

华宝积极配置三个月持有期混合型基金中
基金（FOF）
2024 年第 2 季度报告

2024 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 19 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 月 17 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 2024 年 04 月 23 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝积极配置三个月持有混合（FOF）
基金主代码	020311
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 4 月 23 日
报告期末基金份额总额	454,726,007.53 份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的资产配置和基金精选，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，对股票、债券、基金和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整。（1）构建备选子基金池：依托专业的研究力量，建立基金综合评价体系，通过基金管理人自研的基金经理评价模型，选择一批选股能力优秀的基金经理，作为后期尽调备选，定性评价主要围绕基金经理的投资理念、投资体系等展开

	尽调，判断业绩是否可持续。（2）构建基金组合：采用核心-卫星策略，从子基金池中精选优质基金，构建基金组合。（3）投后跟踪分析：对基金组合进行紧密的动态跟踪，根据市场环境的变化及子基金运作情况积极调整基金组合。	
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×70%+中债综合全价（总值）指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×20%	
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）。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝积极配置三个月持有混合（FOF）A	华宝积极配置三个月持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	020311	020312
报告期末下属分级基金的份额总额	162,629,432.93份	292,096,574.60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（2024年4月23日-2024年6月30日）	
	华宝积极配置三个月持有混合（FOF）A	华宝积极配置三个月持有混合（FOF）C
1. 本期已实现收益	-160,817.95	-506,018.98
2. 本期利润	631,664.41	917,084.08
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0039	0.0031
4. 期末基金资产净值	163,261,410.47	293,013,830.53
5. 期末基金份额净值	1.0039	1.0031

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. 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

华宝积极配置三个月持有混合（FOF）A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.39%	0.01%	-0.85%	0.53%	1.24%	-0.52%

华宝积极配置三个月持有混合（FOF）C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.31%	0.01%	-0.85%	0.53%	1.16%	-0.52%

注：（1）基金业绩基准：中证偏股型基金指数收益率×70%+中债综合全价（总值）指数收益率×

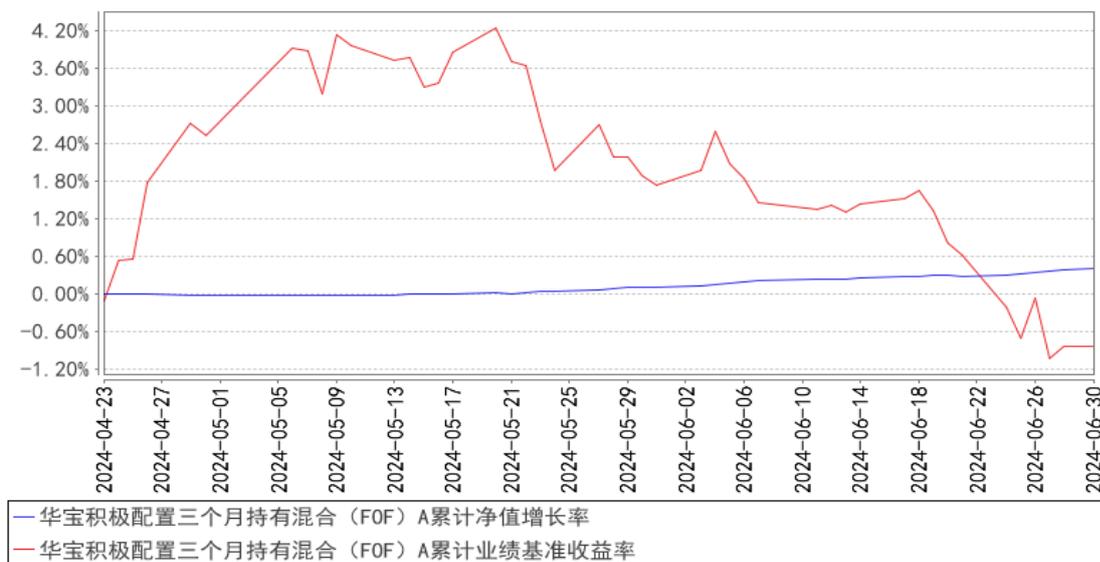
10%+银行活期存款利率（税后）×20%；

（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）；

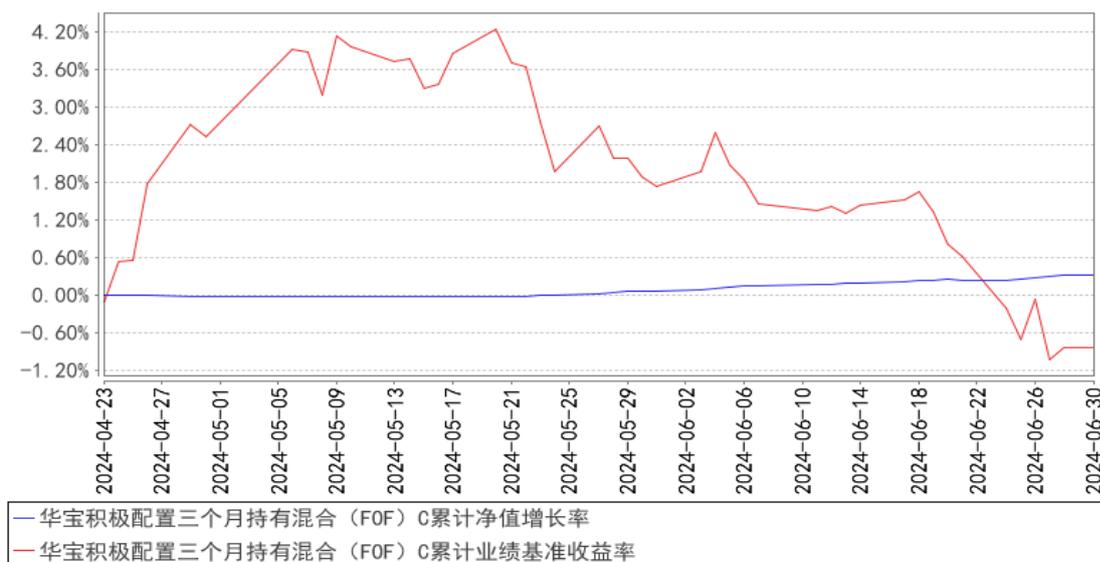
（3）本基金成立于2024年04月23日。

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

华宝积极配置三个月持有混合（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



华宝积极配置三个月持有混合（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2024年04月23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		
孙梦祎	本基金基金经理	2024-04-23	-	10年	硕士。曾在财通证券、东北证券、大同证券和太平洋证券从事证券研究和投资管理的工作。2021年12月加入华宝基金管理有限公司。2022年1月起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）、华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理，2024年4月起任华宝积极配置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。

4.1.1 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、《华宝积极配置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 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

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价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%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

产品处于建仓期，尚无进行权益大比例投资，主要投资于债券市场基金，同时由于产品成立当日市场处于央行喊话窗口指导长端利率下降较快的时间点，所以基本上布局短久期债券基金为主，待市场企稳后再加大权益基金配置。

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 0.39%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 0.31%；同期业绩比较基准收益率为-0.85%。

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	412,749,582.22	90.35
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	44,020,056.57	9.64

8	其他资产	81,542.62	0.02
9	合计	456,851,181.41	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“应付利息”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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	15,532.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	0.02
4	应收利息	-
5	应收申购款	66,010.00
6	其他应收款	0.34
7	其他	-
8	合计	81,542.62

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.11.6 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 基金中基金

6.1 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	020089	广发纯债债券 E	契约型开放式	33,679,457.77	42,025,227.41	9.21	否
2	000037	广发景宁纯债 A	契约型开放式	35,064,443.82	40,320,603.95	8.84	否
3	003859	招商招旭纯债 A	契约型开放式	21,981,416.97	30,217,853.91	6.62	否
4	003265	招商招坤纯债 A	契约型开放式	22,691,968.84	30,207,548.92	6.62	否
5	005577	交银丰晟收益债券 A	契约型开放式	24,798,569.69	30,115,383.03	6.60	否
6	519782	交银裕隆纯债债券 A	契约型开放式	21,249,321.02	29,160,443.24	6.39	否
7	008170	博时富添纯债债券 A	契约型开放式	23,140,794.22	25,193,382.67	5.52	否
8	003156	招商招悦纯债 A	契约型开放式	18,175,952.01	20,146,225.21	4.42	否
9	003863	招商招祥纯债 A	契约型开放式	17,677,892.68	20,140,423.13	4.41	否
10	002881	中加丰润纯债债券 A	契约型开放式	18,017,787.94	20,136,679.80	4.41	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2024 年 4 月 23 日至 2024 年 6 月 30 日	其中：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
当期交易基金产生的申购费(元)	21,099.64	-
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)	6,364.02	3,157.45
当期持有基金产生的应支付管理费	178,326.92	4,420.17

费（元）		
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	51,772.10	1,136.73
当期交易基金产生的交易费（元）	60.03	-

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝积极配置三个月持有混合（FOF）A	华宝积极配置三个月持有混合（FOF）C
基金合同生效日(2024 年 4 月 23 日)基金份额总额	162,524,890.72	292,030,735.45
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	104,542.21	65,839.15
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	162,629,432.93	292,096,574.60

注：本基金合同生效日于 2024 年 04 月 23 日。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 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。

8.2 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。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝积极配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同；
华宝积极配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书；
华宝积极配置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。

10.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

10.3 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

2024 年 7 月 19 日