

华宝绿色主题混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 07 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华宝绿色主题混合
基金主代码	005728
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 9 月 4 日
报告期末基金份额总额	24,555,388.96 份
投资目标	本基金秉持绿色投资和责任投资理念，通过系统化评估方法精选出在环境保护方面较为突出的上市公司，进而深入分析各上市公司基本面及发展前景，精选优秀上市公司，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将综合考虑各上市公司绿色收入、行业属性、污染和排放、环境负面信息等因素对初选股票池进行综合评价，优选各个行业在环境责任方面表现较为突出的公司形成绿色主题股票池。结合上市公司自身的基本面和

	<p>行业发展前景，在绿色股票中进行投资。</p> <p>本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的精 选策略，深入研究宏观经济以及所属行业的中观发展趋 势，分析企业的基本面和发展前景。</p> <p>结合定性分析和定量分析，综合判断符合主题界定公司 的投资价值，构建投资组合。</p>	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期 风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、 货币市场基金。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝绿色主题 A	华宝绿色主题 C
下属分级基金的交易代码	005728	012799
报告期末下属分级基金的份额总额	24,438,790.59 份	116,598.37 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 6 月 25 日-2021 年 6 月 30 日）	
	华宝绿色主题 A	华宝绿色主题 C
1. 本期已实现收益	1,178,608.84	-24.15
2. 本期利润	5,394,203.60	1,282.83
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2258	2.4079
4. 期末基金资产净值	46,968,504.53	224,119.05
5. 期末基金份额净值	1.9219	1.9221

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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、自 2021 年 6 月 25 日起，增设绿色主题混合 C, C 类份额的实际起始日为 2021 年 6 月 28 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝绿色主题 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.86%	1.00%	3.94%	0.71%	9.92%	0.29%
过去六个月	11.74%	1.15%	1.85%	0.97%	9.89%	0.18%
过去一年	47.45%	1.16%	19.04%	1.03%	28.41%	0.13%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	92.19%	1.06%	45.41%	1.09%	46.78%	-0.03%

华宝绿色主题 C

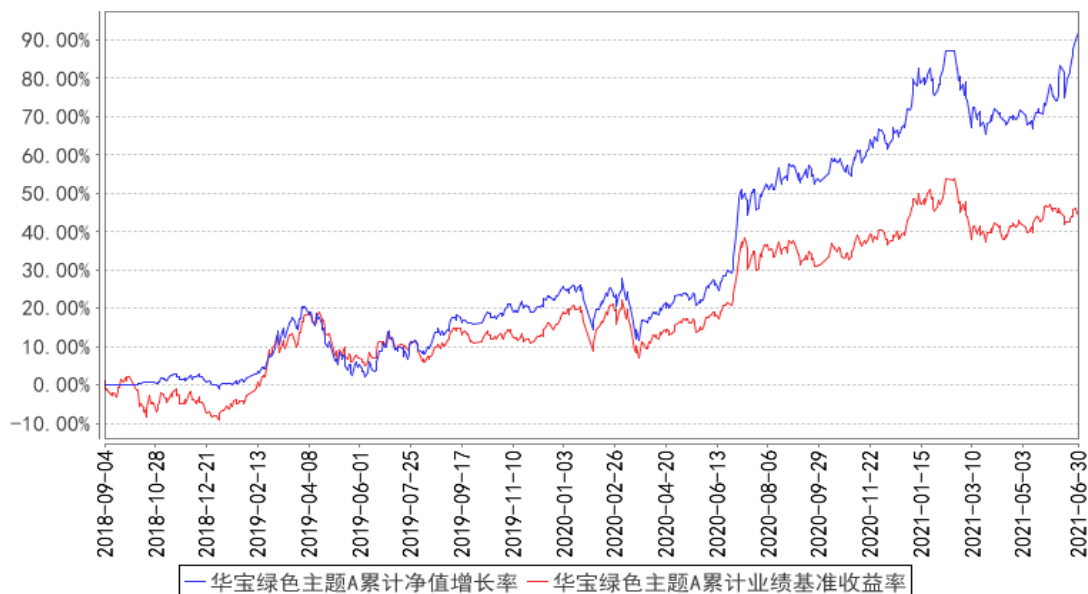
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	2.40%	0.43%	-0.21%	0.75%	2.61%	-0.32%

注：1、本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%。

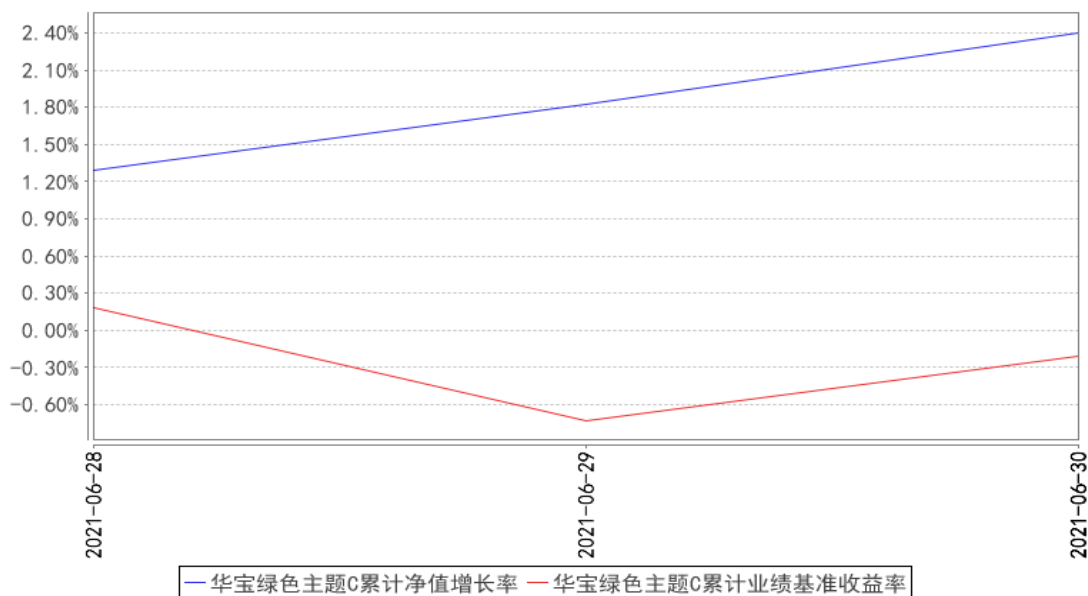
2 净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率率变动的比较

华宝绿色主题A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华宝绿色主题C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2019 年 3 月 4 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.3 其他指标 无

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
闫旭	本基金基金经理、 均衡风格投资总监， 董事总经理	2021年4月10日	-	22年	硕士。曾在富国基金管理有限公司从事证券研究、交易和投资工作，2004年10月至2010年7月任职于华宝基金管理有限公司，先后任基金经理助理、基金经理等职务。2010年7月至2014年2月任纽银梅隆西部基金管理有限公司投资副总监兼基金经理。2014年3月加入华宝基金管理有限公司任国内投资部总经理、投资副总监，现任均衡风格投资总监，董事总经理。2006年6月至2008年9月任华宝行业精选混合型证券投资基金基金经理。2008年4月至2010年7月任华宝宝康消费品证券投资基金基金经理。2014年7月起任华宝行业精选混合型证券投资基金基金经理。2015年2月至2019年7月任华宝收益增长混合型证券投资基金基金经理。2015年3月至2021年4月任华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年5月至2018年8月任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2021年4月起任华宝绿色主题混合型证券投资基金基金、华宝绿色领先股票型证券投资基金基金经理。
夏林锋	本基金基金经理	2018年9月4日	2021年4月10日	10年	硕士。曾在上海高压电器研究所从事研究工作。2010年7月加入华宝基金管理有限公司，曾任分析师、基金经理助理等职务。2014年10月至2018年8月任华宝大盘精选混合型证券投资基金基金经理。2015年2月起任华宝生态中国混合型证券投资基金基金经理。2015年6月至2017年3月任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年11月起任华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年9月至2021年4月任华宝绿色主题混合型证券投资基金基金经理。2019年9月至2021年4月任华宝绿色领先股票型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝绿色主题混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年二季度市场在经历前期大幅调整后，呈现震荡整理的格局，期间一方面，在新能源车销量持续向的带动下，与新能源相关的电气设备、汽车、电子等景气度持续向好的部分行业涨幅居前。另一方面，在对未来通胀预期下，采掘、化工、有色等周期行业也在产品价格上涨的推动下涨势较好。而农业、家电、地产、休闲、公用事业、建筑建材等行业则跌幅较大。

期间本基金减持了金融等行业，增加了电气设备、汽车等行业的配置。我们认为碳中和目标的提出，对于未来产业结构的变迁以及整体资产配置的方向将产生持久而深远的影响，与我们长期关注的绿色金融相契合，我们将继续关注产业的变化，寻找投资机会。

未来我们将继续勤勉尽责，谨慎投资，争取为持有人获得良好的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 净值增长率为 13.86%，同期业绩比较基准收益率为 3.94%；本报告期基金份额 C 净值增长率为 2.40%；同期业绩比较基准收益率为-0.21%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	39,690,181.26	82.16
	其中：股票	39,690,181.26	82.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,367,663.89	17.32
8	其他资产	253,234.70	0.52
9	合计	48,311,079.85	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	31,208,381.70	66.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	5,700,885.36	12.08

	业		
E	建筑业	8,931.48	0.02
F	批发和零售业	188,641.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	563,420.00	1.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,334.40	0.02
J	金融业	180,829.62	0.38
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	671,323.70	1.42
M	科学研究和技术服务业	731,424.40	1.55
N	水利、环境和公共设施管理业	429,009.60	0.91
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	39,690,181.26	84.10

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601012	隆基股份	49,700	4,415,348.00	9.36
2	600900	长江电力	177,200	3,657,408.00	7.75
3	300274	阳光电源	23,700	2,726,922.00	5.78
4	601633	长城汽车	53,800	2,345,142.00	4.97
5	600438	通威股份	48,900	2,115,903.00	4.48
6	600025	华能水电	352,400	2,040,396.00	4.32
7	002594	比亚迪	7,700	1,932,700.00	4.10
8	300750	宁德时代	3,500	1,871,800.00	3.97
9	300014	亿纬锂能	16,900	1,756,417.00	3.72
10	603806	福斯特	15,740	1,654,746.20	3.51

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	16,552.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	778.96
5	应收申购款	235,903.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	253,234.70

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝绿色主题 A	华宝绿色主题 C
报告期期初基金份额总额	10,366,147.77	-
报告期期间基金总申购份额	21,077,732.65	116,598.37
减：报告期期间基金总赎回份额	7,005,089.83	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	24,438,790.59	116,598.37

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20210407~20210630	0.00	10,221,378.50	0.00	10,221,378.50	41.63
	2	20210401~20210406	6,000,000.00	0.00	6,000,000.00	0.00	0.00

产品特有风险

报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇

到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2021 年 6 月 23 日发布《华宝基金管理有限公司关于华宝绿色主题混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝绿色主题混合型证券投资基金基金合同；
华宝绿色主题混合型证券投资基金招募说明书；
华宝绿色主题混合型证券投资基金托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

9.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2021 年 7 月 21 日