金
(海通精选基金系列的子基金)

收益分配披露

基金管理人拟每半年为 I 类份额及每个月为 D 类份额宣派一次本基金的份额的收益分配，并按相关类别货币进行支付。收益分配可以现金支付，或用于申购本基金相关类别的额外份额，由份额持有人自行选择。

<u>截至 2026 年 6 月 30 日止期间</u>				
	除权 日期	支付 日期	每份额 收益分配	收益分配 总额
I 类（美元）收益分配份额				
6 月	2026 年 6 月 30 日	2026 年 7 月 7 日	1 美元	3,014,700 美元

<u>截至 2025 年 6 月 30 日止期间</u>				
	除权 日期	支付 日期	每份额 收益分配	收益分配 总额
I 类（美元）收益分配份额				
6 月	2025 年 6 月 30 日	2025 年 7 月 7 日	0.5 美元	1,015,600 美元