华富富源三个月持有期债券型证券投资基金
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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行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 1 月 1 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 13
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 13

§5 托管人报告 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
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 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 17

§7 投资组合报告 36

7.1 期末基金资产组合情况 36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 37
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 37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 40
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 40
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 40
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 41

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 41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 41
7.11 投资组合报告附注 41
§8 基金份额持有人信息 42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 42
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 42
§9 开放式基金份额变动 43
§10 重大事件揭示 43
10.1 基金份额持有人大会决议 43
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 43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 44
10.4 基金投资策略的改变 44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 44
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 44
10.7 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 44
10.8 其他重大事件 45
§11 影响投资者决策的其他重要信息 46
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 46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 46
§12 备查文件目录 46
12.1 备查文件目录 46
12.2 存放地点 47
12.3 查阅方式 47

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富富源三个月持有期债券型证券投资基金	
基金简称	华富富源三个月持有期债券	
基金主代码	024112	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 8 月 14 日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	41,476,023.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华富富源三个月持有期债券 A	华富富源三个月持有期债券 C
下属分级基金的交易代码	024112	024113
报告期末下属分级基金的份额总额	10,071,736.23 份	31,404,287.61 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	根据对国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合流动性、估值水平、风险偏好等因素，综合评价各类资产的风险收益水平。本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心，在动态避险的基础上，追求适度收益。本基金的资产配置策略、纯固定收益投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货交易策略详见招募说明书等法律文件。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，还将面临港股通机制下因投资环境、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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林之懿	张姗
	联系电话	021-68886996	400-61-95555
	电子邮箱	linzy@hffund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-700-8001	400-61-95555
传真		021-68887997	0755-83195201

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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	余海春	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	华富富源三个月持有期债券 A	华富富源三个月持有期债券 C
本期已实现收益	114,456.64	-108,860.53
本期利润	163,117.68	272,930.15
加权平均基金份额本期利润	0.0067	0.0092
本期加权平均净值利润率	0.66%	0.90%
本期基金份额净值增长率	1.13%	0.92%
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	207,209.56	535,701.96
期末可供分配基金份额利润	0.0206	0.0171
期末基金资产净值	10,278,945.79	31,939,989.57

期末基金份额净值	1.0206	1.0171
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	1.71%	1.37%

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

华富富源三个月持有期债券 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	0.49%	0.19%	1.32%	0.13%	-0.83%	0.06%
过去六个月	1.13%	0.18%	1.17%	0.12%	-0.04%	0.06%
自基金合同生效起至今	1.71%	0.14%	1.11%	0.11%	0.60%	0.03%

华富富源三个月持有期债券 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	0.39%	0.19%	1.32%	0.13%	-0.93%	0.06%
过去六个月	0.92%	0.18%	1.17%	0.12%	-0.25%	0.06%
自基金合同生效起至今	1.37%	0.14%	1.11%	0.11%	0.26%	0.03%

注：业绩比较基准收益率=中债综合全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*8%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*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：本基金由华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划于 2025 年 8 月 14 日变更而来。本基金建仓期为 2025 年 8 月 14 日起至 2026 年 2 月 14 日。建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富富源三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》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		
黄立冬	本基金基金经理、绝对收益部副总监、公司公募投资决策委员会委员	2025 年 8 月 14 日	-	十三年	上海交通大学经济学硕士、硕士研究生学历。历任上海新世纪资信评估投资服务有限公司分析师、华富基金管理有限公司投资经理、平安基金管理有限公司拟任基金经理。2021 年 7 月重新加入华富基金管理有限公司，曾任专户投资部投资经理、总监助理、副总监，自 2024 年 4 月 1 日起任华富安福债券型证券投资基金基金经理，自 2025 年 7 月 21 日起任华富富润债券型证券投资基金基金经理，自 2025 年 8 月 14 日起任华富富源三个月持有期债券型证券投资基金基金经理，自 2025 年 10 月 20 日起任华富福盛一年持有期混合型证

					券投资基金基金经理，自 2025 年 11 月 6 日起任华富富泽六个月持有期债券型证券投资基金基金经理，自 2025 年 11 月 6 日起任华富裕诚一年持有期债券型证券投资基金基金经理，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

报告期内（2026 年上半年），全球宏观环境呈现地缘政治扰动与经济结构分化并行的态势。国内经济整体延续平稳运行，高技术制造业与出口表现出较强韧性，对经济增长形成有效支撑；与此同时，内需修复节奏总体偏慢，房地产投资延续调整态势，部分投资相关产业链仍面临一定压力，经济呈现较为明显的结构分化特征。海外方面，上半年地缘政治局势出现阶段性重大扰动，中东冲突升级导致重要能源通道一度受阻，全球能源价格阶段性大幅上冲；随着各方谈判推进、

局势边际缓和，能源价格从阶段高位明显回落，大宗商品市场随之趋于稳定。海外主要发达经济体通胀仍具较强粘性，美联储延续偏鹰立场，全球流动性环境整体偏紧，对新兴市场资产带来一定压制。

债券市场方面，2026 年上半年整体受益于国内资金面持续宽松的有利环境。政府债券供给节奏偏慢、配置盘季节性资金流入叠加广义资管机构资产适配难度加大逻辑的共同驱动下，债市收益率中枢总体呈下行态势，债券市场表现较好；年中央行阶段性调节资金面，叠加理财机构预防性赎回行为有所出现，债市出现一定幅度回调，但整体仍维持偏强格局。可转债市场方面，上半年整体呈现高位震荡、结构分化加剧的特征。转债估值持续处于历史偏高位置，市场行情越来越向少数高弹性品种集中，不同类型品种的表现发生明显背离：高价转债、高弹性转债以及与科技成长主线映射紧密的品种表现相对强势，而低价转债、偏债型品种在缺乏权益市场系统性行情支撑的背景下，估值修复受到较大制约，整体相对承压。

权益市场方面，2026 年上半年 A 股整体呈现先抑后扬、科技成长占优、结构分化突出的格局。一季度，受海外地缘政治冲突骤然升级及能源价格急剧波动影响，市场整体风险偏好经历较大冲击，宽基指数出现阶段性显著回调；二季度，随着地缘扰动边际钝化、国内 AI 大模型迭代加速与算力需求持续高景气，科技成长产业趋势持续强化，以科创板、创业板为代表的成长指数大幅领涨。行业层面，电子、通信等科技产业链涨幅居前，食品饮料、银行、非银金融等传统价值板块承压明显，行业间分化程度达到历史偏高水平。

2026 年上半年报告期内，本基金债券部分适度增加了组合久期，未参与可转债投资，在控制风险的前提下，力争获取较为稳定的票息收益和资本利得。股票配置方面，报告期内，本基金始终秉持“行业均衡配置、适度轮动”的核心理念。在行业均衡底仓基础上，结合全球再通胀与供给约束等逻辑，组合阶段性对有色金属板块进行了适度超配。此后，受海外货币政策预期反复及国内需求修复节奏偏缓等因素影响，有色板块在阶段性冲高后持续回落，对组合净值形成一定影响。期间，本基金虽对权益仓位进行了防御性调整，但受市场风格快速切换及交易摩擦影响，组合阶段性风险再平衡效果未达预期，权益部分的分散化优势未能得到充分体现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富富源三个月持有期债券 A 份额净值为 1.0206 元，累计份额净值为 1.0206 元。报告期，华富富源三个月持有期债券 A 份额净值增长率为 1.13%,同期业绩比较基准收益率为 1.17%。截止本期末，华富富源三个月持有期债券 C 份额净值为 1.0171 元，累计份额净值为 1.0171 元。报告期，华富富源三个月持有期债券 C 份额净值增长率为 0.92%,同期业绩比较基准收益率为 1.17%。

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 2026 年下半年，本基金将对权益组合进行系统性优化，核心仓位将继续回归行业中性均衡框架，在控制整体波动的前提下于个股层面进行适度优化；如开展卫星仓位轮动，将严格控制单一行业偏离上限，并辅以动态回撤控制机制。我们始终认为，二级债基的稳健属性来自大类资产配置的纪律性和权益底仓的充分分散，任何收益增强都必须以风险可控和回撤可控为前提。后续，本基金将继续立足票息保护，兼顾组合的防御性与灵活性，耐心等待更具确定性的权益配置机会。

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

从 2025 年 12 月 31 日起至 2026 年 3 月 19 日，本基金基金资产净值存在连续二十个工作日低于 5000 万元的情形。从 2026 年 3 月 20 日起至本报告期末（2026 年 6 月 30 日），本基金基金资产净值已不存在连续二十个工作日低于 5000 万元的情形。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产

品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：华富富源三个月持有期债券型证券投资基金

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,230,225.08	461,731.21
结算备付金		-	8,068.24
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	40,895,160.47	45,159,563.42
其中：股票投资		4,123,713.78	2,528,222.52
基金投资		-	-
债券投资		36,771,446.69	42,631,340.90
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	830,000.00	4,999,255.89
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		267.58	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		42,955,653.13	50,628,618.76
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 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		-	-

应付清算款		-	-
应付赎回款		607,236.83	10,345,294.25
应付管理人报酬		32,654.02	27,699.10
应付托管费		8,163.52	6,924.74
应付销售服务费		14,108.16	7,752.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		344.32	563.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	74,210.92	51,068.00
负债合计		736,717.77	10,439,302.76
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	41,476,023.84	39,849,688.91
未分配利润	6.4.7.12	742,911.52	339,627.09
净资产合计		42,218,935.36	40,189,316.00
负债和净资产总计		42,955,653.13	50,628,618.76

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 41,476,023.84 份，其中华富富源三个月持有期债券 A 基金份额总额 10,071,736.23 份，基金份额净值 1.0206 元；华富富源三个月持有期债券 C 基金份额总额 31,404,287.61 份，基金份额净值 1.0171 元。

6.2 利润表

会计主体：华富富源三个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		805,645.70
1.利息收入		14,375.92
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,988.15
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		12,387.77
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		360,818.06
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-348,577.63
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	635,890.86
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	73,504.83

其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	430,451.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-
减：二、营业总支出		369,597.87
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	162,385.47
2．托管费	6.4.10.2.2	40,596.37
3．销售服务费	6.4.10.2.3	59,126.81
4．投资顾问费		-
5．利息支出		27,956.59
其中：卖出回购金融资产支出		27,956.59
6．信用减值损失	6.4.7.22	-
7．税金及附加		342.27
8．其他费用	6.4.7.23	79,190.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		436,047.83
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		436,047.83
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		436,047.83

注：本基金合同于 2025 年 8 月 14 日生效，无上年度可比期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：华富富源三个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 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	39,849,688.91	-	339,627.09	40,189,316.00
二、本期期初净资产	39,849,688.91	-	339,627.09	40,189,316.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,626,334.93	-	403,284.43	2,029,619.36
（一）、综合收益总额	-	-	436,047.83	436,047.83
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	1,626,334.93	-	-32,763.40	1,593,571.53

“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	63,784,870.69	-	1,089,973.10	64,874,843.79
2.基金赎回款	-62,158,535.76	-	-1,122,736.50	-63,281,272.26
（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	41,476,023.84	-	742,911.52	42,218,935.36

注：本基金合同于 2025 年 8 月 14 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

华富富源三个月持有期债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）是由华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划转型而来。根据中国证监会《关于准予华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可【2025】672 号）及本基金的基金管理人于 2025 年 8 月 14 日发布的《华富基金管理有限公司关于华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划变更为华富富源三个月持有期债券型证券投资基金相关业务安排的公告》，自 2025 年 8 月 14 日起，华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划转型为华富富源三个月持有期债券型证券投资基金，《华富富源三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》自该日起生效，《华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划合同》自同一日起失效。本基金以契约型开放式的方式运作，基金存续期限不定。本基金的基金管理人为华富基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资对象主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中期票据、

可转换债券（含可分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、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、国债期货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 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相一致。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,227,975.35
等于：本金	1,227,707.13
加：应计利息	268.22
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	2,249.73
等于：本金	2,234.97
加：应计利息	14.76
合计	1,230,225.08

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 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,778,905.10	-	4,123,713.78	344,808.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	36,267,497.06	364,566.69	36,771,446.69	139,382.94
	合计	36,267,497.06	364,566.69	36,771,446.69	139,382.94
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		40,046,402.16	364,566.69	40,895,160.47	484,191.62

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	830,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	830,000.00	-

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 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	7,883.25
其中：交易所市场	-
银行间市场	7,883.25
应付利息	-
应付审计费	17,356.09
中债账户维护费	4,500.00
应付信息披露费	39,671.58
上清账户维护费	4,800.00
合计	74,210.92

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华富富源三个月持有期债券 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,528,147.66	20,528,147.66
本期申购	21,626,297.78	21,626,297.78

本期赎回（以“-”号填列）	-32,082,709.21	-32,082,709.21
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	10,071,736.23	10,071,736.23

华富富源三个月持有期债券 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,321,541.25	19,321,541.25
本期申购	42,158,572.91	42,158,572.91
本期赎回（以“-”号填列）	-30,075,826.55	-30,075,826.55
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	31,404,287.61	31,404,287.61

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

华富富源三个月持有期债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,414,708.03	-1,225,313.10	189,394.93
本期期初	1,414,708.03	-1,225,313.10	189,394.93
本期利润	114,456.64	48,661.04	163,117.68
本期基金份额交易产生的变动数	-749,448.08	604,145.03	-145,303.05
其中：基金申购款	1,730,070.02	-1,277,567.26	452,502.76
基金赎回款	-2,479,518.10	1,881,712.29	-597,805.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	779,716.59	-572,507.03	207,209.56

华富富源三个月持有期债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,303,516.01	-1,153,283.85	150,232.16
本期期初	1,303,516.01	-1,153,283.85	150,232.16
本期利润	-108,860.53	381,790.68	272,930.15
本期基金份额交易产生的变动数	1,126,054.54	-1,013,514.89	112,539.65
其中：基金申购款	3,355,127.55	-2,717,657.21	637,470.34
基金赎回款	-2,229,073.01	1,704,142.32	-524,930.69
本期已分配利润	-	-	-

本期末	2,320,710.02	-1,785,008.06	535,701.96

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,600.93
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	119.64
结算备付金利息收入	-
其他	267.58
合计	1,988.15

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-348,577.63
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	-348,577.63

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	45,341,660.57
减：卖出股票成本总额	45,621,809.58
减：交易费用	68,428.62
买卖股票差价收入	-348,577.63

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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 2026年1月1日至2026年6月30日

债券投资收益——利息收入	704,681.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-68,790.99
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	635,890.86

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 2026年1月1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	132,390,177.73
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	130,828,201.90
减：应计利息总额	1,622,793.82
减：交易费用	7,973.00
买卖债券差价收入	-68,790.99

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

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项目构成

无。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 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

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	73,504.83
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	73,504.83

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	430,451.72
股票投资	199,874.48
债券投资	230,577.24
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	430,451.72

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

审计费用	17,356.09
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	3,562.69
账户维护费	18,600.00
合计	79,190.36

6.4.7.20 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、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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 2025 年 8 月 14 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
华安证券	92,359,086.93	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
华安证券	218,040,000.00	100.00

注：本表中“当期债券回购成交总额”为当期通过交易单元进行的交易所债券回购成交总额。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
华安证券	39,834.43	100.00	-	-

注：1.上述佣金按市场佣金率计算。以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费等费用后的净额列示。

2.根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，本产品交易佣金仅用于支付研究服务费用以及向证券公司租用交易单元所产生的费用。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	162,385.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	54,183.61
应支付基金管理人的净管理费	108,201.86

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.60%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 H＝E×年管理费率÷当年天数（H　为每日应计提的基金管理费，E　为前一日基金资产净值）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	40,596.37

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 H＝E ×年托管费率÷当年天数（H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富富源三个月持有期债券 A	华富富源三个月持有期债券 C	合计
华富基金管理有限公司	-	6,032.48	6,032.48
招商银行	-	8.58	8.58
华安证券	-	31,983.55	31,983.55
合计	-	38,024.61	38,024.61

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

份额单位：份

华富富源三个月持有期债券 C

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
上海华富利得资产管理有限公司	3,940,886.70	9.50	3,992,414.41	10.02

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
华安证券	2,249.73	119.64
招商银行	1,227,975.35	1,600.93

注：本基金采用券商结算模式，本基金的银行存款由基金托管人、证券经纪商华安证券股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

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

无。

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，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

本基金本报告期末和上年度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

本基金本报告期末和上年度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

本基金本报告期末和上年度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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	13,308,722.04	2,590,057.89
AAA 以下	4,118,476.71	-
未评级	-	-
合计	17,427,198.75	2,590,057.89

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末和上年度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

本基金本报告期末和上年度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，其余亦可银行间同业市场交易。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	1,230,225.08	-	-	-	-	-	1,230,225.08
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	5,071,169.31	17,427,198.75	14,273,078.63	4,123,713.78	40,895,160.47
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	830,000.00	-	-	-	-	-	830,000.00
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	267.58	267.58
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,060,225.08	-	5,071,169.31	17,427,198.75	14,273,078.63	4,123,981.36	42,955,653.13
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	607,236.83	607,236.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	32,654.02	32,654.02
应付托管费	-	-	-	-	-	8,163.52	8,163.52
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	14,108.16	14,108.16
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	344.32	344.32
其他负债	-	-	-	-	-	74,210.92	74,210.92
负债总计	-	-	-	-	-	736,717.77	736,717.77
利率敏感度缺口	2,060,225.08	-	5,071,169.31	17,427,198.75	14,273,078.63	3,387,263.59	42,218,935.36
上年度末 2025 年 12 月 31 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	461,731.21	-	-	-	-	-	461,731.21
结算备付金	8,068.24	-	-	-	-	-	8,068.24
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	1,581,248.63	10,277,104.11	18,456,465.97	12,316,522.19	2,528,222.52	45,159,563.42
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	4,999,255.89	-	-	-	-	-	4,999,255.89
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,469,055.34	1,581,248.63	10,277,104.11	18,456,465.97	12,316,522.19	2,528,222.52	50,628,618.76
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,345,294.25	10,345,294.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	27,699.10	27,699.10
应付托管费	-	-	-	-	-	6,924.74	6,924.74
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,752.88	7,752.88
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	563.79	563.79
其他负债	-	-	-	-	-	51,068.00	51,068.00
负债总计	-	-	-	-	-	10,439,302.76	10,439,302.76
利率敏感度缺	5,469,055.34	1,581,248.63	10,277,104.1	18,456,465.9	12,316,522.1	-7,911,080	40,189,316.0

口			1	7	9	.24	0

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）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	市场利率下降 25 基点	363,825.36	209,209.05
	市场利率上升 25 基点	-358,225.99	-206,790.48

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	4,123,713.78	9.77	2,528,222.52	6.29
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	36,771,446.69	87.10	42,631,340.90	106.08

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	40,895,160.47	96.86	45,159,563.42	112.37

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）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	沪深 300 指数上升百分之五	357,084.34	111,984.52
	沪深 300 指数下降百分之五	-357,084.34	-111,984.52

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	4,123,713.78	2,441,980.52
第二层次	36,771,446.69	42,717,582.90
第三层次	-	-

合计	40,895,160.47	45,159,563.42

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；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	4,123,713.78	9.60
	其中：股票	4,123,713.78	9.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	36,771,446.69	85.60
	其中：债券	36,771,446.69	85.60
	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	830,000.00	1.93
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,230,225.08	2.86
8	其他各项资产	267.58	0.00
9	合计	42,955,653.13	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	22,815.00	0.05
C	制造业	3,402,208.05	8.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	16,191.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	596,504.73	1.41
J	金融业	85,995.00	0.20
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	4,123,713.78	9.77

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	688256	寒武纪	200	319,110.00	0.76
2	002384	东山精密	800	209,880.00	0.50
3	600111	北方稀土	4,300	206,615.00	0.49
4	300502	新易盛	320	194,240.00	0.46
5	001389	广合科技	800	189,800.00	0.45
6	688025	杰普特	400	188,000.00	0.45
7	300394	天孚通信	580	175,554.40	0.42
8	601138	工业富联	2,300	165,945.00	0.39
9	301308	江波龙	200	140,760.00	0.33

10	300308	中际旭创	100	127,000.00	0.30
11	300750	宁德时代	300	117,903.00	0.28
12	688172	燕东微	1,335	111,686.10	0.26
13	688127	蓝特光学	1,129	110,190.40	0.26
14	301031	中熔电气	900	107,505.00	0.25
15	002463	沪电股份	700	106,960.00	0.25
16	300054	鼎龙股份	1,000	105,970.00	0.25
17	688690	纳微科技	2,251	99,269.10	0.24
18	301095	广立微	800	94,440.00	0.22
19	688508	芯朋微	999	92,867.04	0.22
20	688702	盛科通信	231	90,087.69	0.21
21	688308	欧科亿	489	88,905.09	0.21
22	688041	海光信息	227	84,058.10	0.20
23	300408	三环集团	500	83,450.00	0.20
24	000408	藏格矿业	1,200	83,184.00	0.20
25	601677	明泰铝业	4,900	81,340.00	0.19
26	688019	安集科技	226	76,717.96	0.18
27	600089	特变电工	3,300	74,250.00	0.18
28	002080	中材科技	800	72,000.00	0.17
29	300604	长川科技	200	68,284.00	0.16
30	002709	天赐材料	1,300	66,859.00	0.16
31	603129	春风动力	200	51,160.00	0.12
32	600030	中信证券	1,500	43,095.00	0.10
33	000783	长江证券	4,400	42,900.00	0.10
34	000960	锡业股份	1,000	42,690.00	0.10
35	000333	美的集团	500	37,765.00	0.09
36	688347	华虹宏力	103	34,638.90	0.08
37	600176	中国巨石	400	29,152.00	0.07
38	603993	洛阳钼业	1,300	22,815.00	0.05
39	600219	南山铝业	5,700	22,743.00	0.05
40	605117	德业股份	200	21,236.00	0.05
41	600754	锦江酒店	900	16,191.00	0.04
42	603317	天味食品	1,100	14,311.00	0.03
43	601339	百隆东方	1,800	12,186.00	0.03

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

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	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,134,451.00	2.82
2	001389	广合科技	750,518.00	1.87
3	601601	中国太保	742,397.75	1.85
4	600989	宝丰能源	572,546.00	1.42

5	600519	贵州茅台	569,430.00	1.42
6	601899	紫金矿业	549,205.00	1.37
7	300394	天孚通信	535,628.00	1.33
8	603699	纽威股份	517,121.00	1.29
9	300502	新易盛	499,645.00	1.24
10	300308	中际旭创	456,170.00	1.14
11	688041	海光信息	450,633.52	1.12
12	000333	美的集团	446,362.00	1.11
13	002532	天山铝业	405,579.00	1.01
14	600507	方大特钢	402,519.00	1.00
15	600389	江山股份	397,992.00	0.99
16	600030	中信证券	392,758.00	0.98
17	600660	福耀玻璃	390,684.00	0.97
18	600988	赤峰黄金	388,967.00	0.97
19	002487	大金重工	385,157.00	0.96
20	000975	山金国际	384,138.00	0.96

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,259,060.00	3.13
2	601899	紫金矿业	712,813.00	1.77
3	601601	中国太保	694,609.05	1.73
4	600989	宝丰能源	595,453.00	1.48
5	001389	广合科技	588,679.00	1.46
6	600519	贵州茅台	532,878.00	1.33
7	603699	纽威股份	518,678.00	1.29
8	000333	美的集团	420,710.00	1.05
9	600988	赤峰黄金	417,019.00	1.04
10	000975	山金国际	410,263.00	1.02
11	600389	江山股份	408,126.00	1.02
12	600030	中信证券	406,847.00	1.01
13	601168	西部矿业	405,255.00	1.01
14	603993	洛阳钼业	403,422.00	1.00
15	600660	福耀玻璃	381,708.00	0.95
16	600547	山东黄金	379,363.00	0.94
17	002080	中材科技	373,145.00	0.93
18	600507	方大特钢	371,465.00	0.92
19	002487	大金重工	367,029.00	0.91
20	600552	凯盛科技	359,733.00	0.90

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	47,017,426.36
卖出股票收入（成交）总额	45,341,660.57

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,629,869.43	74.92
	其中：政策性金融债	19,344,247.94	45.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	5,141,577.26	12.18
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	36,771,446.69	87.10

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	230210	23 国开 10	90,000	9,708,213.70	22.99
2	220220	22 国开 20	42,000	4,564,864.93	10.81
3	232400032	24 成都银行二级资本债 02	40,000	4,136,960.00	9.80
4	102583133	25 淮北建投 MTN008	40,000	4,118,476.71	9.76
5	232580022	25 工行二级资本债 03BC	30,000	3,068,412.99	7.27

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

无。

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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中，中国工商银行股份有限公司、中国农业发展银行、国家开发银行、广发银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、成都银行股份有限公司曾出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	267.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	267.58

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 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（%）
华富富源三个月持有期债券 A	214	47,064.19	0.00	0.00	10,071,736.23	100.00
华富富源三个月持有期债券 C	226	138,957.02	9,855,811.78	31.38	21,548,475.83	68.62
合计	440	94,263.69	9,855,811.78	23.76	31,620,212.06	76.24

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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华富富源三个月持有期债券 A	121,069.54	1.2021
	华富富源三个月持有期债券 C	99.67	0.0003
	合计	121,169.21	0.2921

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

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	华富富源三个月持有期债券 A	10~50
	华富富源三个月持有期债券 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华富富源三个月持有期债券 A	10~50
	华富富源三个月持有期债券 C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富富源三个月持有期债券 A	华富富源三个月持有期债券 C
基金合同生效日（2025 年 8 月 14 日）基金份额总额	32,312,517.99	-
本报告期期初基金份额总额	20,528,147.66	19,321,541.25
本报告期基金总申购份额	21,626,297.78	42,158,572.91
减：本报告期基金总赎回份额	32,082,709.21	30,075,826.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,071,736.23	31,404,287.61

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 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。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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。

10.6.3 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。

10.6.4 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。

10.7 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

10.7.1 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(%)	
华安证券	2	92,359,086.93	100.00	39,834.43	100.00	-

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）本报告期本基金租用券商交易单元无变更。

10.7.2 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	
	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(%)
华安证券	-	-	218,040,000.00	100.00	-	-

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	华富富源三个月持有期债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	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 22 日
2	华富基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	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 22 日
3	关于华富富源三个月持有期债券型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 2 月 14 日
4	关于华富富源三个月持有期债券型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 3 月 7 日
5	关于华富富源三个月持有期债券型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 3 月 14 日
6	华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 3 月 20 日
7	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
8	华富富源三个月持有期债券型证券投资基金 2025 年年度报告	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 31 日
9	华富基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 3 月 31 日

10	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
11	华富富源三个月持有期债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	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
12	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
13	华富基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 4 月 22 日
14	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

§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	1	20260319-20260319	0.00	9,822,217.86	9,822,217.86	0.00	0.00
	2	20260319-20260319	0.00	9,798,138.17	9,798,138.17	0.00	0.00
	3	20260306-20260318	0.00	4,872,794.62	4,872,794.62	0.00	0.00
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

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、《华富富源三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》

2、《华富富源三个月持有期债券型证券投资基金托管协议》

3、《华富富源三个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》

4、报告期内华富富源三个月持有期债券型证券投资基金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