

华宝宝通 30 天持有期短债债券型证券投资  
基金  
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 华宝宝通 30 天持有期短债   |
| 基金主代码      | 017100   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2022 年 12 月 9 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 2,620,821,479.37 份   |
| 投资目标       | 在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，重点投资短期债券资产，追求基金资产的稳健增值。  |
| 投资策略       | 本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主动式投资管理理念，采用价值分析方法，在分析和判断财政、货币、利率、通货膨胀等宏观经济运行指标的基础上，自上而下确定大类资产投资比例和债券的组合目标久期、期限结构配置及类属配置；同时，采用“自下而上”的投资理念，在研究分析信用风险、流动性风险、供求关系、收益率水平、税收水平等因素基础上，自下而上的精选个券，把握固定收益类金融工具投资机会。 |

|                 |   |                  |
|-----------------|---|------------------|
| 业绩比较基准          | 中债综合财富（1 年以下）指数收益率×80%+一年期定期存款基准利率(税后)×20%  |                  |
| 风险收益特征          | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。 |                  |
| 基金管理人           | 华宝基金管理有限公司                                  |                  |
| 基金托管人           | 宁波银行股份有限公司                                  |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 华宝宝通 30 天持有期短债 A                            | 华宝宝通 30 天持有期短债 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 017100                                      | 017101           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,518,117,783.81 份                          | 102,703,695.56 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日） |                  |
|-----------------|-------------------------------------|------------------|
|                 | 华宝宝通 30 天持有期短债 A                    | 华宝宝通 30 天持有期短债 C |
| 1. 本期已实现收益      | 15,483,236.38                       | 779,594.55       |
| 2. 本期利润         | 11,820,775.12                       | 679,253.56       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0049                              | 0.0051           |
| 4. 期末基金资产净值     | 2,589,370,631.94                    | 105,443,439.21   |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0283                              | 1.0267           |

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。

#### 3.2 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

华宝宝通 30 天持有期短债 A

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

|                |       |       |       | 准差④   |       |       |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 过去三个月          | 0.53% | 0.01% | 0.41% | 0.01% | 0.12% | 0.00% |
| 过去六个月          | 1.61% | 0.01% | 1.09% | 0.01% | 0.52% | 0.00% |
| 过去一年           | -     | -     | -     | -     | -     | -     |
| 过去三年           | -     | -     | -     | -     | -     | -     |
| 过去五年           | -     | -     | -     | -     | -     | -     |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 2.83% | 0.01% | 1.91% | 0.01% | 0.92% | 0.00% |

华宝宝通 30 天持有期短债 C

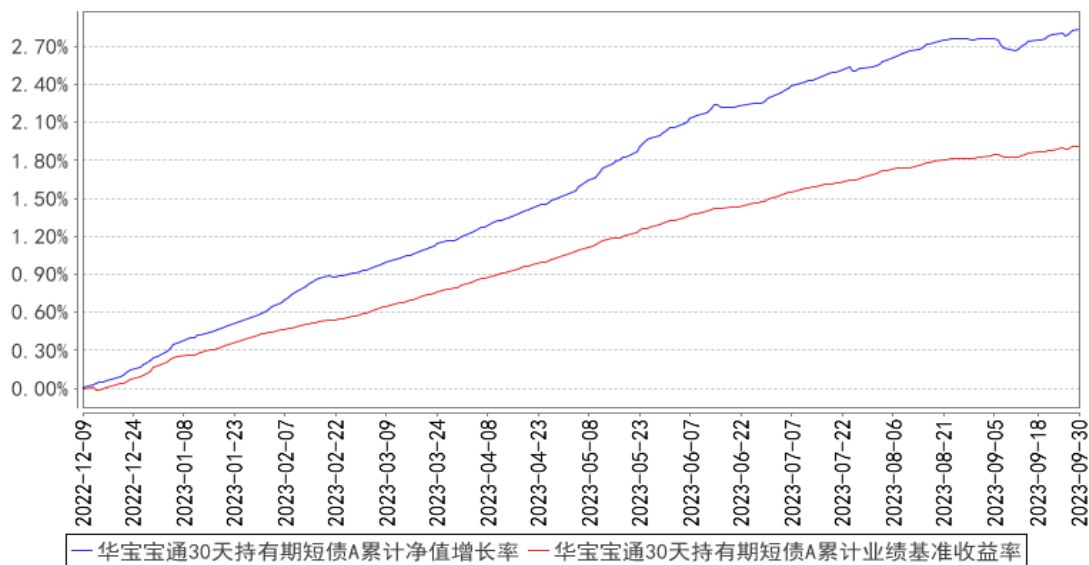
| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④   |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月          | 0.48%  | 0.01%         | 0.41%          | 0.01%                 | 0.07% | 0.00% |
| 过去六个月          | 1.51%  | 0.01%         | 1.09%          | 0.01%                 | 0.42% | 0.00% |
| 过去一年           | -      | -             | -              | -                     | -     | -     |
| 过去三年           | -      | -             | -              | -                     | -     | -     |
| 过去五年           | -      | -             | -              | -                     | -     | -     |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 2.67%  | 0.01%         | 1.91%          | 0.01%                 | 0.76% | 0.00% |

注：（1）基金业绩基准：中债综合财富（1 年以下）指数收益率×80%+一年期定期存款基准利率（税后）×20%；

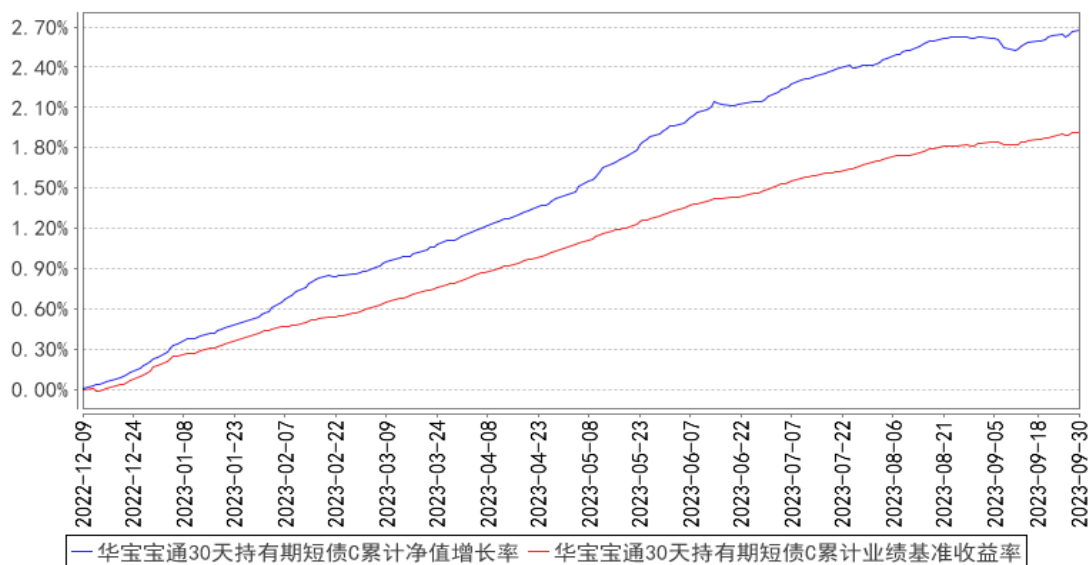
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华宝宝通30天持有期短债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图



华宝宝通30天持有期短债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图



注：1、本基金基金合同生效于 2022 年 12 月 09 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 2023 年 06 月 09 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务      | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                      |
|-----|---------|-------------|------|--------|---|
|     |         | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 厉卓然 | 本基金基金经理 | 2022-12-09  | -    | 10 年   | 硕士。曾在华宸未来基金管理有限公司担任产品经理。2014 年 9 月加入华宝基 |

|     |                   |            |   |      |  |
|-----|-------------------|------------|---|------|--|
|     |                   |            |   |      | 金管理有限公司，先后担任交易员、高级交易员、基金经理助理等职务。2021年3月起任华宝现金宝货币市场基金基金经理，2022年6月起任华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理，2022年12月起任华宝宝通 30 天持有期短债债券型证券投资基金基金经理。                                    |
| 蒋文玲 | 本基金基金经理、混合资产部副总经理 | 2023-01-20 | - | 17 年 | 硕士。曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员，浦银安盛基金基金经理，汇添富基金金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理、固定收益部基金经理。2022年7月加入华宝基金管理有限公司任高级产品经理，现任混合资产部副总经理。2023年1月起任华宝宝通 30 天持有期短债债券型证券投资基金基金经理，2023年2月起任华宝现金宝货币市场基金基金经理。 |

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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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合规守信情况的说明

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、《华宝宝通 30 天持有期短债债券型证券投资基金基金合同》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 公平交易专项说明

##### 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 3 次，均为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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度国内经济呈现触底弱反弹格局，通胀、出口和消费均有所上行，其中消费受益于暑期出行和个体消费逐步恢复，通胀年内不具备继续下行的风险，出口压力仍存。制造业和基建仍然是拉动投资增长的主力，房地产仍然是拖累项，随着“认房不认贷”、降低首付比例等一系列放松政策出台，后续仍有改善空间。信贷和社融数据超出市场预期，但是从结构上以短贷冲量为主，总体来看“经济底”已经探明，复苏力度仍需要进一步的政策呵护。

3 季度政策基调强调促进经济发展和逆周期调节，以及风险防范。一方面，地方政府城投平台的债务化解进入实质性推进阶段，特殊再融资债的方案和发行已经逐步落地，专项债的发行也在本季度内全部完成，对于 4 季度的实物工作量形成起到较好的配套作用。另一方面，货币政策维持流动性宽裕的基调，分别在 8-9 月份进行了一次降准和降息。

报告期内债市呈现利好出尽、收益先下后上的走势，7-8 月份收益率持续下行，降息落地后有所调整，9 月份在汇率压力、资金面紧张、赎回导致的小型负反馈作用下持续上行，整体来看较上一季度普遍上行 5-20BP，短端上行幅度较大，收益率曲线进一步平坦化。

本基金在报告期内进行了波段操作，并在降息之后减仓，以控制净值回撤，以及防范赎回造成的流动性风险，9 月末考虑到跨季资金价格过高，同步降低了杠杆比例。

#### 4.5 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 0.53%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 0.48%；同期业绩比较基准收益率为 0.41%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -            |
|    | 其中：股票             | -                | -            |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 2,856,904,042.52 | 99.58        |
|    | 其中：债券             | 2,856,904,042.52 | 99.58        |
|    | 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      | 962,435.42       | 0.03         |
| 8  | 其他资产              | 11,140,179.00    | 0.39         |
| 9  | 合计                | 2,869,006,656.94 | 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）。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票投资。

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券 | 10,137,627.40  | 0.38         |
| 2  | 央行票据 | -              | -            |
| 3  | 金融债券 | 142,383,178.08 | 5.28         |



|    |           |                  |        |
|----|-----------|------------------|--------|
|    | 其中：政策性金融债 | 142,383,178.08   | 5.28   |
| 4  | 企业债券      | -                | -      |
| 5  | 企业短期融资券   | 1,123,869,487.99 | 41.70  |
| 6  | 中期票据      | 1,580,513,749.05 | 58.65  |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -      |
| 8  | 同业存单      | -                | -      |
| 9  | 其他        | -                | -      |
| 10 | 合计        | 2,856,904,042.52 | 106.01 |

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称              | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 101901368 | 19 蚌埠城投<br>MTN001 | 800,000 | 82,310,575.34 | 3.05         |
| 2  | 220308    | 22 进出 08          | 800,000 | 81,320,767.12 | 3.02         |
| 3  | 101900837 | 19 常德城投<br>MTN001 | 700,000 | 72,234,950.82 | 2.68         |
| 4  | 012383119 | 23 常德城投<br>SCP002 | 700,000 | 70,077,038.25 | 2.60         |
| 5  | 220411    | 22 农发 11          | 600,000 | 61,062,410.96 | 2.27         |

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

#### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

#### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 7,993.12      |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 11,132,185.88 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 11,140,179.00 |

### 5.10.4 报告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。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.10.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 华宝宝通 30 天持有期短债 A | 华宝宝通 30 天持有期短债 C |
|---------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,166,847,597.32 | 152,800,084.60   |
| 报告期期间基金总申购份额              | 3,294,441,358.05 | 53,809,261.87    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 1,943,171,171.56 | 103,905,650.91   |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                | -                |

|             |                  |                |
|-------------|------------------|----------------|
| 报告期期末基金份额总额 | 2,518,117,783.81 | 102,703,695.56 |
|-------------|------------------|----------------|

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
 华宝宝通 30 天持有期短债债券型证券投资基金基金合同；  
 华宝宝通 30 天持有期短债债券型证券投资基金招募说明书；  
 华宝宝通 30 天持有期短债债券型证券投资基金托管协议；  
 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。

### 9.2 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。

### 9.3 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种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2023 年 10 月 25 日