

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证
券投资基金
2024 年中期报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	35
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	35
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	35
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	36

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	36
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	36
7.12 投资组合报告附注	36
§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	43
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
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	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	44
§ 12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金
基金简称	华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期
基金主代码	015864
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 6 月 17 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	746,303,852.65 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。 在正常市场情况下，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金预期风险与收益低于股票型基金、高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	王小飞
	联系电话	021-38505888	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	021-60637228
传真		021-38505777	021-60635778
注册地址		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	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码	200120	100033
法定代表人	黄孔威	张金良

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	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	10,018,731.29
本期利润	9,582,705.80
加权平均基金份额本期利润	0.0111
本期加权平均净值利润率	1.07%
本期基金份额净值增长率	1.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	31,050,507.99
期末可供分配基金份额利润	0.0416
期末基金资产净值	778,926,525.77
期末基金份额净值	1.0437
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	4.37%

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。

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

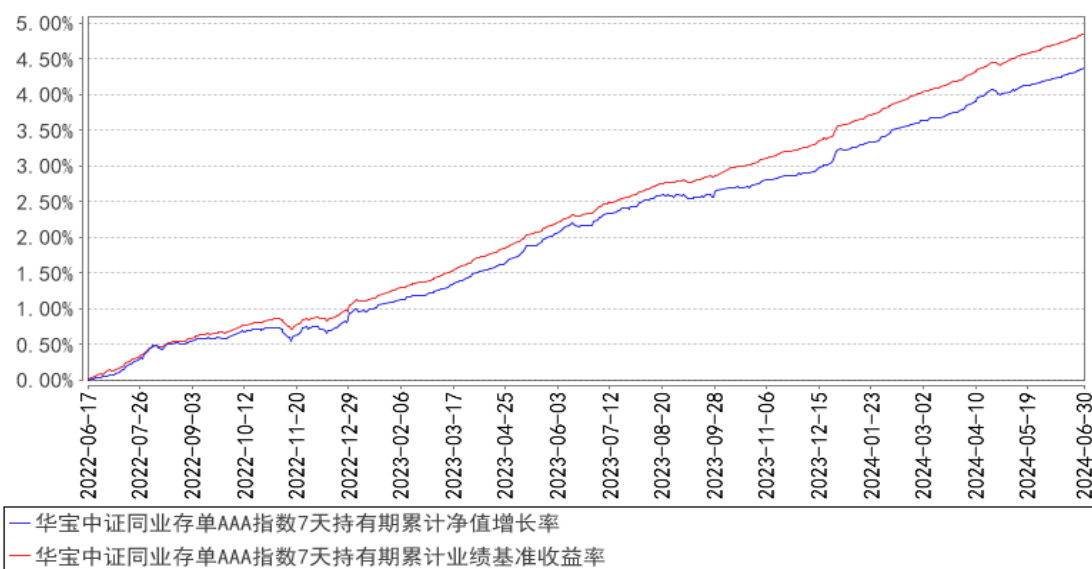
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.17%	0.01%	0.19%	0.01%	-0.02%	0.00%
过去三个月	0.56%	0.01%	0.62%	0.01%	-0.06%	0.00%
过去六个月	1.09%	0.01%	1.25%	0.01%	-0.16%	0.00%
过去一年	2.09%	0.01%	2.42%	0.01%	-0.33%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.37%	0.02%	4.85%	0.01%	-0.48%	0.01%

注：（1）基金业绩基准：中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率（税后）×5%；

（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

华宝中证同业存单AAA指数7天持有期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 2022 年 12 月 17 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（2024 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 141 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		
厉卓然	本基金基金经理	2022-06-17	-	11 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，2023 年 10 月起任华宝现金添益交易型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。

4.1.3 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、《华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 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 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

今年上半年国内生产总值达 61.68 万亿元，上半年名义 GDP 同比增长 4%，实际 GDP 同比增长 5%，持平于全年 5% 左右的增长目标。今年各季度 GDP 实际同比增速分别为 5.3% 和 4.7%，单季度季调环比分别为 1.5% 和 0.7%。全国规模以上工业增加值上半年累计同比增长 6%，较上年度抬升了 1.4 个百分点。上半年固定资产投资（不含农户）同比增长 3.9%，较上年度抬升 0.9 个百分点，其中制造业投资为主要拉动项。社会消费品零售总额上半年累计同比增长 3.7%。外贸方面，上半年实现出口总值 1.71 万亿美元、进口总值 1.27 万亿美元，上半年出口累计同比增长 3.6%、进口 2.0%，实现贸易顺差 4350 亿美元。通胀方面，上半年 CPI 累计同比上涨 0.1%，较上年度回落 0.1 个百分点；PPI 累计同比 -2.1%，较上年度回升 0.9 个百分点。半年末，社会融资规模存量为 395.11 万亿元，同比增长 8.1%，较上年末回落 1.4 个百分点；广义货币 M2 同比增速为 6.2%，较上年末回落 3.5 个百分点。上半年流动性整体宽松，R001 和 R007 均值为 1.84% 和 2.03%，较 2023 下半年度均值分别上行 4BP 和下行 17BP。

货币政策方面，上半年央行实施了一次降准，LPR 报价调降一次。今年上半年，市场呈现债强股弱的格局，沪深 300 指数 0.89%、创业板指-10.99%、中证转债指数-0.07%，中债总财富指数 3.83%。债券收益率持续下行，期限利差有所压缩，收益率曲线牛平。信用债表现强于利率债，信用利差有所压缩，中低等级表现强于高等级。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 1.09%，业绩比较基准收益率为 1.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，7 月央行实施了本年度首次政策利率降息、LPR 报价今年第二次下调，体现 7 月政治局会议和中全会定调的“坚定不移完成全年经济社会发展目标任务”，传递了稳增长稳预期的政策意图。在高质量发展、保持战略定力的背景下，预计下半年经济阶段性企稳是一个逐步的过程，会对债市带来扰动。同时，海外主要央行逐步开启降息，有助于国内货币政策继续打开空间。短期来看，债券收益率快速上行的风险相对有限；但随着资金利率和债券收益率行至低位，债券市场的波动将有所加大，后续需密切跟踪金融监管、财政发力、政府债供给、机构行为等因素的边际变化。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	401,834.53	179,358.78
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,051,926,059.58	1,150,059,530.03
其中：股票投资		-	-

基金投资		-	-
债券投资		1,051,926,059.58	1,150,059,530.03
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,121,352.77	19,398,465.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,054,449,246.88	1,169,637,354.64
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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		275,066,246.59	90,247,224.46
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		139,060.87	178,618.00
应付托管费		34,765.20	44,654.51
应付销售服务费		139,060.87	178,618.00
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,680.89	5,890.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	139,906.69	215,922.02
负债合计		275,522,721.11	90,870,927.93
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	746,303,852.65	1,044,876,268.67
未分配利润	6.4.7.8	32,622,673.12	33,890,158.04
净资产合计		778,926,525.77	1,078,766,426.71
负债和净资产总计		1,054,449,246.88	1,169,637,354.64

注： 报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0437 元，基金份额总额 746,303,852.65

份。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		14,055,975.47	25,329,227.79
1. 利息收入		7,104.25	23,998.45
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,954.27	23,998.45
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		2,149.98	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		14,484,896.71	21,653,867.18
其中：股票投资收益	6.4.7.10	—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.11	14,484,896.71	21,653,867.18
资产支持证券投 资收益	6.4.7.12	—	—
贵金属投资收益	6.4.7.13	—	—
衍生工具收益	6.4.7.14	—	—
股利收益	6.4.7.15	—	—
其他投资收益		—	—
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	6.4.7.16	-436,025.49	3,651,362.16
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.17	—	—
减：二、营业总支出		4,473,269.67	7,634,220.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	892,500.98	1,452,142.40
其中：暂估管理人报酬		—	—
2. 托管费	6.4.10.2.2	223,125.15	363,035.64
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	892,500.98	1,452,142.40
4. 投资顾问费		—	—
5. 利息支出		2,337,035.52	4,234,207.80

其中：卖出回购金融资产支出		2,337,035.52	4,234,207.80
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		4,848.67	3,364.66
8. 其他费用	6.4.7.19	123,258.37	129,327.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,582,705.80	17,695,007.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,582,705.80	17,695,007.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,582,705.80	17,695,007.02

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,044,876,268.67	-	33,890,158.04	1,078,766,426.71
二、本期期初净资产	1,044,876,268.67	-	33,890,158.04	1,078,766,426.71
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-298,572,416.02	-	-1,267,484.92	-299,839,900.94
（一）、综合收益总额	-	-	9,582,705.80	9,582,705.80
（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）	-298,572,416.02	-	-10,850,190.72	-309,422,606.74
其中：1. 基金申购款	929,213,037.19	-	34,691,700.45	963,904,737.64
2. 基金赎回款	-1,227,785,453.21	-	-45,541,891.17	-1,273,327,344.38

(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、本期期末净资产	746,303,852.65	-	32,622,673.12	778,926,525.77
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	1,971,340,560.84	-	18,775,517.67	1,990,116,078.51
二、本期期初净资产	1,971,340,560.84	-	18,775,517.67	1,990,116,078.51
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 453,200,453.37	-	15,041,831.29	-438,158,622.08
(一)、综合收益总额	-	-	17,695,007.02	17,695,007.02
(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)	- 453,200,453.37	-	-2,653,175.73	-455,853,629.10
其中：1. 基金申购款	2,243,543,609.21	-	39,653,120.37	2,283,196,729.58
2. 基金赎回款	- 2,696,744,062.58	-	-42,306,296.10	- 2,739,050,358.68
(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、本期期末净资产	1,518,140,107.47	-	33,817,348.96	1,551,957,456.43

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：

<u>向辉</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
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

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金（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”）证监许可[2022]1031 号文《关于准予华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的批复》的准予注册，由华宝基金管理有限公司作为基金管理人向社会公开发行人募集设立。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（2022）验字第 61471289_B04 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 2022 年 6 月 17 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 7,605,590,270.20 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 1,713,256.52 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 7,607,303,526.72 元，折合 7,607,303,526.72 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数的成份券及备选成份券。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非属成份券及备选成份券的其他同业存单、债券（包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、政府支持债券、政府支持机构债券等）、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等允许基金投资的非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、现金等货币市场工具等，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）。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。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：本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的 80%，本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更上述投资品种的比例限制，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利

率（税后）×5%。

本财务报表已于 2024 年 8 月 30 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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）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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品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，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品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，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。

（2）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）及地方教育费附加。

（3）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。

（4）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。

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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	401,834.53
等于：本金	401,793.98
加：应计利息	40.55
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	401,834.53

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 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	-	-	-	-
	银行间市场	1,045,817,085.01	5,475,059.58	1,051,926,059.58	633,914.99
	合计	1,045,817,085.01	5,475,059.58	1,051,926,059.58	633,914.99
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,045,817,085.01	5,475,059.58	1,051,926,059.58	633,914.99

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

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	52,885.21
其中：交易所市场	—
银行间市场	52,885.21
应付利息	—
预提费用	87,021.48
合计	139,906.69

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,044,876,268.67	1,044,876,268.67
本期申购	929,213,037.19	929,213,037.19
本期赎回（以“-”号填列）	-1,227,785,453.21	-1,227,785,453.21
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	746,303,852.65	746,303,852.65

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	31,513,299.12	2,376,858.92	33,890,158.04
本期期初	31,513,299.12	2,376,858.92	33,890,158.04
本期利润	10,018,731.29	-436,025.49	9,582,705.80
本期基金份额交易产生的变动数	-10,481,522.42	-368,668.30	-10,850,190.72
其中：基金申购款	32,828,818.52	1,862,881.93	34,691,700.45
基金赎回款	-43,310,340.94	-2,231,550.23	-45,541,891.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,050,507.99	1,572,165.13	32,622,673.12

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	903.32
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,050.95
其他	-
合计	4,954.27

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

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

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

债券投资收益——利息收入	13,363,465.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,121,430.84
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	14,484,896.71

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,246,673,125.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,202,041,633.46
减：应计利息总额	43,455,660.76
减：交易费用	54,400.00
买卖债券差价收入	1,121,430.84

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	-436,025.49
股票投资	-
债券投资	-436,025.49
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-436,025.49

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	27,349.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	17,636.89
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	123,258.37

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1.2 债券交易

6.4.10.1.3 债券回购交易

6.4.10.1.4 权证交易

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	892,500.98	1,452,142.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	436,662.88	709,547.10
应支付基金管理人的净管理费	455,838.10	742,595.30

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	223,125.15	363,035.64

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期
华宝基金	1,238.03
华宝证券	263.59
建设银行	695,442.40
合计	696,944.02
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期
华宝基金	4,865.36
华宝证券	54.75
建设银行	1,289,493.82
合计	1,294,413.93

注：销售服务费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本报告期内及上年度可比期间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

本报告期末及上年度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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	401,834.53	903.32	1,328,904.65	2,003.28

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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（2024 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

至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 275,066,246.59 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
012480294	24 济南城建 SCP002	2024 年 7 月 1 日	101.14	112,000	11,327,551.47
012480807	24 湘高速 SCP002	2024 年 7 月 1 日	100.63	300,000	30,189,969.86
112405157	24 建设银行 CD157	2024 年 7 月 1 日	98.75	500,000	49,377,102.17
112417113	24 光大银行 CD113	2024 年 7 月 1 日	98.66	576,000	56,827,637.17
112480329	24 西安银行 CD029	2024 年 7 月 1 日	98.13	400,000	39,250,826.52
112496101	24 厦门国际银行 CD071	2024 年 7 月 1 日	99.50	268,000	26,665,864.68
112497108	24 长沙银行 CD082	2024 年 7 月 1 日	99.42	298,000	29,626,342.53
230306	23 进出 06	2024 年 7 月 1 日	101.66	500,000	50,828,620.22
合计				2,954,000	294,093,914.62

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

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。基金投资的金融工具包括国债、政策性金融债、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相关规定。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与跟踪指数相同的风险收益目标。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在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。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	131,468,114.67	121,529,981.09
合计	131,468,114.67	121,529,981.09

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	920,457,944.91	987,254,237.83
合计	920,457,944.91	987,254,237.83

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	41,275,311.11
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	41,275,311.11

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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（所有者权益）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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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银行间同业市场交易。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。本基金所持证券均在银行间同业市场交易，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；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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	401,834.53	-	-	-	401,834.53
交易性金融资产	1,051,926,059.58	-	-	-	1,051,926,059.58
应收申购款	-	-	-	2,121,352.77	2,121,352.77
资产总计	1,052,327,894.11	-	-	2,121,352.77	1,054,449,246.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	139,060.87	139,060.87
应付托管费	-	-	-	34,765.20	34,765.20
卖出回购金融资产款	275,066,246.59	-	-	-	275,066,246.59
应付销售服务费	-	-	-	139,060.87	139,060.87
应交税费	-	-	-	3,680.89	3,680.89
其他负债	-	-	-	139,906.69	139,906.69
负债总计	275,066,246.59	-	-	456,474.52	275,522,721.11
利率敏感度缺口	777,261,647.52	-	-	1,664,878.25	778,926,525.77
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	179,358.78	-	-	-	179,358.78
交易性金融资产	1,150,059,530.03	-	-	-	1,150,059,530.03
应收申购款	-	-	-	19,398,465.83	19,398,465.83
资产总计	1,150,238,888.81	-	-	19,398,465.83	1,169,637,354.64
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	178,618.00	178,618.00
应付托管费	-	-	-	44,654.51	44,654.51
卖出回购金融资产款	90,247,224.46	-	-	-	90,247,224.46
应付销售服务费	-	-	-	178,618.00	178,618.00
应交税费	-	-	-	5,890.94	5,890.94
其他负债	-	-	-	215,922.02	215,922.02
负债总计	90,247,224.46	-	-	623,703.47	90,870,927.93
利率敏感度缺口	1,059,991,664.35	-	-	18,774,762.36	1,078,766,426.71

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	2. 市场利率下降 25 个基点	1,327,835.24	1,428,273.81
	1. 市场利率上升 25 个基点	-1,323,498.64	-1,423,532.65

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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个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。本基金主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的 80%，本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%；现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券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对基金进行风险度量，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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有交易性权益类投资（上年度末：同），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	—		
	—		
	—		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	合计	—	0.00

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	—	—
第二层次	1,051,926,059.58	1,150,059,530.03
第三层次	—	—
合计	1,051,926,059.58	1,150,059,530.03

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(上年度末：同)。

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	—	—
3	固定收益投资	1,051,926,059.58	99.76
	其中：债券	1,051,926,059.58	99.76
	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	401,834.53	0.04
8	其他各项资产	2,121,352.77	0.20
9	合计	1,054,449,246.88	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初基金资产净值 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初基金资产净值 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,828,620.22	6.53
	其中：政策性金融债	50,828,620.22	6.53
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	80,639,494.45	10.35
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	920,457,944.91	118.17
9	其他	-	-
10	合计	1,051,926,059.58	135.05

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	占基金资产净值比例 (%)
1	112497108	24 长沙银行 CD082	800,000	79,533,805.46	10.21
2	112416081	24 上海银行 CD081	800,000	79,449,708.26	10.20
3	112494413	24 徽商银行 CD027	800,000	79,322,289.45	10.18
4	112415241	24 民生银行 CD241	800,000	79,298,956.07	10.18
5	112304066	23 中国银行 CD066	800,000	79,285,046.56	10.18

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 投资组合报告附注

7.12.1 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

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 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、规避委托贷款监管,违规利用委托债权投资业务向企业融资二、违规贷款未整改收回情况下继续违规发放贷款三、对政府平台公司融资行为监控不力,导致政府债务增加四、股权质押管理问题未整改五、审计人员配备不足问题未整改六、对相关案件未按照有关规定处置七、未按监管要求将福费廷业务纳入表内核算八、代销池业务模式整改不到位九、违规开展综合财富管理代销业务整改不到位十、个别贷款风险分类结果仍存在偏离,整改不到位十一、发放违反国家宏观调控政策贷款仍未整改收回十二、部分正常资产转让问题整改不到位十三、部分不良资产转让问题整改不到位或未整改十四、对部分违规问题未进行责任追究或追究不到位;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。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,广发银行股份有限公司因:一、小微企业划型不准确二、违规发放房地产贷款三、违规发放流动资金贷款四、违规发放土地储备贷款五、违规向企业发放贷款用于土地储备项目六、未经任职资格核准履行高级管理人员职责七、未对集团客户统一授信八、信贷资产质量反映不真实九、信贷资金违规流入证券账户十、贷款资金违规回流借款人十一、未严格落实受托支付十二、虚增存贷款规模十三、信用卡透支资金流入房地产开发企业十四、并购贷款管理不规范;于 2023 年 08 月 03 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 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作为债务融资工具主承销商,存在以下违反银行间债券市场相关自律管理规则的行为: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。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,徽商银行股份有限公司因未依法履行职责;于 2023 年 09 月 13 日收到安徽证监局监管谈话、谈话提醒,记入诚信档案的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,长沙银行股份有限公司因未按规定进行执业登记和管理、未对销售过程关键环节以现场录音录像的方法予以记录;于 2023 年 09 月 27 日收到国家金融监督管理总局湖南监管局警告,罚款的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,徽商银行股份有限公司因:1. 违规办理售汇业务 2. 未按照规定报送统计报表;于 2023 年 11 月 15 日收到国家外汇管理局安徽省分局警告,罚款的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 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信贷业务违规,存款业务违规,违反审慎经营规则,违规销售或推介,未经批准变更、终止与机构相关的所有信息,商业银行经营保理业务违规,内控管理未形成有效风险控制;于 2023 年 11 月 17 日收到国家金融监督管理总局上海监管局罚款,责令改正的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,徽商银行股份有限公司因管理不到位,违规向虚假项目提供融资;同业授信管理不审慎;EAST 系统数据失真;受托支付管理不规范。;于 2023 年 11 月 27 日收到国家金融监督管理总局安徽监

管局罚款的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 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未尽职审核办理股权转让购付汇业务;于 2023 年 11 月 27 日收到国家外汇管理局上海市分局罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国银行股份有限公司因:1.违反账户管理规定;2.违反清算管理规定;3.违反商户管理规定;4.违反备付金管理规定;5.违反人民币反假有关规定;6.违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定;7.未按规定履行客户身份识别义务;8.未按规定保存客户身份资料和交易记录;9.未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告;10.与身份不明的客户进行交易;11.违反金融营销宣传管理规定;12.违反个人金融信息保护规定。;于 2023 年 11 月 29 日收到中国人民银行警告,罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国建设银行股份有限公司因信贷业务违规,违规销售或推介,违规收费,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,信托公司设立、管理信托计划违法违规,内控管理未形成有效风险控制,保险业务违规;于 2023 年 12 月 01 日收到国家金融监督管理总局罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国银行股份有限公司因:一、部分重要信息系统识别不全面,灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求二、重要信息系统投产及变更未向监管部门报告,且投产及变更长期不规范引发重要信息系统较大及以上突发事件三、信息系统运行风险识别不到位、处置不及时,引发重要信息系统重大突发事件四、监管意见整改落实不到位,引发重要信息系统重大突发事件五、信息科技外包管理不审慎六、网络安全域未开展安全评估,网络架构重大变更未开展风险评估且未向监管部门报告七、信息系统突发事件定级不准确,导致未按监管要求上报八、迟报重要信息系统重大突发事件九、错报漏报监管标准化(EAST)数据;于 2023 年 12 月 28 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 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: 1. 未按规定提供报表;2. 未根据标的项目的实际进度和资金需求发放贷款, 导致贷款资金被挪用; 3. 个人贷款贷前调查严重违反审慎经营规则; 4. 个人消费贷款违规流入股市; 于 2023 年 12 月 28 日收到国家金融监督管理总局上海监管局罚款的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 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信贷业务违规, 违反审慎经营规则, 内部管理与控制制度不健全或执行监督不力, 未按规定报送有关报告、报表、文件和资料; 于 2023 年 12 月 29 日收到国家金融监督管理总局上海监管局罚款的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国建设银行股份有限公司因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, 内控管理未形成有效风险控制; 于 2024 年 01 月 05 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,徽商银行股份有限公司因存款业务违规, 违反审慎经营规则, 违规授信, 违规办理同业业务, 内部管理与控制制度不健全或执行监督不力, 未按规定报送有关报告、报表、文件和资料, 内控管理未形成有效风险控制; 于 2024 年 01 月 10 日收到国家金融监督管理总局安徽监管局罚款的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国银行股份有限公司因办理经常项目资金收付, 未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查; 于 2024 年 04 月 03 日收到国家外汇管理局北京市分局罚款, 没收违法所得的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国光大银行股份有限公司因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; 于 2024 年 05 月 14 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期截止 2024 年 06 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境外机构重大投资事项未经行政许可;于 2024 年 05 月 30 日收到国家金融监督管理总局上海监管局罚款的处罚措施。

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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,121,352.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,121,352.77

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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

持有人户数	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
11,561	64,553.57	8,978,423.95	1.20	737,325,428.70	98.80

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	74,600.82	0.0100

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2022 年 6 月 17 日) 基金份额总额	7,607,303,526.72
本报告期期初基金份额总额	1,044,876,268.67
本报告期基金总申购份额	929,213,037.19
减：本报告期基金总赎回份额	1,227,785,453.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	746,303,852.65

§ 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

1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

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 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

银河证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

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： 资力雄厚，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，并能为本基金提供全面的信息服；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：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元退租的有：方正证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 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，中国证券报	2024-01-19
2	华宝基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	上海证券报，证券日报，证券时报，中国证券报	2024-03-29
3	华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2023 年年度报告	基金管理人网站	2024-03-29
4	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，中国证券报	2024-04-19
5	华宝基金关于旗下部分基金新增东方财富证券股份有限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	2024-04-24
6	华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停及恢复申购（含定投及转换转入）业务的公告	基金管理人网站，证券时报	2024-04-25
7	华宝基金关于旗下部分基金新增华福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	2024-05-17

8	华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2024-06-28
---	--	---------	------------

§ 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

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。

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；

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同；

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书；

华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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。

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种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日