

# 华宝中短债债券型发起式证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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       | 华宝中短债债券  |
| 基金主代码      | 006947   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式、发起式   |
| 基金合同生效日    | 2019 年 3 月 15 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 1,508,872,344.76 份   |
| 投资目标       | 在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，本基金重点投资于中短期债券，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。   |
| 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          | 中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（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           | 中国工商银行股份有限公司                                |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 华宝中短债债券 A                                   | 华宝中短债债券 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 006947                                      | 006948          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,417,749,128.74 份                          | 91,123,216.02 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） |                |
|-----------------|-------------------------------------|----------------|
|                 | 华宝中短债债券 A                           | 华宝中短债债券 C      |
| 1. 本期已实现收益      | 12,429,532.88                       | 1,086,674.48   |
| 2. 本期利润         | 6,869,557.82                        | 679,948.60     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0049                              | 0.0048         |
| 4. 期末基金资产净值     | 1,621,829,648.50                    | 102,341,382.48 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1439                              | 1.1231         |

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

华宝中短债债券 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          | 0.54%  | 0.02% | 0.40%  | 0.02% | 0.14% | 0.00% |
| 过去六个月          | 1.75%  | 0.02% | 1.39%  | 0.02% | 0.36% | 0.00% |
| 过去一年           | 2.65%  | 0.04% | 2.17%  | 0.03% | 0.48% | 0.01% |
| 过去三年           | 10.52% | 0.03% | 8.83%  | 0.03% | 1.69% | 0.00% |
| 过去五年           | -      | -     | -      | -     | -     | -     |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 16.60% | 0.04% | 13.28% | 0.04% | 3.32% | 0.00% |

华宝中短债债券 C

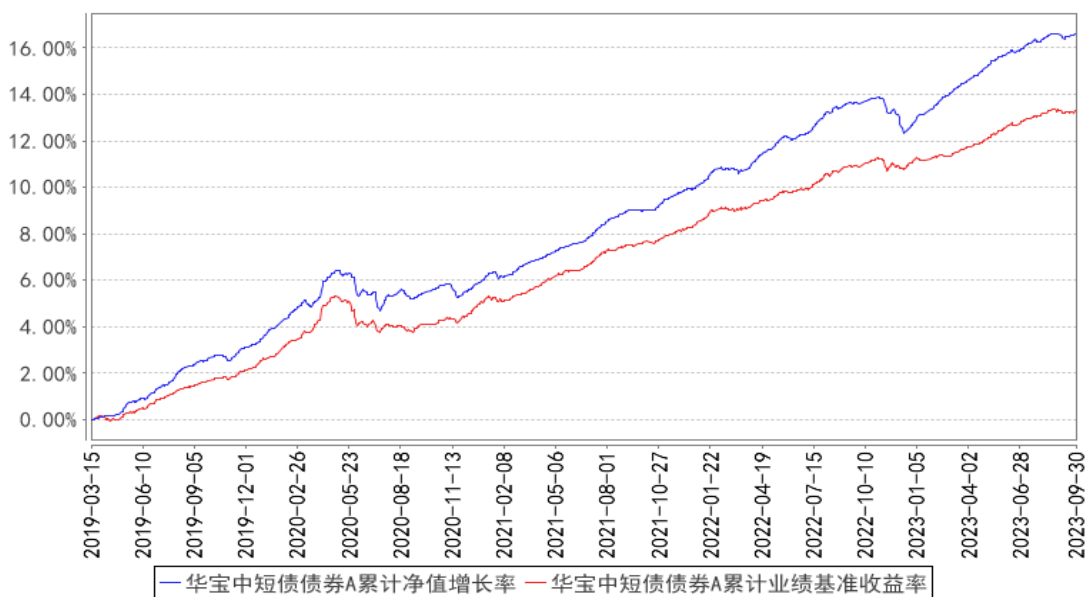
| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率标准<br>差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④   |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月          | 0.45%  | 0.02%         | 0.40%          | 0.02%                 | 0.05% | 0.00% |
| 过去六个月          | 1.56%  | 0.02%         | 1.39%          | 0.02%                 | 0.17% | 0.00% |
| 过去一年           | 2.23%  | 0.04%         | 2.17%          | 0.03%                 | 0.06% | 0.01% |
| 过去三年           | 9.20%  | 0.03%         | 8.83%          | 0.03%                 | 0.37% | 0.00% |
| 过去五年           | -      | -             | -              | -                     | -     | -     |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 14.49% | 0.04%         | 13.28%         | 0.04%                 | 1.21% | 0.00% |

注：（1）基金业绩基准：中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%；

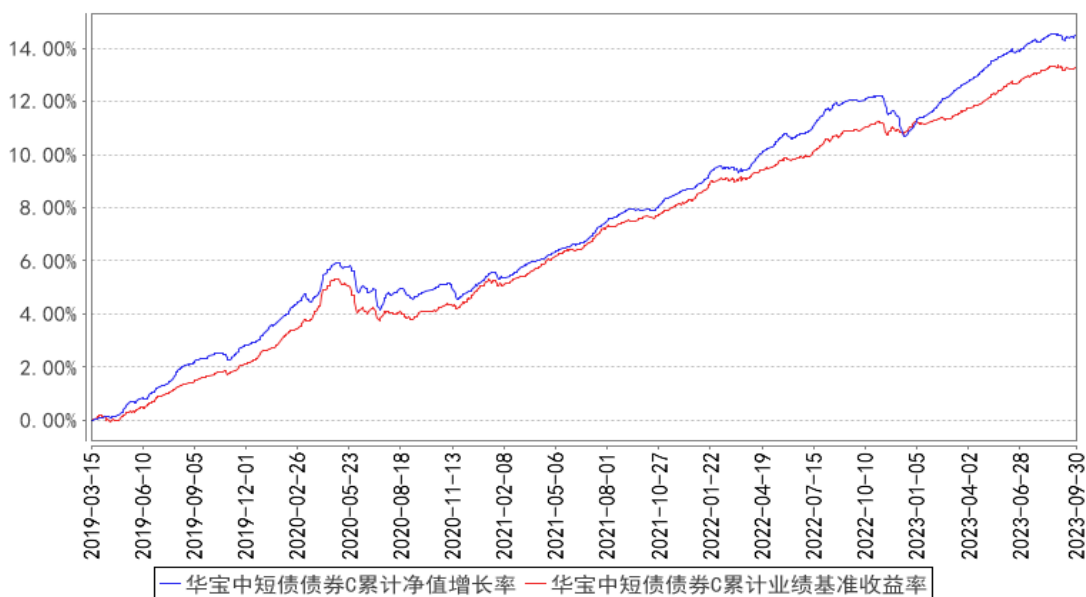
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

### 3.2.2 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

华宝中短债债券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



华宝中短债债券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：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 6 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 2019 年 09 月 15 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 |        |   |
| 高文庆 | 本基金基金经理 | 2019-03-15  | -    | 13 年   | 硕士。2010 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理风险分析师、助理产品经理、信用分析师、高级信用分析师、 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | <p>基金经理助理等职务。2017年3月至2023年2月任华宝现金宝货币市场基金基金经理，2017年3月至2023年8月任华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年3月起任华宝中短债债券型发起式证券投资基金基金经理，2019年5月起任华宝宝怡纯债债券型证券投资基金基金经理，2019年7月起任华宝现金添益交易型货币市场基金基金经理，2019年9月起任华宝政策性金融债券型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

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、《华宝中短债债券型发起式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

三季度以来经济延续修复,8月以来大部分经济数据环比改善,制造业 PMI 连续回升,9月 PMI 升至荣枯线以上(50.2%),经济呈现触底回升的特征。具体来看,1-8月固定资产投资累计同比增长 3.2%,投资增速虽然继续下滑,地产投资仍是主要拖累项,但制造业和基建投资显现韧性,进出口回落幅度有所缓和,消费逐步改善。流动性方面,央行在8月15日宣布降息,7天逆回购利率下调 10bp,1年期 MLF 利率下调 15bp,超预期降息后,受地方债发行放量,信贷边际改善,人民币汇率面临一定贬值压力背景下,资金面呈现边际收敛。债市方面,三季度以来受政策利率下调和配置需求推动下,债券收益率下行至年内低位,随后8月下旬以来在经济数据改善、利率债供给放量、资金面边际收紧以及地产政策加码等宽信用政策影响下,债券收益率逐步反弹,短端品种受资金和赎回的影响,调整幅度超过长端,收益率曲线平坦化,其中1年国债收益率上行 30bp 至 2.17%,10年国债上行 4bp 至 2.68%,信用债收益率跟随利率债出现回调,信用利差全面压缩。报告期内,本基金管理规模保持平稳,根据市场变化对组合久期和杠杆进行了积极的调整。本基金管理人将继续本着谨慎、稳健、安全的原则,积极关注经济和政策面的变化,根据市场变化灵活调整投资策略,为投资者谋取稳定回报。

#### 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 0.54%,本报告期基金份额 C 类净值增长率为 0.45%;同期业绩比较基准收益率为 0.40%。

#### 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            | 1,920,132,299.56 | 99.91  |
|   | 其中：债券             | 1,920,132,299.56 | 99.91  |
|   | 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      | 1,436,595.72     | 0.07   |
| 8 | 其他资产              | 367,888.97       | 0.02   |
| 9 | 合计                | 1,921,936,784.25 | 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      | 6,715,496.39     | 0.39         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 799,863,384.58   | 46.39        |
|    | 其中：政策性金融债 | 143,037,095.61   | 8.30         |
| 4  | 企业债券      | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 201,621,923.37   | 11.69        |
| 6  | 中期票据      | 911,931,495.22   | 52.89        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,920,132,299.56 | 111.37       |



### 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  | 2028022   | 20 民生银行二级        | 600,000 | 60,354,295.08 | 3.50         |
| 2  | 1920066   | 19 上海银行二级        | 500,000 | 52,624,605.48 | 3.05         |
| 3  | 102102056 | 21 鲁高速<br>MTN007 | 500,000 | 51,761,356.16 | 3.00         |
| 4  | 1928002   | 19 民生银行二级<br>01  | 500,000 | 51,567,781.42 | 2.99         |
| 5  | 1928010   | 19 平安银行二级        | 500,000 | 51,485,765.03 | 2.99         |

### 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

华宝中短债债券截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中国平安人寿保险股份有限公司因存款业务违规，违规销售或推介，现金管理违反操作规则，信息披露及资料、文件等上报违规，内部管理与控制制度不健全或执行监督不力，未经批准变更、终止与机构相关的所有信息，

欺骗投保人,未按规定使用经批准或者备案的保险条款、保险费率,未按规定报送有关报告、报表、文件和资料,违反一般的精算原理,未按规定提取准备金,内控管理未形成有效风险控制,保险业务违规,触犯法律法规;于 2022 年 11 月 17 日收到人身保险监管部公开通报的处罚措施。

华宝中短债债券截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,交通银行股份有限公司因:“一是多期债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销,个别债务融资工具挤占了其他投资人的正常投标,违背了公平公正原则,并影响了发行利率,对市场正常秩序造成了一定不良影响。二是多期债务融资工具的簿记建档利率区间未在充分询价基础上形成,发行工作程序执行不到位、工作开展不规范。”;于 2023 年 01 月 18 日收到中国银行间市场交易商协会警告,责令改正的处罚措施。

华宝中短债债券截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,交通银行股份有限公司因:一是多期债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销,个别债务融资工具挤占了其他投资人的正常投标,违背了公平公正原则并影响了发行利率,对市场正常秩序造成了一定不良影响。二是多期债务融资工具的簿记建档利率区间未在充分询价基础上形成,发行工作程序执行不到位、工作开展不规范。;于 2023 年 01 月 18 日收到中国银行间市场交易商协会警告,责令改正的处罚措施。

华宝中短债债券截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,平安银行股份有限公司因作为相关债务融资工具联席主承销商,未按发行文件约定,取利率区间上限开展余额包销,相关行为挤占了其他市场投资人的份额,损害了其他投资人权益,并影响了发行利率,对市场正常秩序造成了一定不良影响;于 2023 年 01 月 18 日收到中国银行间市场交易商协会责令改正,通报批评的处罚措施。

华宝中短债债券截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,兴业银行股份有限公司因:“一是低价包销多期债务融资工具,影响了市场正常秩序。二是多期债务融资工具的簿记建档利率区间未在充分询价基础上形成,发行工作程序执行不到位、工作开展不规范。”;于 2023 年 01 月 18 日收到中国银行间市场交易商协会警告,责令改正的处罚措施。

华宝中短债债券截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国民生银行股份有限公司因信贷业务违规,票据业务违规,存款业务违规,违规销售或推介,违规授信,贷后资金流向、用途及项目进度等管理、监督、执行不到位,违规收费,内部管理与控制制度不健全或执行监督不力,未经任职资格审查或核准任命董事、高级管理人员、首席代表,编制或者提供虚假资料;于 2023 年 02 月 16 日收到银保监会罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝中短债债券截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,上海银行股份有限公

司因违规经营,涉嫌违反法律法规,未依法履行职责,违反结汇、售汇及付汇管理规定;于 2023 年 04 月 21 日收到国家外汇管理局上海市分局警告、罚款、没收违法所得;给予警告,处罚款 9834.5 万元人民币,没收违法所得 19.9 万元人民币,罚没款合计 9854.4 万元人民币的处罚措施。

华宝中短债债券截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,兴业银行股份有限公司因违规经营;于 2023 年 05 月 08 日收到福建证监局责令改正的处罚措施。

华宝中短债债券截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国民生银行股份有限公司因承销业务涉嫌违规;于 2023 年 05 月 09 日收到中国银行间市场交易商协会立案调查的处罚措施。

华宝中短债债券截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,平安银行股份有限公司因违反国库管理规定,违反征信管理规定,违反支付结算管理规定,违反账户管理规定,未按规定履行客户身份识别义务,未按规定报送大额交易或者可疑交易报告;于 2023 年 07 月 07 日收到中国人民银行警告,罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝中短债债券截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国民生银行股份有限公司因信贷业务违规,存款业务违规,违规销售或推介,内部管理与控制制度不健全或执行监督不力,内控管理未形成有效风险控制,提供服务质价不符;于 2023 年 08 月 02 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

华宝中短债债券截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国民生银行股份有限公司因:“一是推荐撮合资产管理计划投资业务,客观上协助了相关企业债券的非市场化发行和规避交易监管。二是个别债项按照发行人预期或要求的利率执行包销,发行定价市场化程度不足。三是部分债项发行工作程序执行不规范。四是作为相关债项发行文件约定的持有人会议召集人,未及时召集持有人会议。”;于 2023 年 08 月 16 日收到中国银行间市场交易商协会警告,责令改正的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内,本基金投资的前十名证券的其余的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 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   | 1,269.57   |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 366,444.40 |
| 6  | 其他应收款   | 175.00     |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 367,888.97 |

#### 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                        | 华宝中短债债券 A        | 华宝中短债债券 C      |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 897,951,187.89   | 126,897,972.74 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,483,162,469.97 | 98,496,265.98  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 963,364,529.12   | 134,271,022.70 |
| 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               | 1,417,749,128.74 | 91,123,216.02  |

### §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

单位：份

| 项目                       | 华宝中短债债券 A     | 华宝中短债债券 C |
|--------------------------|---------------|-----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 10,192,882.63 | -         |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -             | -         |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -             | -         |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 10,192,882.63 | -         |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.72          | -         |

## 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目              | 持有份额总数        | 持有份额占基金总<br>份额比例(%) | 发起份额总数        | 发起份额占基金总<br>份额比例(%) | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-----------------|---------------|---------------------|---------------|---------------------|----------------|
| 基金管理人固<br>有资金   | 10,192,882.63 | 0.68                | 10,000,000.00 | 0.66                | 不少于 3 年        |
| 基金管理人高<br>级管理人员 | -             | -                   | -             | -                   | -              |
| 基金经理等人<br>员     | -             | -                   | -             | -                   | -              |
| 基金管理人股<br>东     | -             | -                   | -             | -                   | -              |
| 其他              | -             | -                   | -             | -                   | -              |
| 合计              | 10,192,882.63 | 0.68                | 10,000,000.00 | 0.66                | -              |

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用自有资金作为发起资金总计 10,001,000.00 元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于 3 年；

2、本基金管理人运用自有资金于 2019 年 3 月 13 日通过本公司直销柜台认购本基金作为发起资金的认购费用为 1,000 元。符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

## §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

无

## §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；  
华宝中短债债券型发起式证券投资基金基金合同；  
华宝中短债债券型发起式证券投资基金招募说明书；  
华宝中短债债券型发起式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。

## 10.2 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。

## 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

2023 年 10 月 25 日