

华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中 基金（FOF） 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 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 2025 年 02 月 18 日（基金合同生效日）起至 2025 年 06 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 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
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	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	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	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	45

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 本报告期投资基金情况	45
7.13 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	53
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.9 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）	
基金主代码	022191	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 2 月 18 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	110,786,464.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝稳健优选三个月持有混合（FOF） A	华宝稳健优选三个月持有混合（FOF） C
下属分级基金的交易代码	022191	022192
报告期末下属分级基金的份额总额	41,844,965.97 份	68,941,498.90 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险和保持资产流动性的前提下，本基金优化配置各类资产，优选全市场各类基金，力争实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济运行状况、货币政策变化、市场利率走势、市场资金供求情况、经济周期等要素的定性与定量分析，预测大类资产未来收益率变化情况，在不同的大类资产之间进行动态调整和优化，以规避市场风险，提高基金收益率。本基金将选择运作合规、风格清晰、中长期收益良好、业绩波动性较低的子基金进行配置，不同基金分类下，通过定量和定性分析，从全市场优选基金进行投资。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×85%+中证偏股型基金指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金（FOF），理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF），低于股票型基金和股票型基金中基金（FOF）。

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		华宝基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周雷	张姗
	联系电话	021-38505888	400-61-95555
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	400-61-95555
传真		021-38505777	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世	深圳市深南大道 7088 号招商银

	纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	行大厦
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世 纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	黄孔威	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	中国（上海）自由贸易试验 区世纪大道 100 号上海环球 金融中心 58 楼

§ 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	2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日） - 2025 年 6 月 30 日	
	华宝稳健优选三个月持有混合 （FOF）A	华宝稳健优选三个月持有混合 （FOF）C
本期已实现收益	84,930.42	-116,748.72
本期利润	390,639.96	615,084.27
加权平均基金份 额本期利润	0.0080	0.0042
本期加权平均净 值利润率	0.80%	0.42%
本期基金份额净 值增长率	0.87%	0.74%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	86,939.07	53,881.25

期末可供分配基金份额利润	0.0021	0.0008
期末基金资产净值	42,209,278.22	69,451,930.36
期末基金份额净值	1.0087	1.0074
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	0.87%	0.74%

- 注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3. 净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。
4. 期末可供分配利润采用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。
5. 本基金合同在当期生效。

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

华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.64%	0.05%	0.82%	0.09%	-0.18%	-0.04%
过去三个月	0.81%	0.07%	1.26%	0.16%	-0.45%	-0.09%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.87%	0.06%	0.20%	0.16%	0.67%	-0.10%

华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）C

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

过去一个月	0.61%	0.05%	0.82%	0.09%	-0.21%	-0.04%
过去三个月	0.72%	0.07%	1.26%	0.16%	-0.54%	-0.09%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	0.74%	0.06%	0.20%	0.16%	0.54%	-0.10%

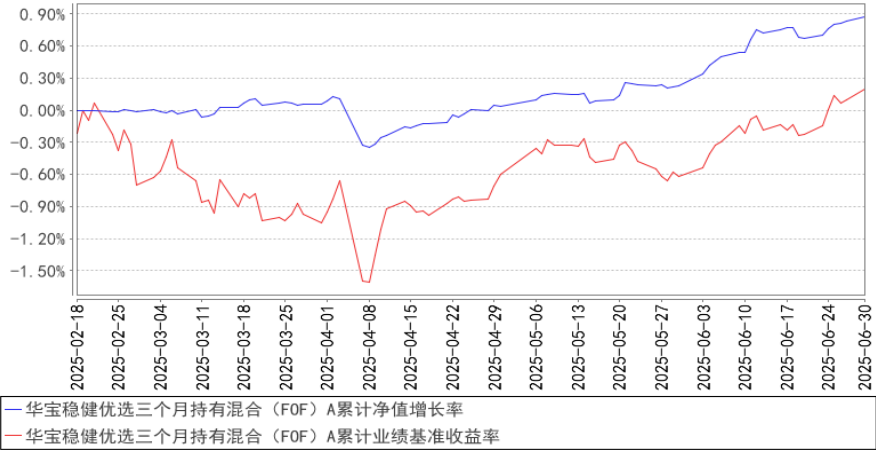
注：（1）基金业绩基准：中债综合全价（总值）指数收益率×85%+中证偏股型基金指数收益率×15%；

（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）；

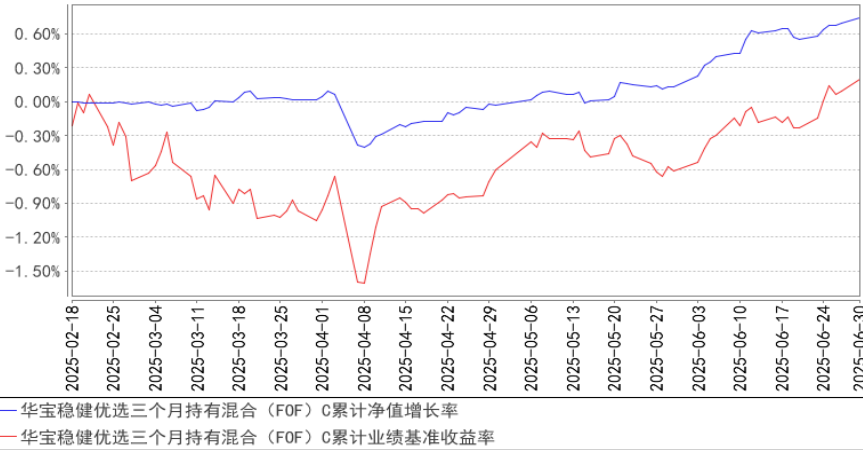
（3）本基金成立于 2025 年 02 月 18 日。

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

华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效于 2025 年 02 月 18 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§ 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

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司。截至本报告期末（2025 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 153 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

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		
李少华	本基金基金经理	2025-02-18	-	9 年	硕士。曾在海富通基金管理有限公司担任助理风险经理。2017 年 11 月加入华宝基金管理有限公司，历任风险分析师、高级分析师、投资经理助理、基金经理助理等职务。2022 年 4 月至 2024 年 9 月任华宝

					稳健目标风险三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理，2025 年 2 月起任华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、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。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 1 次，系指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

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

随着年初国内科技线的爆发及 4 月贸易战的突然升温，上半年权益市场走势跌宕起伏。风险偏好自年初大幅上升后，在贸易战前后来到了冰点，全球市场也迎来巨大回调。然而在风险释放后整体市场又悄悄走出强势修复，半年末全球多数权益市场都来到了半年内的相对高点。同期国内债券市场在连续两年大牛市的背景下，1 季度出现显著回调，但在 2 季度资产荒预期下又悄然上涨，债券利率再次回到相对低位。市场的变化始终类似一个钟摆，在做多情绪亢奋时回摆，在恐慌中孕育着新一轮向上的希望。

本产品于今年 2 月份成立，产品在 1 季度末留有较多类现金资产等待加仓机会，突发的风险事件将市场带入一个情绪冰点，同时也给了我们很好的上车机会，产品按计划进行了加仓，目前产品股债商 3 大类资产都已达到对应的风险分配比例。产品自运作以来最大回撤暂未超过 0.5%，产品会尽可能缩短净值创新高时间，降低波动，提升投资者的持有体验。

产品目前持有包括中债、美债、国内权益、海外权益、黄金、豆粕、有色在内的多种资产，后续在战略上会继续按照风险平价的方式对股债商进行均衡配置，战术上择机在市场给予机会时进行调整已实现可能的收益增强，基金选择以多因子量化选基为主，持续发现在对应赛道内拥有稳定超额的基金产品，力争为投资者带来确定性较高的收益体验。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为 0.87%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 0.74%；同期业绩比较基准收益率为 0.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年末国内权益和债券市场都来到了一个相对高点，经济基本面的恢复是最终决定市场上下下的关键因素，目前来看两种资产风险偏好的共同提升在接下来的一段时间可能发生松动，我们需要持续关注货币和财政的政策是否会超预期。全球市场在贸易战缓和后出现大幅反弹，风险偏好同样来到相对高位，后续需重点关注美股科技股走势，其对全球整个 AI 产业细分链均有较大影响。美联储降息的预期也影响着美债收益率的表现，虽然目前通胀有所回落，但若贸易战再次发酵，通胀的反复可能成为美联储降息的掣肘，高企的美债利率也会成为压制风险偏好的重要原因。

我们的产品会始终坚持多元资产配置，以风险为锚，在实现股债商 3 大类资产风险均衡的背景下，将资金均衡分配在海外权益、国内权益、美债、中债及商品 5 个细分方向，用均衡的配置

来面对多变的市場，从而实现稳定的基金业绩表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	6,152,964.84
结算备付金		1,156,039.52
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	105,958,438.61
其中：股票投资		—
基金投资		99,679,662.94
债券投资		6,278,775.67
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		—
其中：债券投资		—
资产支持证券投资		—
其他投资		—
其他债权投资		—
其他权益工具投资		—
应收清算款		1,477,296.55
应收股利		—
应收申购款		50.00
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.5	—
资产总计		114,744,789.52

负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 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		2,948,441.94
应付管理人报酬		36,926.29
应付托管费		12,781.85
应付销售服务费		21,761.84
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	63,669.02
负债合计		3,083,580.94
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	110,786,464.87
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	874,743.71
净资产合计		111,661,208.58
负债和净资产总计		114,744,789.52

注：1. 本基金合同生效日为 2025 年 02 月 18 日，本报告期自基金合同生效日 2025 年 02 月 18 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

2. 报告截止日 2025 年 06 月 30 日, 基金份额总额 110,786,464.87 份, 其中华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）A 基金份额总额 41,844,965.97 份, 基金份额净值 1.0087 元；华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）C 基金份额总额 68,941,498.90 份, 基金份额净值 1.0074 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,640,952.67
1. 利息收入		249,735.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	130,065.07

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		119,670.35
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		328,864.40
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益	6.4.7.11	41,186.57
债券投资收益	6.4.7.12	51,828.88
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	235,848.95
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,037,542.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	24,810.32
减：二、营业总支出		635,228.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	279,842.14
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	98,864.67
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	186,310.00
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	6.4.7.20	-
7. 税金及附加		4.76
8. 其他费用	6.4.7.21	70,206.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,005,724.23
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,005,724.23
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,005,724.23

注：本产品成立于 2025 年 02 月 18 日，故无上年度可比期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	228,455,532.41	-	-	228,455,532.41
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 117,669,067.54	-	874,743.71	-116,794,323.83
（一）、综合收益总额	-	-	1,005,724.23	1,005,724.23
（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）	- 117,669,067.54	-	-130,980.52	-117,800,048.06
其中：1. 基金申购款	259,876.72	-	459.97	260,336.69
2. 基金赎回款	- 117,928,944.26	-	-131,440.49	-118,060,384.75
（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	110,786,464.87	-	874,743.71	111,661,208.58

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：

向辉

李孟恒

张幸骏

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

华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”[2024]1240 号文《关于准予华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》的准予注册，由华宝基金管理有限公司于 2025 年 2 月 5 日至 2025 年 2 月 14 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2024）验字第 70072895_B03 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2025 年 2 月 18 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 228,419,930.38 元，其中，A 类基金份额的净认购金额为人民币 50,764,702.06 元；C 类基金份额的净认购金额为人民币 177,655,228.32 元。在募集期间产生利息共计人民币 35,602.03 元，其中 A 类基金份额的有效认购资金在初始销售期内产生的利息为人民币 6,473.48 元；C 类基金份额的有效认购资金在初始募集期内产生的利息为人民币 29,128.55 元。以上收到的实收资金（本息）共计人民币 228,455,532.41 元，折合 228,455,532.41 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构为华宝基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含 QDII 基金、商品基金和香港互认基金）、股票（包括创业板、存托凭证以及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中期票据、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于股票、股票型基金和混合型基金等权益类资产占基金资产的比例为 0%-30%；投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不得超过基金资产的 20%；投资于商品基金（含商品期货基金和

黄金 ETF）的比例不得超过基金资产的 10%；投资于货币市场基金的比例不得超过基金资产的 15%。本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：（1）基金合同中明确约定投资股票资产占基金资产的比例不低于 60%的混合型基金；（2）最近连续 4 个季度披露的基金定期报告中显示股票投资占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率 \times 85%+中证偏股型基金指数收益率 \times 15%

本财务报表已于 2025 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

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、应用指南、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颁布的《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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》、《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颁布的其他相关规定。

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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第

二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的

有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（4）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（5）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（6）公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

（7）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人持有的基金份额（原份额）所获得的红利再投资份额的持有期，按照原份额的持有期计算；

（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（4）本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，但由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

（5）法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- （2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- （3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

（2）增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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。

（4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（6）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	6,152,964.84
等于：本金	6,152,457.07
加：应计利息	507.77
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	6,152,964.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 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	6,194,780.77	78,775.67	6,278,775.67	5,219.23
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,194,780.77	78,775.67	6,278,775.67	5,219.23
资产支持证券		-	-	-	-
基金		98,647,339.64	-	99,679,662.94	1,032,323.30
其他		-	-	-	-
合计		104,842,120.41	78,775.67	105,958,438.61	1,037,542.53

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	734.75
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	-
预提费用	62,934.27
合计	63,669.02

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）A

项目	本期 2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	50,771,175.54	50,771,175.54
本期申购	43,976.27	43,976.27
本期赎回（以“-”号填列）	-8,970,185.84	-8,970,185.84
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	41,844,965.97	41,844,965.97

华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）C

项目	本期 2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	177,684,356.87	177,684,356.87
本期申购	215,900.45	215,900.45
本期赎回（以“-”号填列）	-108,958,758.42	-108,958,758.42
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	68,941,498.90	68,941,498.90

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	84,930.42	305,709.54	390,639.96
本期基金份额交易产生的变动数	2,008.65	-28,336.36	-26,327.71
其中：基金申购款	6.61	105.67	112.28
基金赎回款	2,002.04	-28,442.03	-26,439.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	86,939.07	277,373.18	364,312.25

华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-116,748.72	731,832.99	615,084.27
本期基金份额交易产生的变动数	170,629.97	-275,282.78	-104,652.81
其中：基金申购款	-122.83	470.52	347.69
基金赎回款	170,752.80	-275,753.30	-105,000.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,881.25	456,550.21	510,431.46

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,685.32
定期存款利息收入	105,044.44
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,335.31
其他	-
合计	130,065.07

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

无。

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	153,477,739.51
减：卖出/赎回基金成本总额	153,372,461.20
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	64,091.74
基金投资收益	41,186.57

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年2月18日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	47,480.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,348.10
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	51,828.88

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年2月18日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,573,236.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,494,528.23
减：应计利息总额	74,166.57

减：交易费用	193.67
买卖债券差价收入	4,348.10

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	235,848.95
合计	235,848.95

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,037,542.53
股票投资	-
债券投资	5,219.23
资产支持证券投资	-
基金投资	1,032,323.30

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	1,037,542.53

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	22,491.98
销售服务费返还	2,318.34
合计	24,810.32

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

6.4.7.19 持有基金产生的费用

项目	本期 2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	12,623.04
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	222,636.01
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	60,583.10

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费及托管费等进行的估算，上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	20,978.09
信息披露费	41,956.18
证券出借违约金	-
银行费用	6,872.60
其他	400.00
合计	70,206.87

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司（“华宝基金”）	基金管理人, 注册登记机构, 基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人, 基金销售机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management.L.P.)	基金管理人的股东
江苏省铁路集团有限公司（“江苏铁集”）	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司, 基金销售机构
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司（“宝武财务”）	受宝武集团控制的公司
华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF)	本基金的基金管理人管理的其他基金
华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	本基金的基金管理人管理的其他基金
华宝中短债债券型发起式证券投资基金	本基金的基金管理人管理的其他基金
华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金 (LOF)	本基金的基金管理人管理的其他基金
华宝中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金	本基金的基金管理人管理的其他基金
华宝现金宝货币市场基金	本基金的基金管理人管理的其他基金
华宝宝通 30 天持有期短债债券型证券投资基金	本基金的基金管理人管理的其他基金
华宝宝泓纯债债券型证券投资基金	本基金的基金管理人管理的其他基金
华宝现金添益交易型货币市场基金	本基金的基金管理人管理的其他基金
华宝宝康债券投资基金	本基金的基金管理人管理的其他基金
华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 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
	2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	279,842.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	191,866.65
应支付基金管理人的净管理费	87,975.49

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中持有的基金管理人自身管理的基金部分所对应资产净值后剩余部分的（若为负数，则取 0）0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.6\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金财产中持有的基金管理人自身管理的基金部分所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	98,864.67

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中持有的基金托管人自身托管的基金部分所对应资产净值后剩余部分的（若为负数，则取 0）0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金财产中持有的基金托管人自身托管的基金部分所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）A	华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）C	合计
华宝基金	-	-	-
招商银行	-	113,966.81	113,966.81
合计	-	113,966.81	113,966.81

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.35%年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H=E\times 0.35\%\div \text{当年天数}$ ，H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期内无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人外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 2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	6,152,964.84	20,685.32

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本期末，本基金持有基金管理人及管理人关联方所管理的基金合计人民币 40,464,117.26 元，

占本基金资产净值的比例为 36.24%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期 2025 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
当期交易基金产生的申购费（元）		-
当期交易基金产生的赎回费（元）		-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）		2,318.34
当期持有基金产生的应支付管理费（元）		75,816.98
当期持有基金产生的应支付托管费（元）		22,142.57
当期交易基金产生的交易费（元）		2,399.25

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。根据相关法律法规及本基金的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金是一只主动投资的混合型基金中基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风

险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在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，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金净资产的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险。

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可随时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。于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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期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。

本基金持有单只基金的市值，不得高于本基金资产净值的 20%，本基金管理人管理的全部基金中基金（除 ETF 联接基金外）持有单只基金不得超过被投资基金净资产的 20%（被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准）；本基金投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金的，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%。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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持证券均在证券交易所上市，或可在场外赎回。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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%。

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。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或可在场外赎回，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

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；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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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未来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。 本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	6,152,964.84	-	-	-	6,152,964.84
结算备付金	1,156,039.52	-	-	-	1,156,039.52
交易性金融资产	6,278,775.67	-	-	99,679,662.94	105,958,438.61
应收申购款	-	-	-	50.00	50.00
应收清算款	-	-	-	1,477,296.55	1,477,296.55
资产总计	13,587,780.03	-	-	101,157,009.49	114,744,789.52
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,948,441.94	2,948,441.94
应付管理人报酬	-	-	-	36,926.29	36,926.29
应付托管费	-	-	-	12,781.85	12,781.85
应付销售服务费	-	-	-	21,761.84	21,761.84
其他负债	-	-	-	63,669.02	63,669.02
负债总计	-	-	-	3,083,580.94	3,083,580.94
利率敏感度缺口	13,587,780.03	-	-	98,073,428.55	111,661,208.58

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有交易性债券投资比例较低，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个基金、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，采用“自上而下和自下而上相结合”的策略，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，做出资产配置及投资组合构建的策略；通过对单个基金、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。

本基金投资于证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于股票、股票型基金和混合

型基金等权益类资产占基金资产的比例为 0%-30%；投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不得超过基金资产的 20%；投资于商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）的比例不得超过基金资产的 10%；投资于货币市场基金的比例不得超过基金资产的 15%。本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。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来测试本基金面临的潜在价格风险，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	-	-
交易性金融资产—基金投资	99,679,662.94	89.27
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	99,679,662.94	89.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于报告期末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	99,679,662.94
第二层次	6,278,775.67
第三层次	—
合计	105,958,438.61

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关证券等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，确定相关证券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

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	99,679,662.94	86.87
3	固定收益投资	6,278,775.67	5.47
	其中：债券	6,278,775.67	5.47
	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	7,309,004.36	6.37
8	其他各项资产	1,477,346.55	1.29
9	合计	114,744,789.52	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内无股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内无股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无股票投资。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,278,775.67	5.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	6,278,775.67	5.62
----	----	--------------	------

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	019749	24 国债 15	62,000	6,278,775.67	5.62

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为混合型基金中基金，由于本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额，持有基金的预期风险和预期收益间接成为本基金的预期风险和预期收益。本基金的预期风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。本基金为采用目标风险策略的基金中基金，风险收益特征相对稳健，长期资产配置以非权益类资产为主，权益类资产为辅。本基金以可投资产的风险收益特征、估值盈利数据、市场容量和流动性等指标为基础，根据基金管理人的资产配置和风险预算模型，自上而下的评估不同资产以及资产内部主要行业及板块的潜在风险收益表现，目标是筛选出预计风险调整后收益较好的资产及行业板块。将优选风险调整后收益较好的资产及行业板块进行配置，在风险目标范围内，根据市场变化动态分配权益类、非权益类和现金类等资产的风险权重，以及权益类资产内部的 A 股、港股和其他境外市场的风险权重。子基金选择主要

根据多因子量化选基模型，选择在特定赛道内超额收益显著且稳定的标的，同时将选择运作合规、风格清晰、中长期收益良好、业绩波动性较低的基金进行配置。最终通过多元资产配置来分散风险以及优选底层子基金来获取组合内的超额收益，在严格控制投资风险和保障资产流动性的前提下，争取提供稳定及可持续的收益回报。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	006947	华宝中短债债券 A	契约型开放式	12,000,000.00	14,396,400.00	12.89	是
2	017100	华宝宝通 30 天持有期短债 A	契约型开放式	10,000,000.00	10,759,000.00	9.64	是
3	000103	国泰中国企业境外高收益债券 (QDII)	契约型开放式	10,440,284.54	8,029,622.84	7.19	否
4	002245	泰康稳健增利债券 A	契约型开放式	4,563,051.44	6,579,463.87	5.89	否
5	240003	华宝宝康债券	契约型开放式	4,500,000.00	5,791,500.00	5.19	是
6	004998	长信全球债券 (QDII) 人民币份额	契约型开放式	3,997,764.18	5,062,368.78	4.53	否
7	009306	平安惠铭纯债	契约型开放式	4,668,440.60	4,957,417.07	4.44	否
8	006513	鹏扬淳享债券 A	契约型开放式	4,786,919.70	4,944,409.36	4.43	否

9	009947	华宝宝泓债券	契约 型开 放式	4,000,000.00	4,379,200.00	3.92	是
10	009757	华宝 1-3 年国 开债指数 A	契约 型开 放式	4,000,000.00	4,249,600.00	3.81	是
11	014484	汇添富中债 1-3 年隐含评 级 AA+及以上 信用债指数发 起式 A	契约 型开 放式	3,300,000.00	3,606,240.00	3.23	否
12	002400	南方亚洲美元 收益债券 (QDII)A(人民 币)	契约 型开 放式	2,343,595.20	2,427,261.55	2.17	否
13	005159	华泰保兴尊合 债券 A	契约 型开 放式	1,635,571.75	2,061,638.19	1.85	否
14	020002	国泰金龙债券 A	契约 型开 放式	1,748,485.84	2,056,219.35	1.84	否
15	159980	有色 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	1,154,100.00	1,972,356.90	1.77	否
16	159937	黄金 9999	交易 型开 放式 (ETF)	247,200.00	1,805,796.00	1.62	否
17	518680	富国上海金 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	211,877.00	1,615,774.00	1.45	否
18	001564	东方红京东大 数据混合 A	契约 型开 放式	531,882.80	1,599,903.46	1.43	否

19	005160	华泰保兴尊合债券 C	契约 型开 放式	1,236,531.06	1,535,524.27	1.38	否
20	159985	豆粕 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	749,100.00	1,442,017.50	1.29	否
21	511090	鹏扬中债-30 年期国债 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	8,400.00	1,043,834.40	0.93	否
22	518880	华安黄金易 (ETF)	交易 型开 放式 (ETF)	138,600.00	1,013,720.40	0.91	否
23	002246	泰康稳健增利 债券 C	契约 型开 放式	570,410.12	892,406.63	0.80	否
24	004716	中信保诚量化 阿尔法股票 A	契约 型开 放式	520,496.80	844,401.96	0.76	否
25	162411	华宝油气	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,055,800.00	751,412.86	0.67	是
26	000573	天弘通利混合 A	契约 型开 放式	251,468.33	566,055.21	0.51	否
27	004194	招商中证 1000 指数增 强 A	契约 型开 放式	300,000.00	517,830.00	0.46	否
28	004419	汇添富美元债 债券(QDII)人 民币 A	契约 型开 放式	478,856.67	509,216.18	0.46	否
29	020012	国泰金龙债券	契约	435,746.61	483,765.89	0.43	否

		C	型开 放式				
30	159920	恒生 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	276,100.00	409,732.40	0.37	否
31	513880	华安日经 225ETF	交易 型开 放式 (ETF)	266,600.00	385,770.20	0.35	否
32	159561	德国 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	267,500.00	369,417.50	0.33	否
33	006373	国富全球科技 互联混合 (QDII)人民币 A	契约 型开 放式	79,914.51	306,352.27	0.27	否
34	513080	华安法国 CAC40ETF	交易 型开 放式 (ETF)	167,000.00	287,407.00	0.26	否
35	008764	天弘越南市场 股票发起 (QDII)C	契约 型开 放式	200,000.00	282,220.00	0.25	否
36	513650	南方标普 500ETF(QDII)	交易 型开 放式 (ETF)	147,000.00	234,759.00	0.21	否
37	513110	纳指 100	契约 型开 放式	115,400.00	216,028.80	0.19	否
38	002286	中银美元债债 券(QDII)人民 币 A	契约 型开 放式	163,038.28	201,825.09	0.18	否
39	159792	互联网	交易	207,000.00	183,195.00	0.16	否

			型开 放式 (ETF)				
40	006105	宏利印度股票 (QDII)	契约 型开 放式	110,798.45	171,892.72	0.15	否
41	019480	博时亚洲票息 收益债券 C 人 民币	契约 型开 放式	100,000.00	147,950.00	0.13	否
42	162415	美国消费	上市 契约 型开 放式 (LOF)	48,292.00	137,004.40	0.12	是
43	004512	海富通沪深 300 增强 C	契约 型开 放式	100,000.00	128,240.00	0.11	否
44	165531	中信保诚多策 略混合 (LOF) A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	54,485.55	108,960.20	0.10	否
45	008751	大成全球美元 债 A 人民币	契约 型开 放式	99,859.65	106,220.71	0.10	否
46	001917	招商量化精选 股票发起式 A	契约 型开 放式	22,860.54	65,886.36	0.06	否
47	003385	工银全球美元 债 A 类人民币	契约 型开 放式	18,528.64	20,253.66	0.02	否
48	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	交易 型开 放式 (ETF)	3,300.00	13,140.60	0.01	否
49	007360	易方达中短期	契约	7,537.57	9,050.36	0.01	否

		美元债债券 (QDII)A(人民币 份额)	型开 放式				
--	--	-----------------------------	----------	--	--	--	--

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.13.3 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	1,477,296.55
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	50.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,477,346.55

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 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投资。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 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

份额级别	持有人 户数	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
华宝稳健 优选三个 月持有混 合（FOF） A	289	144,792.27	6,493,080.15	15.52	35,351,885.82	84.48
华宝稳健 优选三个 月持有混 合（FOF） C	370	186,328.38	500,000.00	0.73	68,441,498.90	99.27
合计	659	168,113.00	6,993,080.15	6.31	103,793,384.72	93.69

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）A	1,015,804.58	2.4275
	华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）C	0.00	0.0000
	合计	1,015,804.58	0.9169

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	份额级别	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	华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）A	0
	华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）A	50~100
	华宝稳健优选三个月持有混合（FOF）C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝稳健优选三个月持有混合	华宝稳健优选三个月持有混合
----	---------------	---------------

	（FOF）A	（FOF）C
基金合同生效日 （2025 年 2 月 18 日）基金份额总额	50,771,175.54	177,684,356.87
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	43,976.27	215,900.45
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	8,970,185.84	108,958,758.42
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	41,844,965.97	68,941,498.90

注：本基金合同生效日于 2025 年 02 月 18 日。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2025 年 1 月 9 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任吕笑然为公司副总经理。

2025 年 6 月 27 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，吕笑然不再担任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告

期末。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
国泰海通	2	-	-	41,711.70	100.00	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准: 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

（2）选择程序: 根据证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》和公司《公募基金及私募资产管理计划专用交易席位管理办法》的要求，公司与符合前述标准的证券公司，签订《证券交易单元租用协议》，参与证券交易。

2、本报告期租用的证券公司交易单元均为新增。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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

		(%)		比例 (%)		(%)		(%)
国泰海通	19,368, 007.03	100.00	340,001 ,000.00	100.00	-	-	118,657 ,907.39	100.00

10.9 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	华宝稳健优选三个月持有期混合型 基金中基金（FOF）（A 类份额）基金 产品资料概要	基金管理人网站	2025-01-16
2	华宝稳健优选三个月持有期混合型 基金中基金（FOF）（C 类份额）基金 产品资料概要	基金管理人网站	2025-01-16
3	华宝稳健优选三个月持有期混合型 基金中基金（FOF）基金份额发售公 告	基金管理人网站, 证券 时报	2025-01-16
4	华宝稳健优选三个月持有期混合型 基金中基金（FOF）基金合同	基金管理人网站	2025-01-16
5	华宝稳健优选三个月持有期混合型 基金中基金（FOF）基金合同及招募 说明书提示性公告	证券时报	2025-01-16
6	华宝稳健优选三个月持有期混合型 基金中基金（FOF）托管协议	基金管理人网站	2025-01-16
7	华宝稳健优选三个月持有期混合型 基金中基金（FOF）招募说明书	基金管理人网站	2025-01-16
8	华宝基金关于华宝稳健优选三个月 持有期混合型基金中基金（FOF）新 增代销机构的公告	基金管理人网站, 证券 时报	2025-01-27
9	华宝基金管理有限公司关于华宝稳 健优选三个月持有期混合型基金中 基金（FOF）提前结束募集的公告	基金管理人网站, 证券 时报	2025-02-14
10	华宝稳健优选三个月持有期混合型 基金中基金（FOF）基金合同生效公 告	基金管理人网站, 证券 时报	2025-02-19
11	华宝基金关于旗下部分基金新增英 大证券有限责任公司为代销机构的 公告	基金管理人网站, 上海 证券报, 证券日报, 证 券时报, 中国证券报	2025-02-26
12	华宝稳健优选三个月持有期混合型 基金中基金（FOF）开放日常申购、 赎回、定期定额投资业务的公告	基金管理人网站, 证券 时报	2025-03-11
13	华宝基金管理有限公司关于旗下基 金持有的股票停牌后估值方法调整 的公告	基金管理人网站, 上海 证券报, 证券日报, 证 券时报, 中国证券报	2025-04-22
14	华宝基金管理有限公司旗下部分基 金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日 报, 证券时报, 中国证	2025-04-22

		券报	
15	华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）2025 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2025-04-22

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20250218~20250519	0.00	50,007,500.00	50,007,500.00	0.00	0.00
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。 在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同；
华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书；
华宝稳健优选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各项

种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日