# 华富淳信稳健3个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）
# 2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：东方财富证券股份有限公司

送出日期：2026年8月31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。

基金托管人东方财富证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 2 月 10 日起至 2026 年 6 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遵规守信情况的说明 ..... 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 11
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 ..... 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 14
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 ..... 14

**§5 托管人报告 ..... 14**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 14
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 ..... 14
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 ..... 14

**§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 14**

6.1 资产负债表 ..... 14
6.2 利润表 ..... 16
6.3 净资产变动表 ..... 17
6.4 报表附注 ..... 18

**§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 ..... 43
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 ..... 45
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 ..... 46
7.13 投资组合报告附注 ..... 54
**§8 基金份额持有人信息 ..... 55**
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 55
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 ..... 56
**§9 开放式基金份额变动 ..... 56**
**§10 重大事件揭示 ..... 57**
10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 57
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 ..... 57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 57
10.4 基金投资策略的改变 ..... 57
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 ..... 57
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 57
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 57
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 ..... 58
10.9 其他重大事件 ..... 59
**§11 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 60**
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 ..... 60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 60
**§12 备查文件目录 ..... 60**
12.1 备查文件目录 ..... 60
12.2 存放地点 ..... 61
12.3 查阅方式 ..... 61

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF） | |
| 基金简称 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF） | |
| 基金主代码 | 026347 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2026 年 2 月 10 日 | |
| 基金管理人 | 华富基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 东方财富证券股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 236,675,006.87 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）A | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 026347 | 026348 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 59,997,942.33 份 | 176,677,064.54 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，通过资产配置和基金精选策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金力争通过合理判断市场走势，合理配置基金、股票、债券等投资工具的比例，通过定量和定性相结合的方法精选具有不同风险收益特征的基金，力争实现基金资产的稳定回报。本基金将通过战略资产配置策略与战术资产配置策略的有机结合，确定并优化投资组合的资产配置比例。本基金的基金投资策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略等详见招募说明书等法律文件。 |
| 业绩比较基准 | 中债-新综合全价(总值)指数收益率×73%+中证 800 指数收益率×15%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×5%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率×2%+活期存款基准利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金中基金，其预期收益和风险水平理论上低于股票型基金、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、货币型基金中基金。本基金如果投资港股通标的证券，需承担港股通交易机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

## 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 | | 华富基金管理有限公司 | 东方财富证券股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 林之懿 | 刘潇蔓 |
| | 联系电话 | 021-68886996 | 021-36532106 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 电子邮箱 | linzy@hffund.com | jjtg_xxpl@18.cn |
| 客户服务电话 | | 400-700-8001 | 021-36531906 |
| 传真 | | 021-68887997 | 021-36535001 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层 | 西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼 | 上海市静安区永和路 118 弄东方环球企业中心 24 号楼 5 楼(基金托管部） |
| 邮政编码 | | 200120 | 200072 |
| 法定代表人 | | 余海春 | 戴彦 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》 |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | http://www.hffund.com |
| 基金中期报告置备地点 | 基金管理人及基金托管人的办公场所 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 华富基金管理有限公司 | 上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 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 | 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）A | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）C |
| 本期已实现收益 | 253,496.66 | 136,377.76 |
| 本期利润 | 740,158.78 | 1,871,234.04 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0095 | 0.0087 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.95% | 0.87% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.94% | 0.78% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) | |

| | | |
|---|---|---|
| 期末可供分配利润 | 160,095.56 | 197,012.13 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0027 | 0.0011 |
| 期末基金资产净值 | 60,561,347.92 | 178,061,090.49 |
| 期末基金份额净值 | 1.0094 | 1.0078 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 0.94% | 0.78% |

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2）以上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（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3）期末可供分配利润，采用期末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

华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）A

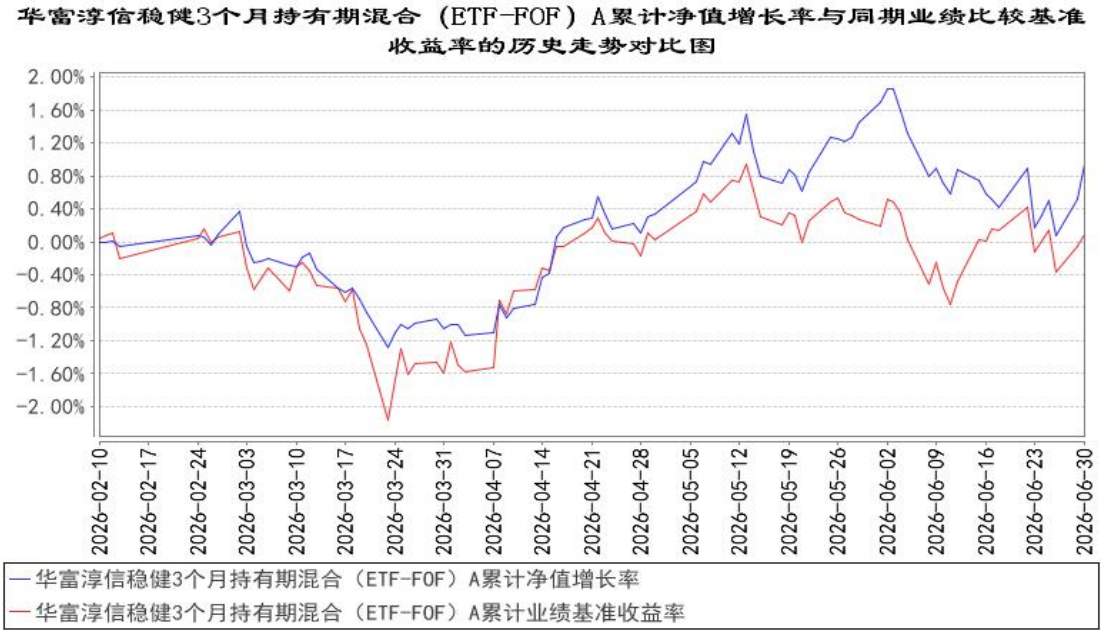
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 2.02% | 0.25% | 1.71% | 0.26% | 0.31% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.94% | 0.23% | 0.09% | 0.27% | 0.85% | -0.04% |

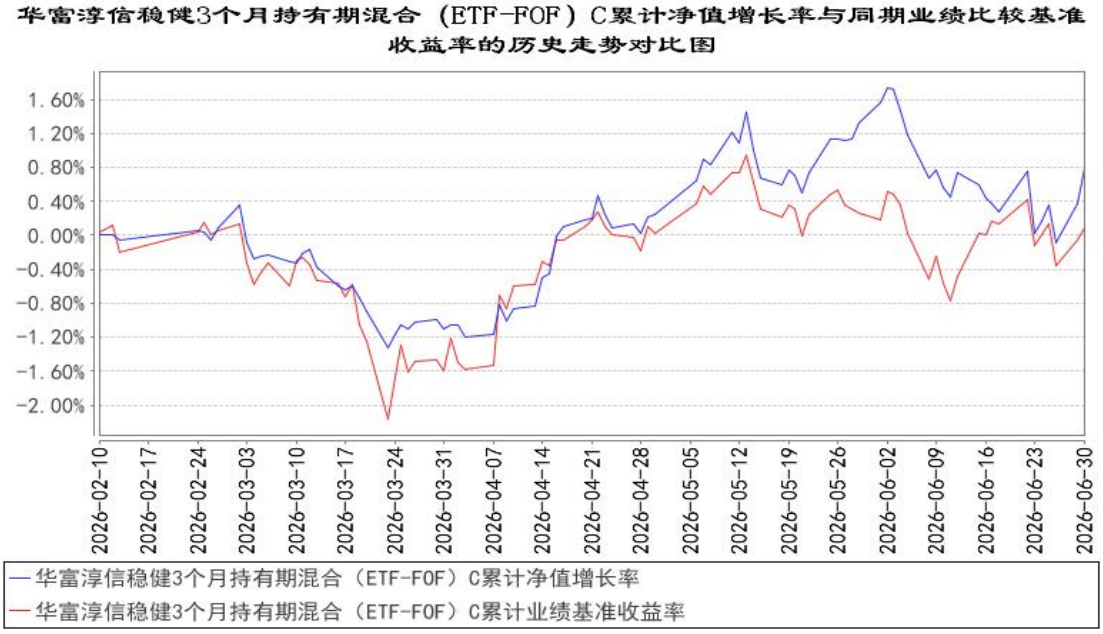
华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）C

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.91% | 0.25% | 1.71% | 0.26% | 0.20% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.78% | 0.23% | 0.09% | 0.27% | 0.69% | -0.04% |

注：业绩比较基准收益率=中债-新综合全价(总值)指数收益率*73%+中证 800 指数收益率*15%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*5%+活期存款基准利率(税后)*5%+上海黄金交易所 AU99.99 现货实盘合约收益率*2%

### 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




注：截至本报告披露日，本基金的基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2026 年 2 月 10 日到 2026 年 8 月 10 日。本报告期内，本基金仍在建仓期。

本报告期内，本基金严格执行了《华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）基金合同》的相关规定。

# §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

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富安业一年持有期债券型证券投资基金、华富消费成长股票型证券投资基金、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、华富时

代锐选混合型证券投资基金、华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富匠心领航 18 个月持有期混合型证券投资基金、华富数字经济混合型证券投资基金、华富荣盛一年持有期混合型证券投资基金、华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金、华富泰合平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华富恒享纯债债券型证券投资基金、华富恒惠纯债债券型证券投资基金、华富半导体产业混合型发起式证券投资基金、华富祥晖 6 个月持有期债券型证券投资基金、华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金、华富鼎信 3 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、华富新华中诚信红利价值指数型证券投资基金、华富吉福 120 天滚动持有债券型证券投资基金、华富中证港股通创新药指数型发起式证券投资基金、华富华证沪深港汽车制造主题指数型发起式证券投资基金、华富祥康 12 个月持有期债券型证券投资基金、华富富润债券型证券投资基金、华富中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富沪深 300 指数增强型证券投资基金、华富富源三个月持有期债券型证券投资基金、华富医疗创新混合型发起式证券投资基金、华富中证 A500 指数型证券投资基金、华富安顺一年持有期债券型证券投资基金、华富福盛一年持有期混合型证券投资基金、华富安康三个月持有期债券型证券投资基金、华富安和债券型证券投资基金、华富富泽六个月持有期债券型证券投资基金、华富安颐九个月持有期债券型证券投资基金、华富裕诚一年持有期债券型证券投资基金、华富天华货币市场基金、华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）、华富安沣债券型证券投资基金、华富淳丰保守养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）共九十只基金。

### 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 | | |
| 严律 | 本基金基金经理、FOF 投资部副总监、FOF 投资决策委员会主任委员 | 2026 年 2 月 10 日 | - | 十六年 | 清华大学管理学硕士，硕士研究生学历。历任中航证券投行部高级经理、中信证券权益投资部高级副总裁、上汽财务有限责任公司权益投资部权益投资主管、杭银理财权益投资部总监。2023 年 4 月加入华富基金管理有限公司，自 2024 年 3 月 5 日起任华富泰合平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理，自 2025 年 1 月 24 日起任华富鼎信 3 个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金经理，自 2026 年 2 月 10 日起任华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金(ETF-FOF)基金经理，自 2026 年 4 月 28 日起任华富淳丰保守养 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理，具有基金从业资格。 |

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

## 4.2 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，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

## 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

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在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%的情形。

## 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

境内权益市场：

2026年上半年，A股主要宽基指数多数收涨但分化显著。一季度，中东地缘冲突升级、油价攀升及美联储降息预期后移压制风险偏好，市场震荡调整；二季度，美伊停火协议达成、油价回落，滞胀担忧消退，市场放量反弹。上半年，科创50以64.25%领涨主要宽基指数，创业板指与深证成指分别上涨35.58%和19.82%，沪深300与上证指数上涨7.55%和3.16%，上证50微跌1.38%。

从中信一级行业表现来看，2026年上半年科技相关方向涨幅领先，其中电子、通信、建材涨幅居前，分别达到85.49%、74.54%和43.70%；其余行业多数下跌，农林牧渔、综合金融和消费者

服务表现靠后，分别下跌24.76%、29.58%和31.88%。

风格上，2026年上半年国证成长上涨19.19%，国证价值下跌8.40%，市场分化明显。分化的根源在于宏观与产业逻辑共振：国内经济延续弱复苏，内需修复偏慢，传统板块缺乏盈利增长支撑；与此同时，全球资本逐渐向AI产业链高度集中，资金持续从价值与红利板块虹吸至成长赛道。这种极致的市场行情需要密切监测风格是否切换。大量情绪化资金持续涌入推高 AI 板块交易拥挤度，短期或催生局部市场泡沫。而传统价值和红利板块在大幅调整后，防御的价值正愈发显现。

境内债券市场：

2026年上半年，境内债券市场呈现震荡上行格局。货币政策延续适度宽松基调，市场流动性保持合理充裕，主要债券品种收益率重心下移、指数稳步走强。

具体来看，2026年上半年，利率债各期限品种均录得正收益。中债-0-3年国开行债券财富（总值）指数上涨1.12%，上证5年国债指数上涨0.71%，上证10年期国债指数上涨2.33%，中债-30年期国债财富指数上涨2.57%。信用债方面，各品种表现同样亮眼，中债-信用债总财富（1-3年）指数上涨1.55%，中债-信用债总财富（3-5年）指数上涨2.42%，中债-信用债总财富（5-7年）指数上涨3.04%。

总体而言，在配置需求旺盛、货币政策宽松延续以及经济弱修复等宏观背景下，2026年上半年债券市场整体表现良好。债券类资产在复杂市场环境中体现出稳健的配置价值，为投资者提供了相对确定的收益来源。

港股、海外及商品市场

2026年上半年，港股在全球主要市场中表现偏弱。恒生指数与恒生科技指数分别下跌10.73%与18.92%，背后是盈利预期系统性下修、流动性边际收缩与微观供给压力三重共振的结果，叠加港股的AI硬件含量相对偏低，未能充分受益于本轮AI硬件行情。

美股市场2026年上半年先抑后扬，一季度受中东地缘冲突紧张局势及AI盈利兑现能力疑虑扰动，三大指数集体收跌；二季度则在AI投资热潮延续、地缘风险降温及市场风险偏好修复的合力推动下强势反弹并创出历史新高。上半年纳斯达克、标普500与道琼斯指数分别上涨12.79%、9.55%与8.85%。但需警惕的是，美联储在新任主席主导下可能基调转鹰，市场重新开始定价年内加息可能，叠加油价推升的通胀粘性与科技股的拥挤交易，美股可能短期面临震荡偏弱局面。

黄金方面，2026年上半年金价大起大落。伦敦金现货于1月底触及历史峰值后持续回撤，上半年累计下跌7.20%。美联储政策预期由鸽转鹰、美元走强、美债实际利率上行及地缘避险需求退潮，共同构成金价承压的核心驱动。短期金价或延续震荡格局，但全球央行购金的结构性趋势并未逆转，去美元化进程与储备多元化需求仍为金价提供中长期支撑。

操作上来看，2026 年上半年基金主要进行以下操作：一是完成新基金建仓，权益、固收及其他资产达到合同允许且适宜的配置比例；二是密切跟踪全球产业趋势，适时配置科技成长类权益资产；三是紧密监控市场极端环境下的行业拥挤度变化，适时通过降低仓位或左侧逆向布局等方式，降低产品的波动和回撤，将产品风险指标控制在预定范围。

本基金是一只混合型 FOF 基金，以绝对收益为投资导向。本基金是从“贝塔管理”的角度来进行多资产组合投资，我们相信资产配置是 FOF 成功的关键因素。在当前国内外复杂的宏观形势下，市场的波动性明显增强，使很多原有的投资框架和逻辑面临挑战，大类资产配置正扮演着“选择比努力更重要”的作用。

本基金始终将风险管理置于投资的首要考虑因素，致力于最大可能降低组合回撤，最大可能提升投资者的持有体验，陪伴投资者实现真正的财富增值。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）A 份额净值为 1.0094 元，累计份额净值为 1.0094 元。报告期，华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）A 份额净值增长率为 0.94%,同期业绩比较基准收益率为 0.09%。截止本期末,华富淳信稳健 3 个月持有期混合(ETF-FOF) C 份额净值为 1.0078 元，累计份额净值为 1.0078 元。报告期，华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）C 份额净值增长率为 0.78%,同期业绩比较基准收益率为 0.09%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下一阶段，国内层面，重点把握“稳预期、稳市场”系列政策的落地效果，持续跟踪地产修复进程、地方债务化解及金融风险处置的推进节奏，同时观察需求端稳增长政策的接续落地力度，验证经济修复的延续性。国际层面，重点关注美联储货币政策路径的动态调整，以及海外地缘博弈对大宗商品价格与全球通胀预期的外部扰动。权益市场方面，以 AI 产业链为核心的科技成长仍是当前产业升级与经济增长的核心主线，高股息价值板块具备良好的底仓配置性价比，在市场波动放大的背景下需做好仓位均衡与风险管控。债券市场延续“信用债打底、利率债区间交易”的整体策略。黄金行情与海外地缘局势、全球流动性高度联动，整体将维持震荡走势，行情需等待实际利率与避险情绪的再度共振。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管

理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

### 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出现基金份额持有人数量不满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，东方财富证券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损害基金份额持有人利益的行为。

### 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：华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| **资 产：** | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 7,743,045.99 |
| 结算备付金 | | - |
| 存出保证金 | | - |

| | | |
|---|---|---|
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 232,733,546.17 |
| 其中：股票投资 | | 13,289,052.00 |
| 基金投资 | | 206,914,389.29 |
| 债券投资 | | 12,530,104.88 |
| 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 | - |
| 应收清算款 | | - |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 10,493.93 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - |
| 资产总计 | | 240,487,086.09 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2026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 | | 1,554,306.67 |
| 应付管理人报酬 | | 125,438.04 |
| 应付托管费 | | 21,277.67 |
| 应付销售服务费 | | 61,733.49 |
| 应付投资顾问费 | | - |
| 应交税费 | | 21,847.52 |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 80,044.29 |
| 负债合计 | | 1,864,647.68 |
| **净资产：** | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 236,675,006.87 |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 1,947,431.54 |
| 净资产合计 | | 238,622,438.41 |
| 负债和净资产总计 | | 240,487,086.09 |

注：本基金合同生效日为2026年02月10日，无上年度末数据。报告截止日2026年06月30日，基金份额总额236,675,006.87份，其中华富淳信稳健3个月持有期混合（ETF-FOF）A基金份额总额59,997,942.33份，基金份额净值1.0094元；华富淳信稳健3个月持有期混合（ETF-FOF）C基金份额总额176,677,064.54份，基金份额净值1.0078元。

## 6.2 利润表

会计主体：华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）

本报告期：2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 3,873,603.72 |
| 1.利息收入 | | 214,520.28 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 25,698.76 |
| 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 | | 188,821.52 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 1,035,794.66 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -303,154.11 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.15 | 1,027,194.17 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.16 | 73,428.48 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.17 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.18 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.19 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.20 | 238,326.12 |
| 其他投资收益 | | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | 2,221,518.40 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.22 | 401,770.38 |
| **减：二、营业总支出** | | 1,262,210.90 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 668,669.37 |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 112,549.19 |
| 3．销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 330,889.89 |
| 4．投资顾问费 | | - |
| 5．利息支出 | | 64,233.62 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 64,233.62 |
| 6．信用减值损失 | 6.4.7.24 | - |
| 7．税金及附加 | | 5,024.54 |
| 8．其他费用 | 6.4.7.25 | 80,844.29 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 2,611,392.82 |
| 减：所得税费用 | | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 2,611,392.82 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - |
| **六、综合收益总额** | | 2,611,392.82 |

注：本基金合同于 2026 年 02 月 10 日生效，无上年度可比期间。

## 6.3 净资产变动表

会计主体：华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）

本报告期：2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 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 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 303,108,339.25 | - | - | 303,108,339.25 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -66,433,332.38 | - | 1,947,431.54 | -64,485,900.84 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 2,611,392.82 | 2,611,392.82 |
| （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） | -66,433,332.38 | - | -663,961.28 | -67,097,293.66 |
| 其中：1.基金申购款 | 13,224,833.80 | - | 31,939.17 | 13,256,772.97 |
| 2.基金赎回款 | -79,658,166.18 | - | -695,900.45 | -80,354,066.63 |
| （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 | 236,675,006.87 | - | 1,947,431.54 | 238,622,438.41 |

注：本基金合同于 2026 年 02 月 10 日生效，无上年度可比期间。

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：

| 余海春 | 曹华玮 | 束庆斌 |
|---|---|---|
| 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

华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）（以下简称本基金或基金）经中国证监会 2025 年证监许可【2025】2697 号核准，基金合同于 2026 年 2 月 10 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位情况经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具《验资报告》（容诚验字[2026]200Z0013 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。本基金的管理人为华富基金管理有限公司，基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为东方财富证券股份有限公司。

根据《华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）基金合同》的规定，本基金的投资范围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（含公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”）、QDII 基金、商品基金（包括但不限于商品期货基金和黄金 ETF）、香港互认基金及其他经中国证监会核准或注册的基金，下同）、国内依法发行或上市的股票和存托凭证（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票和存托凭证）、港股通标的证券（包括股票和 ETF）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、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的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照企业会计准则及其应用指南、准则解释及其他相关规定（包括《资产管理产品相关会计处理规定》）（以下统称企业会计准则）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集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》《证券投资基金会计核算业务指引》基金合同和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

### 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，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财

务状况、经营成果和净资产变动等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期会计报表的实际编制期间为 2026 年 2 月 10 日至 2026 年 6 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

（1）金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列

示为交易性金融资产。

(2)金融负债

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和以摊余成本计量的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内（若预期存续期少于12个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1） 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2） 该金融资产已转移，且本基金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；或者（3） 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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）当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1） 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2） 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分或折算日根据拆分或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算确认。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占净资产比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应

取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为：按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费（若有）在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

本基金同一类/级别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 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入账。

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

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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） 本基金的基金管理人能够定期评价该组

成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3） 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

（4）对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布<基金中基金估值业务指引（试行）>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》，采用如下方法估值：

（a）对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

（b）对于境内上市开放式基金（LOF）及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

（c）对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益；

（d）对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

（a）以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值；

（b）以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值；

（c）如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会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[2015]101号《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》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值

税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部　税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。2027年12月31日前，资管产品管理人运营契约制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。2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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<br>2026年6月30日 |
|---|---|
| 活期存款 | 3,951,678.73 |
| 等于：本金 | 3,948,839.13 |
| 加：应计利息 | 2,839.60 |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 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 | 3,791,367.26 |
| 等于：本金 | 3,791,291.23 |
| 加：应计利息 | 76.03 |
| 合计 | 7,743,045.99 |

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2026年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 13,825,742.14 | - | 13,289,052.00 | -536,690.14 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 12,410,695.19 | 121,424.88 | 12,530,104.88 | -2,015.19 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 12,410,695.19 | 121,424.88 | 12,530,104.88 | -2,015.19 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | 204,154,165.56 | - | 206,914,389.29 | 2,760,223.73 |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 230,390,602.89 | 121,424.88 | 232,733,546.17 | 2,221,518.40 |

### 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

无。

#### 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

无。

### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

### 6.4.7.5 其他资产

无。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 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 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 应付审计费 | 19,305.72 |
| 应付信息披露费 | 60,738.57 |
| 合计 | 80,044.29 |

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）A

| 项目 | 本期<br>2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 75,829,303.85 | 75,829,303.85 |
| 本期申购 | 7,161,283.22 | 7,161,283.22 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -22,992,644.74 | -22,992,644.74 |
| 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 | 59,997,942.33 | 59,997,942.33 |

华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）C

| 项目 | 本期 |
|---|---|

| | 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 227,279,035.40 | 227,279,035.40 |
| 本期申购 | 6,063,550.58 | 6,063,550.58 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -56,665,521.44 | -56,665,521.44 |
| 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 | 176,677,064.54 | 176,677,064.54 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-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 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 253,496.66 | 486,662.12 | 740,158.78 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -93,401.10 | -83,352.09 | -176,753.19 |
| 其中：基金申购款 | -25,045.40 | 10,991.96 | -14,053.44 |
| 基金赎回款 | -68,355.70 | -94,344.05 | -162,699.75 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 160,095.56 | 403,310.03 | 563,405.59 |

华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-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 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 136,377.76 | 1,734,856.28 | 1,871,234.04 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 60,634.37 | -547,842.46 | -487,208.09 |
| 其中：基金申购款 | -3,980.32 | 49,972.93 | 45,992.61 |
| 基金赎回款 | 64,614.69 | -597,815.39 | -533,200.70 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 197,012.13 | 1,187,013.82 | 1,384,025.95 |

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 24,557.54 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 1,141.22 |

| | |
|---|---|
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 25,698.76 |

注：1.“其他”包含结算保证金利息收入及认申购款利息收入。

2.其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

### 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

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -303,154.11 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | -303,154.11 |

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 19,011,177.00 |
| 减：卖出股票成本总额 | 19,278,766.86 |
| 减：交易费用 | 35,564.25 |
| 买卖股票差价收入 | -303,154.11 |

#### 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<br>2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 卖出/赎回基金成交总额 | 698,363,024.41 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 697,011,650.37 |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | 39,360.40 |
| 减：交易费用 | 284,819.47 |
| 基金投资收益 | 1,027,194.17 |

### 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<br>2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 债券投资收益——利息收入 | 81,801.52 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -8,373.04 |
| 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 | 73,428.48 |

#### 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<br>2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 3,942,405.82 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 3,903,363.81 |
| 减：应计利息总额 | 37,452.82 |
| 减：交易费用 | 9,962.23 |
| 买卖债券差价收入 | -8,373.04 |

#### 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项目构成

无。

#### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

### 6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

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

无。

### 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<br>2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 21,281.40 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | 217,044.72 |
| 合计 | 238,326.12 |

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 2,221,518.40 |
| 股票投资 | -536,690.14 |
| 债券投资 | -2,015.19 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | 2,760,223.73 |
| 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 | 2,221,518.40 |

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
| --- | --- |
| 基金赎回费收入 | 401,760.26 |
| 基金转换费收入 | 10.12 |
| 合计 | 401,770.38 |

### 6.4.7.19 持有基金产生的费用

| 项目 | 本期<br>2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
| --- | --- |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 903.64 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 197,681.51 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 57,142.14 |

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、管理费和托管费进行的估算；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

无。

### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
| --- | --- |
| 审计费用 | 19,305.72 |
| 信息披露费 | 60,738.57 |
| 证券出借违约金 | - |
| 其他 | 800.00 |
| 合计 | 80,844.29 |

### 6.4.7.22 分部报告

无。

## 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

无。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方、关联关系

### 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

### 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 |
| --- | --- |
| 华富基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 东方财富证券股份有限公司（“东方财富证券”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 华安证券股份有限公司（“华安证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同于2026年02月10日生效，无上年度可比期间。

### 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

无。

### 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<br>2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
| --- | --- |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 668,669.37 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 299,967.07 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 368,702.30 |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额×0.60%÷当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 112,549.19 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为： 日托管费＝前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额× 0.10%÷当年天数。

### 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<br>2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）A | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）C | 合计 |
| 华富基金管理有限公司 | - | - | - |
| 东方财富证券 | - | 664.83 | 664.83 |
| 华安证券 | - | 10.29 | 10.29 |
| 合计 | - | 675.12 | 675.12 |

注：本基金 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 类基金资产净值的 0.40%年费率每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。计算公式 H=E×年销售服务费率÷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

无。

### 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

无。

### 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

无。

### 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

本报告期内本基金管理人没有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

本基金本报告期基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

### 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<br>2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 东方财富证券 | 3,951,678.73 | 24,557.54 |

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

### 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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有基金管理人所管理的公开募集证券投资基金合计 5,159,577.40 元，占本基金资产净值的比例为 2.16%。

### 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<br>2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 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） | - |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 5,592.11 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 1,118.34 |
| 当期交易基金产生的交易费（元） | 16,042.50 |

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金(ETF 除外)，应当通过基金管理人的直 销渠道且不得收取申购费、赎回费(按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费

除 外)、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生 的申购费为零，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分 的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资 基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定 的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

### 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（2026 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

无。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 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余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无未到期交易所市场债券正回购。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 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

本基金在日常经营活动中面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司

的内部风险控制情况。公司设有独立的风险管理部、监察稽核部，对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

#### 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约责任，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信用良好的银行，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，在场外申赎基金份额均通过该基金的基金管理人的直销柜台或经批准的其他销售机构办理，违约可能性很小；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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

#### 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时间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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易或通过基金销售机构申购、赎回。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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。除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，本基金所持有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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2026 年 6 月 30 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 7,743,045.99 | - | - | - | - | - | 7,743,045.99 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | - | 12,530,104.88 | - | - | 220,203,441.29 | 232,733,546.17 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 10,493.93 | 10,493.93 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 7,743,045.99 | - | 12,530,104.88 | - | - | 220,213,935.22 | 240,487,086.09 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 1,554,306.67 | 1,554,306.67 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 125,438.04 | 125,438.04 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 21,277.67 | 21,277.67 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 61,733.49 | 61,733.49 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 21,847.52 | 21,847.52 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 80,044.29 | 80,044.29 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 1,864,647.68 | 1,864,647.68 |
| 利率敏感度缺口 | 7,743,045.99 | - | 12,530,104.88 | - | - | 218,349,287.54 | 238,622,438.41 |

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 1.除利率外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 （2026年6月30日） |
| | 市场利率下降25基点 | 9,071.16 |
| | 市场利率上升25基点 | -9,057.92 |

### 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。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 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<br>2026 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 | 13,289,052.00 | 5.57 |
| 交易性金融资产－基金投资 | 206,914,389.29 | 86.71 |
| 交易性金融资产－债券投资 | 12,530,104.88 | 5.25 |
| 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 | 232,733,546.17 | 97.53 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 1.除沪深 300 指数外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 （2026 年 6 月 30 日） |
| | 沪深 300 指数上升百分之五 | 3,373,477.35 |
| | 沪深 300 指数下降百分之五 | -3,373,477.35 |

## 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<br>2026年6月30日 |
| --- | --- |
| 第一层次 | 220,203,441.29 |
| 第二层次 | 12,530,104.88 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 232,733,546.17 |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关证券的公允价值列入第一层次；对于处于封闭期的基金投资，本基金不会将相关基金的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末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 | 13,289,052.00 | 5.53 |
| | 其中：股票 | 13,289,052.00 | 5.53 |
| 2 | 基金投资 | 206,914,389.29 | 86.04 |
| 3 | 固定收益投资 | 12,530,104.88 | 5.21 |
| | 其中：债券 | 12,530,104.88 | 5.21 |
| | 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 | 7,743,045.99 | 3.22 |
| 8 | 其他各项资产 | 10,493.93 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 240,487,086.09 | 100.00 |

## 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

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | - | - |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,318,572.00 | 4.74 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 1,970,480.00 | 0.83 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 13,289,052.00 | 5.57 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600900 | 长江电力 | 427,600 | 11,318,572.00 | 4.74 |
| 2 | 601288 | 农业银行 | 179,000 | 1,086,530.00 | 0.46 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 24,900 | 883,950.00 | 0.37 |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600900 | 长江电力 | 17,217,268.00 | 7.22 |
| 2 | 601939 | 建设银行 | 4,654,512.00 | 1.95 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 4,486,067.00 | 1.88 |
| 4 | 601988 | 中国银行 | 3,144,940.00 | 1.32 |
| 5 | 601288 | 农业银行 | 2,139,626.00 | 0.90 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 1,462,096.00 | 0.61 |

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600900 | 长江电力 | 5,433,539.00 | 2.28 |
| 2 | 601939 | 建设银行 | 4,658,767.00 | 1.95 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 4,403,370.00 | 1.85 |
| 4 | 601988 | 中国银行 | 3,093,971.00 | 1.30 |
| 5 | 601288 | 农业银行 | 925,320.00 | 0.39 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 496,210.00 | 0.21 |

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 33,104,509.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 19,011,177.00 |

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

## 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 | 12,530,104.88 | 5.25 |
| 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 | 12,530,104.88 | 5.25 |

## 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 | 019792 | 25国债19 | 124,000 | 12,530,104.88 | 5.25 |

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

## 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

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

1.基金投资政策

（1）ETF 投资策略

对于 ETF 基金，本基金主要通过其跟踪基准以及配合市场、行业板块轮动等进行优选配置，增强投资回报。本基金使用日最大跟踪偏离度、累计跟踪偏离度、日均跟踪偏离度、跟踪误差等指标评估其投资风格、收益情况、波动性以及回撤等并考虑子基金的基金规模、是否是市场基准指数等因素，选择优质标的进行投资。

（2）其他基金投资策略

1）关于主动管理的股票型基金和混合型基金的选择，本基金将采用定量分析和定性分析相结合的方法对主动管理的股票型基金和混合型基金进行选择，精选长期业绩优胜的基金经理管理的产品。定量分析侧重关注基金的风险收益指标、业绩排名、择时和择股能力、行业配置情况、投资集中度、换手率、波动率、最大回撤等指标。定性分析通过对基金公司和基金经理的调研对影响基金投资管理的各个因素进行分析。侧重关注基金经理的投资理念、投资流程、投资风格等因素。

2）关于主动管理的债券型基金的选择，本基金将首先根据投资范围、期限结构、信用等级等信息，对债券型基金进行分类。再综合基金的运作时间、资产规模、风险收益指标、历史信用风险事件、费率水平、申购赎回限制、运作周期等因素优选基金，进行配置。精选具有良好风险控制能力和完善投研治理水平的固定收益投研团队所管理的产品。

3）关于货币市场基金的选择，本基金投资货币市场基金主要以流动性管理以及降低投资组合整体波动率水平为目标。基金管理人将综合考虑货币市场基金的规模、流动性、费率、交易方式等因素，优选货币市场基金进行配置。

4）关于场外指数基金和商品基金的选择，本基金将基于资产配置的结果，综合基金规模、流动性、跟踪误差、费率水平等因素，优选风格特征明确、交易成本低、流动性良好的场外指数基金和商品基金进行配置。

5）本基金可投资公募 REITs。本基金将综合考量宏观经济运行情况、基金资产配置策略、底层资产运营情况、流动性及估值水平等因素，对公募 REITs 的投资价值进行深入研究，精选出具有较高投资价值的公募 REITs 进行投资。本基金根据投资策略需要或市场环境变化，可选择将部

分基金资产投资于公募REITs，但本基金并非必然投资公募REITs。

2. 风险说明

（1）本基金为混合型基金中基金，在基金份额净值披露时间、基金份额申购赎回申请的确认时间、基金暂停估值、暂停申购赎回等方面的运作不同于其他开放式基金，面临一定的特殊风险。

（2）本基金为基金中基金，80%以上的基金资产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，因此本基金所持有基金的业绩表现、所持有基金的管理人水平等因素将影响到本基金的业绩表现。此外，本基金除了投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费、投资于本基金托管人所托管的公开募集证券投资基金的部分不收取托管费、申购自身管理的基金（ETF除外）不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用外，基金中基金承担的相关基金费用可能比普通的开放式基金高。

（3）本基金的投资范围包括QDII基金，因此本基金可能间接面临海外市场风险、汇率风险、法律和政治风险、会计制度风险、税务风险等风险。

（4）公募REITs投资风险

公募REITs采用“公募基金+基础设施资产支持证券”的产品结构，主要特点如下：一是公募REITs与投资股票或债券的公募基金具有不同的风险收益特征，80%以上基金资产投资于基础设施资产支持证券，并持有其全部份额，基金通过基础设施资产支持证券持有基础设施项目公司全部股权，穿透取得基础设施项目完全所有权或经营权利；二是公募REITs以获取基础设施项目租金、收费等稳定现金流为主要目的，收益分配比例不低于合并后基金年度可供分配金额的90%；三是公募REITs采取封闭式运作，不开放申购与赎回，在证券交易所上市，场外份额持有人需将基金份额转托管至场内才可卖出或申报预受要约。投资公募REITs可能面临以下风险，包括但不限于：

1）基金价格波动风险

公募REITs大部分资产投资于基础设施项目，具有权益属性，受经济环境、运营管理等因素影响，基础设施项目市场价值及现金流情况可能发生变化，可能引起公募REITs价格波动，甚至存在基础设施项目遭遇极端事件（如地震、台风等）发生较大损失而影响基金价格的风险。

2）基础设施项目运营风险

公募REITs投资集中度高，收益率很大程度依赖基础设施项目运营情况，基础设施项目可能因经济环境变化或运营不善等因素影响，导致实际现金流大幅低于测算现金流，存在基金收益率不佳的风险，基础设施项目运营过程中租金、收费等收入的波动也将影响基金收益分配水平的稳定。此外，公募REITs可直接或间接对外借款，存在基础设施项目经营不达预期，基金无法偿还

借款的风险。

3）基金份额交易价格折溢价风险

公募REITs基金合同生效后，将根据相关法律法规和交易所规定申请在交易所上市，在每个交易日的交易时间将根据相关交易规则确定交易价格，该交易价格可能受诸多因素影响；此外，公募REITs还将按照相关业务规则、基金合同约定进行估值并披露基金份额净值等信息。由于基金份额交易价格与基金份额净值形成机制以及影响因素不同，存在基金份额交易价格相对于基金份额净值折溢价的风险。

4）流动性风险

公募REITs采取封闭式运作，不开通申购赎回，只能在二级市场交易，存在流动性不足的风险。此外，公募REITs持有所投资的基础设施资产支持证券的全部份额，如发生特殊情况需要处置基础设施资产支持证券，可能会由于基础设施资产支持证券流动性较弱而带来损失（如证券不能卖出或贬值出售等）。基础设施资产支持证券通过项目公司持有的基础设施资产可能会存在无法处置及变现

5）终止上市风险

公募REITs运作过程中可能因触发法律法规或交易所规定的终止上市情形而终止上市，导致投资者无法在二级市场交易。

6）政策调整风险

公募REITs存在因相关法律法规修改或监管机构政策变更等基金管理人无法控制的因素的变化，使基金或投资者利益受到影响的风险，例如：公募REITs运作过程中可能涉及基金份额持有人、公募基金、资产支持证券、项目公司等多层面税负，如果国家税收等政策发生调整，可能影响投资运作与基金收益；监管机构基金估值政策的修改导致基金估值方法的调整而引起基金净值波动；相关法规的修改导致基金投资范围变化，基金管理人为调整投资组合而引起基金净值波动等。

7）利益冲突风险

公募REITs基金管理人可能同时管理多只同类型的公募REITs；公募REITs基金管理人聘请的运营管理机构可能持有或为其他同类型的基础设施项目提供运营管理服务；公募REITs原始权益人也可能持有或管理其他同类型的基础设施项目等。由于上述情况，公募REITs的关联方可能与公募REITs存在一定的利益冲突。

8）公募REITs相关法律法规和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改，或者制定新的法律法规和业务规则，投资者应当及时予以关注和了解。

## 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所有基金投资明细

| 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 | 511110 | 易方达上证基准做市公司债 ETF | 交易型开放式(ETF) | 325,000.00 | 33,414,550.00 | 14.00 | 否 |
| 2 | 511030 | 平安中高等级公司债利差因子 ETF | 交易型开放式(ETF) | 274,900.00 | 29,705,419.10 | 12.45 | 否 |
| 3 | 511070 | 南方上证基准做市公司债 ETF | 交易型开放式(ETF) | 222,500.00 | 22,818,487.50 | 9.56 | 否 |
| 4 | 511520 | 富国中债 7-10 年政策性金融债 ETF | 交易型开放式(ETF) | 149,400.00 | 17,623,074.60 | 7.39 | 否 |
| 5 | 511360 | 海富通中证短融 ETF | 交易型开放式(ETF) | 102,800.00 | 11,679,108.00 | 4.89 | 否 |
| 6 | 511090 | 鹏扬中债-30 年期国债 ETF | 交易型开放式(ETF) | 99,700.00 | 11,646,654.90 | 4.88 | 否 |
| 7 | 511100 | 华夏上证基准做市国债 ETF | 交易型开放式(ETF) | 92,800.00 | 10,149,536.00 | 4.25 | 否 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 8 | 511200 | 华夏上证基准做市公司债ETF | 交易型开放式(ETF) | 93,100.00 | 9,578,128.00 | 4.01 | 否 |
| 9 | 511260 | 上证10年期国债ETF | 交易型开放式(ETF) | 43,200.00 | 5,825,692.80 | 2.44 | 否 |
| 10 | 588290 | 华安上证科创板芯片ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,045,600.00 | 5,051,293.60 | 2.12 | 否 |
| 11 | 588200 | 嘉实上证科创板芯片ETF | 交易型开放式(ETF) | 834,800.00 | 4,120,572.80 | 1.73 | 否 |
| 12 | 515980 | 华富中证人工智能产业ETF | 交易型开放式(ETF) | 2,806,200.00 | 3,664,897.20 | 1.54 | 是 |
| 13 | 588080 | 易方达上证科创板50ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,547,574.00 | 3,517,635.70 | 1.47 | 否 |
| 14 | 511130 | 博时上证30年期国债ETF | 交易型开放式(ETF) | 32,700.00 | 3,478,658.70 | 1.46 | 否 |
| 15 | 588000 | 华夏上证科创板50成份ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,203,500.00 | 2,821,004.00 | 1.18 | 否 |
| 16 | 510500 | 南方中证500ETF | 交易型开放式(ETF) | 283,500.00 | 2,606,499.00 | 1.09 | 否 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 17 | 159819 | 易方达中证人工智能主题ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,071,600.00 | 2,391,811.20 | 1.00 | 否 |
| 18 | 513500 | 博时标普500ETF | 交易型开放式(ETF) | 848,200.00 | 2,106,080.60 | 0.88 | 否 |
| 19 | 512070 | 易方达沪深300非银ETF | 交易型开放式(ETF) | 2,266,300.00 | 1,776,779.20 | 0.74 | 否 |
| 20 | 588800 | 华夏上证科创板100ETF | 交易型开放式(ETF) | 784,600.00 | 1,729,258.40 | 0.72 | 否 |
| 21 | 515070 | 华夏中证人工智能主题ETF | 交易型开放式(ETF) | 580,700.00 | 1,633,509.10 | 0.68 | 否 |
| 22 | 159632 | 华安纳斯达克100ETF(QDII) | 交易型开放式(ETF) | 620,900.00 | 1,528,034.90 | 0.64 | 否 |
| 23 | 561800 | 华富中证稀有金属主题ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,214,200.00 | 1,494,680.20 | 0.63 | 是 |
| 24 | 510300 | 华泰柏瑞沪深300ETF | 交易型开放式(ETF) | 259,300.00 | 1,301,426.70 | 0.55 | 否 |
| 25 | 562500 | 华夏中证机器人ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,090,200.00 | 1,253,730.00 | 0.53 | 否 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 26 | 515220 | 国泰中证煤炭ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,169,200.00 | 1,247,536.40 | 0.52 | 否 |
| 27 | 512890 | 华泰柏瑞中证红利低波动ETF | 交易型开放式(ETF) | 980,400.00 | 1,046,086.80 | 0.44 | 否 |
| 28 | 512700 | 南方中证银行ETF | 交易型开放式(ETF) | 744,400.00 | 1,005,684.40 | 0.42 | 否 |
| 29 | 513400 | 道琼斯ETF | 交易型开放式(ETF) | 765,100.00 | 999,985.70 | 0.42 | 否 |
| 30 | 513520 | 华夏野村日经225ETF | 交易型开放式(ETF) | 348,500.00 | 877,174.50 | 0.37 | 否 |
| 31 | 159922 | 嘉实中证500ETF | 交易型开放式(ETF) | 237,100.00 | 867,786.00 | 0.36 | 否 |
| 32 | 513880 | 华安日经225ETF | 交易型开放式(ETF) | 368,800.00 | 858,566.40 | 0.36 | 否 |
| 33 | 159980 | 大成有色金属期货ETF | 交易型开放式(ETF) | 405,500.00 | 833,708.00 | 0.35 | 否 |
| 34 | 512800 | 华宝中证银行ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,092,700.00 | 802,041.80 | 0.34 | 否 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 35 | 159952 | 广发创业板ETF | 交易型开放式(ETF) | 254,300.00 | 673,895.00 | 0.28 | 否 |
| 36 | 159915 | 易方达创业板ETF | 交易型开放式(ETF) | 139,000.00 | 606,596.00 | 0.25 | 否 |
| 37 | 562800 | 嘉实中证稀有金属主题ETF | 交易型开放式(ETF) | 418,500.00 | 477,927.00 | 0.20 | 否 |
| 38 | 159851 | 华宝中证金融科技主题ETF | 交易型开放式(ETF) | 742,400.00 | 462,515.20 | 0.19 | 否 |
| 39 | 159570 | 汇添富国证港股通创新药ETF | 交易型开放式(ETF) | 356,900.00 | 449,337.10 | 0.19 | 否 |
| 40 | 513650 | 南方标普500ETF(QDII) | 交易型开放式(ETF) | 227,800.00 | 425,530.40 | 0.18 | 否 |
| 41 | 159941 | 广发纳指100ETF | 交易型开放式(ETF) | 254,300.00 | 419,086.40 | 0.18 | 否 |
| 42 | 512880 | 国泰中证全指证券公司ETF | 交易型开放式(ETF) | 316,900.00 | 356,829.40 | 0.15 | 否 |
| 43 | 159972 | 5年地债 | 交易型开放式(ETF) | 2,600.00 | 310,037.00 | 0.13 | 否 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 44 | 510760 | 国泰上证综合 ETF | 交易型开放式(ETF) | 225,200.00 | 296,813.60 | 0.12 | 否 |
| 45 | 513090 | 易方达中证香港证券投资主题(港股通)ETF | 交易型开放式(ETF) | 162,200.00 | 288,553.80 | 0.12 | 否 |
| 46 | 516650 | 华夏中证细分有色金属产业主题 ETF | 交易型开放式(ETF) | 152,000.00 | 269,800.00 | 0.11 | 否 |
| 47 | 159652 | 汇添富中证细分有色金属产业主题 ETF | 交易型开放式(ETF) | 139,100.00 | 218,108.80 | 0.09 | 否 |
| 48 | 512000 | 华宝中证全指证券公司 ETF | 交易型开放式(ETF) | 380,200.00 | 204,167.40 | 0.09 | 否 |
| 49 | 511990 | 华宝添益 | 交易型开放式(ETF) | 1.00 | 99.99 | 0.00 | 否 |

## 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

### 7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

### 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 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 10,493.93 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10,493.93 |

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §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） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 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（%） |
| 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）A | 402 | 149,248.61 | 22,000,450.31 | 36.67 | 37,997,492.02 | 63.33 |
| 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）C | 1,554 | 113,691.80 | 4,108,140.52 | 2.33 | 172,568,924.02 | 97.67 |
| 合计 | 1,956 | 120,999.49 | 26,108,590.83 | 11.03 | 210,566,416.04 | 88.97 |

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自份额级别的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

### 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 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混 | 0.00 | 0.0000 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 理人所有从业人员持有本基金 | 合（ETF-FOF）A | | |
| | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）C | 0.00 | 0.0000 |
| | 合计 | 0.00 | 0.0000 |

注：本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）A | 0 |
| | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）A | 0 |
| | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）C | 0 |
| | 合计 | 0 |

注：本期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）A | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合（ETF-FOF）C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2026 年 2 月 10 日）基金份额总额 | 75,829,303.85 | 227,279,035.40 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 7,161,283.22 | 6,063,550.58 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 22,992,644.74 | 56,665,521.44 |
| 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 | 59,997,942.33 | 176,677,064.54 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

# §10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

## 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

本报告期内，基金管理人重大人事变动情况如下：

2026 年 3 月 27 日，经公司董事会审议批准，由公司总经理曹华玮先生代为履行督察长职务，代行期限不超过六个月。

2026 年 6 月 30 日，经公司董事会审议批准，免去尹培俊先生公司副总经理职务。

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期所持有的基金未发生具有重大影响的事件。

## 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

## 10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人不存在受调查或处罚等情况。

### 10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员不存在受调查或处罚等情况。

### 10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人不存在受调查或处罚等情况。

### 10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员不存在受调查或处罚等情况。

## 10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

### 10.8.1 基金租用或者通过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(%) | |
| 山西证券 | 2 | 51,617,936.00 | 99.04 | 285,569.10 | 97.49 | - |
| 华宝证券 | 2 | 497,750.00 | 0.96 | 7,361.81 | 2.51 | - |

注：1）根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称“规定”）（证监会公告[2024]3 号），我公司在综合比较多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的券商租用了基金专用交易单元进行证券投资或委托证券公司办理证券投资。

2）我公司自 2024 年 7 月 1 日起执行法规关于佣金比例的规定，本产品本报告期内佣金比例符合法规有关要求。

3）此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

4）本基金使用券商结算模式，本报告期内管理人选择以上券商作为证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。

### 10.8.2 基金租用或者通过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(%) |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 山西证券 | 20,331,086.89 | 100.00 | 1,998,994,000.00 | 97.89 | - | - | 1,557,821,025.93 | 97.39 |
| 华宝证券 | - | - | 43,180,000.00 | 2.11 | - | - | 41,705,014.41 | 2.61 |

## 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 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）招募说明书 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 1 月 12 日 |
| 2 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）（A 类基金份额）基金产品资料概要 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 1 月 12 日 |
| 3 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）托管协议 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 1 月 12 日 |
| 4 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）基金份额发售公告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 1 月 12 日 |
| 5 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）基金合同 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 1 月 12 日 |
| 6 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）基金合同及招募说明书提示性公告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 1 月 12 日 |
| 7 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）（C 类基金份额）基金产品资料概要 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 1 月 12 日 |
| 8 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）基金合同生效公告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 2 月 11 日 |
| 9 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）开放日常申购、转换转入及定投业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 2 月 11 日 |
| 10 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）（A 类基金份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 2 月 12 日 |
| 11 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）（C 类基金份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 2 月 12 日 |
| 12 | 华富基金管理有限公司关于旗下基金 | 中国证监会基金电子披 | 2026 年 3 月 20 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 露网站及基金管理人网站 | |
| 13 | 华富基金管理有限公司关于总经理代为履行督察长职务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 3 月 28 日 |
| 14 | 华富基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度） | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 3 月 31 日 |
| 15 | 华富基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理相关销售业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 4 月 22 日 |
| 16 | 公募基金管理人华富基金管理有限公司对外行使投票表决权（2025 年度）情况信息披露 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 4 月 23 日 |
| 17 | 华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）开放日常赎回及转换转出业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 5 月 8 日 |

# §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 | - | - | - | - | - | - | - |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 无 | | | | | | | |

注：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

| |
|---|
| 无 |

# §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

1、华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）基金合同

2、华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）托管协议

3、华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）招募说明书

4、报告期内华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）在指定媒介上披露的各项公告

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

**华富基金管理有限公司**

**2026 年 8 月 31 日**