

# 华宝红利精选混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49

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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝红利精选混合型证券投资基金	
基金简称	华宝红利精选混合	
基金主代码	009263	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年6月3日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	358,718,257.11份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝红利精选混合 A	华宝红利精选混合 C
下属分级基金的交易代码	009263	010841
报告期末下属分级基金的份额总额	286,923,105.29份	71,795,151.82份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，精选持续分红能力强且估值相对合理的优质上市公司，在科学管理风险的前提下，力争实现资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金，投资策略主要包括资产配置策略和股票投资策略。 其中资产配置策略用于确定大类资产间的配置比例，降低组合系统性风险；股票投资策略用于挖掘持续分红能力强且估值相对合理的优质上市公司，并通过组合优化策略分散组合的非系统性风险。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×20%+恒生指数收益率×5%
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。本基金可通过港股通机制投资港股通标的股票，还可能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	华宝基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周雷
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
客户服务电话	400-700-5588、400-820-5050	95566

传真	021-38505777	010-66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	黄孔威	葛海蛟

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人住所。

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	华宝红利精选混合 A	华宝红利精选混合 C
本期已实现收益	12,486,794.76	3,304,081.81
本期利润	49,048,643.67	6,761,172.00
加权平均基金份额 本期利润	0.1624	0.1449
本期加权平均净 值利润率	14.16%	12.55%
本期基金份额净 值增长率	15.55%	15.30%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利	42,963,571.35	10,267,467.01

润		
期末可供分配基金份额利润	0.1497	0.1430
期末基金资产净值	342,964,064.53	84,955,742.40
期末基金份额净值	1.1953	1.1833
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	41.43%	14.85%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3. 净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4. 期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝红利精选混合 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
过去一个月	-1.14%	0.70%	-4.08%	0.57%	2.94%	0.13%
过去三个月	5.12%	0.73%	0.43%	0.61%	4.69%	0.12%
过去六个月	15.55%	0.86%	6.96%	0.73%	8.59%	0.13%
过去一年	11.53%	0.73%	5.21%	0.63%	6.32%	0.10%
过去三年	13.53%	0.91%	4.93%	0.82%	8.60%	0.09%
自基金合同生效起至今	41.43%	0.91%	26.23%	0.82%	15.20%	0.09%

华宝红利精选混合 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

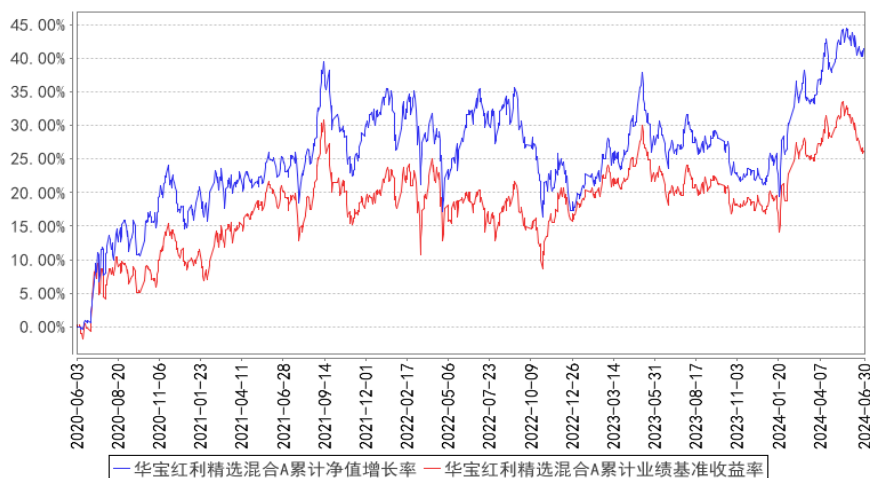
过去一个月	-1.18%	0.71%	-4.08%	0.57%	2.90%	0.14%
过去三个月	5.01%	0.73%	0.43%	0.61%	4.58%	0.12%
过去六个月	15.30%	0.86%	6.96%	0.73%	8.34%	0.13%
过去一年	11.05%	0.73%	5.21%	0.63%	5.84%	0.10%
过去三年	12.04%	0.91%	4.93%	0.82%	7.11%	0.09%
自基金合同生效起 至今	14.85%	0.89%	10.36%	0.80%	4.49%	0.09%

注：（1）基金业绩基准：中证红利指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×20%+恒生指数收益率×5%；

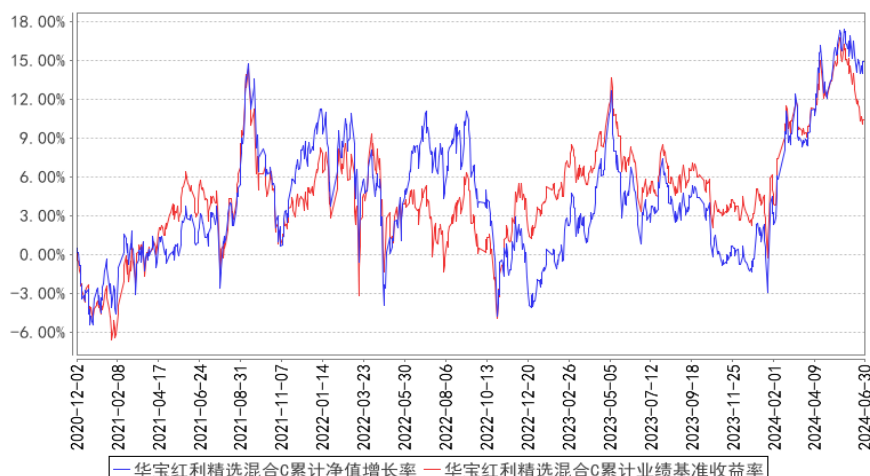
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

华宝红利精选混合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



华宝红利精选混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2020 年 12 月 03 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司。截至本报告期末（2024 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 141 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
唐雪倩	本基金基金经理	2022-06-17	-	9 年	硕士。2015 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任分析师、基金经理助理等职务。2021 年 10 月至 2022 年 6 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理，2021 年 10 月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理，2022 年 6 月起任华宝红利精选混合型证券投资基金基金经理，2022 年 8 月至 2023 年 11 月任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 4 月起任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理，2023 年 4 月至 2024 年 1 月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，2023 年 9 月起任华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 6 月起任华宝新价值灵活配置混合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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》

的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝红利精选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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，市场总体延续波动，且波幅在 2 月份一度出现高于平均水平的放大。此后随着监管层较为及时的流动性注入，市场的短期过度反应和流动性风险得到明显缓释，权益资产在 2-5 月中也迎来三个月不同程度的渐进式修复，但在 5 月中下旬再次转为调整。整体而言，上证指数在经历半年度的反复波动后总体收平，半年涨跌幅度为-0.25%，但具体在风格内部则仍然大幅度分化，一级行业上半年收红的仅有 8 个，行业间差异仍然较为极致，行业收益首尾相差达到 50.36%。从风格上来看，大盘风格整体强于小微盘，价值风格的防御能力强于成长。

华宝红利精选基金定位为价值策略产品，对于估值匹配度和盈利确定性的要求相对较为明确。上半年基金投资恪守投资边际，一方面在相对仍存在不确定性的宏观经济环境中，强化对于业绩确定性、可信赖的公司治理和相对明确的现金持续回流能力的上市企业的选择标准；另一方面在债券收益整体压缩的环境下，平衡长久期资金对于不同资产票息收益的客观要求，平衡以股息率等为代表的绝对估值的安全边际。报告期内华宝红利精选基金在宽幅波动的市场环境中保持了相对稳定的防御能力，整体超额收益表现稳定。客观而言，从中长期的角度，红利类的资产为市场特别是偏长期资产配置的投资人提供了长周期的投资选择，基金将在长期中继续恪守原则，为相应风险需求偏好的持有人提供良好的投资产品。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为 15.55%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 15.30%；同期业绩比较基准收益率为 6.96%。

#### 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 2024 年下半年，预计总量经济仍将在波动中前行，三中全会后各项政策的发布，对下半年的宏观经济取向形成指示和支撑。一方面，上半年 A 股走势偏弱，来自于内需和外部环境的双重波动，上半年作为内需发动机的房地产行业持续低迷，通胀低位徘徊，带动消费意愿有限，M1 和 M2 剪刀差持续扩大也反映了信用传导的困难。另一方面，我们在三中全会后看到了宏观政策的边际变化，联储降息预期升温也为国内货币政策打开了空间。客观而言，由于目前国内主要指数的估值并不高，而中国拥有完备的产业链结构、强大的制造业基础积累和良好的居民储蓄水平，我们应当对经济和市场的长期前景保持乐观；但另一方面，长期经济的转向并非一蹴而就，而国际政治和经济博弈的高度关联性也仍是下半年重要的观察变量。预期下半年经济基本面的客观读数仍然是投资决策的关键，对任何投资选择都应当建立在对于基本面的客观验证和审慎、中性思考上，太过博弈的短期操作不是价值类策略关注的焦点。

华宝红利精选基金定位于在全市场具备较高股息率和分红可持续性，且经营质地优质、现金流表现良好的公司中优选股票组合，维持风格的一致和连贯。基金下半年仍将明确自身的风格特征，重视股票的质量、财务报表治理能力、业绩的确定性和现金流的稳定性，为市场提供明确的价值风格投资选择。股票的安全边际和最大限度地合适的估值范围内寻找基本面良好的公司，是基金未来的配置方向。从中长期的角度，红利类的资产为市场特别是偏长期的投资人提供了长周期的配置选择，基金将在长期中继续恪守投资边际，做好相应的股票选择和策略管理。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合

同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华宝红利精选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华宝红利精选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	6,301,016.13	9,060,807.12
结算备付金		722,917.71	223,054.60
存出保证金		43,495.00	169,314.33
交易性金融资产	6.4.7.2	420,427,685.02	350,392,500.90
其中：股票投资		401,554,482.30	337,561,012.68
基金投资		-	-
债券投资		18,873,202.72	12,831,488.22
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		3,978.75	963,151.98
应收股利		1,188,821.43	-
应收申购款		233,792.28	310,337.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		428,921,706.32	361,119,166.37
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			

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		11.88	1,078,998.71
应付赎回款		125,852.03	44,869.69
应付管理人报酬		433,080.90	365,246.66
应付托管费		72,180.14	60,874.44
应付销售服务费		29,197.90	25,388.27
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	341,576.54	448,481.63
负债合计		1,001,899.39	2,023,859.40
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	358,718,257.11	347,733,394.53
未分配利润	6.4.7.8	69,201,549.82	11,361,912.44
净资产合计		427,919,806.93	359,095,306.97
负债和净资产总计		428,921,706.32	361,119,166.37

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 358,718,257.11 份，其中华宝红利精选混合 A 基金份额总额 286,923,105.29 份，基金份额净值 1.1953 元；华宝红利精选混合 C 基金份额总额 71,795,151.82 份，基金份额净值 1.1833 元。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝红利精选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		58,795,890.67	1,807,136.56
1. 利息收入		29,800.81	8,812.25
其中：存款利息收入	6.4.7.9	26,062.68	4,200.07
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		3,738.13	4,612.18
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		18,660,711.63	1,829,524.84

其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,812,761.92	892,635.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	138,951.82	21,581.81
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	12,708,997.89	915,307.79
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	40,018,939.10	-39,896.19
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	86,439.13	8,695.66
<b>减：二、营业总支出</b>		2,986,075.00	380,972.51
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,391,948.73	273,013.65
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	398,658.13	45,502.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	107,791.66	22,035.06
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		0.31	-
8. 其他费用	6.4.7.19	87,676.17	40,421.48
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		55,809,815.67	1,426,164.05
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		55,809,815.67	1,426,164.05
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		55,809,815.67	1,426,164.05

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华宝红利精选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	347,733,394.53	-	11,361,912.44	359,095,306.97
二、本期期初净资产	347,733,394.53	-	11,361,912.44	359,095,306.97
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	10,984,862.58	-	57,839,637.38	68,824,499.96
(一)、综合收益总额	-	-	55,809,815.67	55,809,815.67
(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)	10,984,862.58	-	2,029,821.71	13,014,684.29
其中：1. 基金申购款	175,261,232.17	-	23,133,389.43	198,394,621.60
2. 基金赎回款	-164,276,369.59	-	-21,103,567.72	-185,379,937.31
(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	358,718,257.11	-	69,201,549.82	427,919,806.93
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	27,518,440.96	-	4,896,851.60	32,415,292.56
二、本期期初净资产	27,518,440.96	-	4,896,851.60	32,415,292.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,019,843.89	-	582,334.01	-6,437,509.88
(一)、综合收益总额	-	-	1,426,164.05	1,426,164.05
(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)	-7,019,843.89	-	-843,830.04	-7,863,673.93



其中：1. 基金申购款	31,630,678.17	-	9,637,840.43	41,268,518.60
2. 基金赎回款	-38,650,522.06	-	-10,481,670.47	-49,132,192.53
(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	20,498,597.07	-	5,479,185.61	25,977,782.68

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：

向辉

向辉

张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝红利精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]365号文《关于准予华宝红利精选混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由华宝基金管理有限公司于2020年5月11日至2020年5月29日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2020）验字第61471289\_B02号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2020年6月3日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币458,368,903.74元；在募集期间产生利息为人民币140,820.04元。以上实收基金合计为人民币458,509,723.78元，折合458,509,723.78份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据2020年11月28日发布的《华宝基金管理有限公司关于华宝红利精选混合型证券投资基金增加C类份额并修改基金合同的公告》，从2020年12月2日起，本基金增设C类基金份额（以下简称“华宝红利精选混合C”），原有份额为A类基金份额（以下简称“华宝红利精选混合”）。其中，华宝红利精选混合是指在投资者申购时收取申购费且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；华宝红利精选混合C是指在投资者申购时不收取申购费但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《华宝红利精选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 20%），投资于红利精选主题股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%

本基金的业绩比较基准为：中证红利指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×20%+恒生指数收益率×5%。

本财务报表已于 2024 年 8 月 30 日经本基金的基金管理人批准

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充

通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。

### （3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### （4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### （5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等

收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### (6) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	6,301,016.13
等于：本金	6,300,326.27
加：应计利息	689.86
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	6,301,016.13

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	364,241,185.01	-	401,554,482.30	37,313,297.29
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	241,782.72	18,873,202.72	-1,046.70
	银行间市场	-	-	-
	合计	18,632,466.70	241,782.72	18,873,202.72
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	382,873,651.71	241,782.72	420,427,685.02	37,312,250.59

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	100.13
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	259,924.03
其中：交易所市场	259,924.03
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,552.38
合计	341,576.54

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 华宝红利精选混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	274,795,969.65	274,795,969.65
本期申购	62,965,209.58	62,965,209.58
本期赎回（以“-”号填列）	-50,838,073.94	-50,838,073.94
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	286,923,105.29	286,923,105.29

##### 华宝红利精选混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,937,424.88	72,937,424.88
本期申购	112,296,022.59	112,296,022.59
本期赎回（以“-”号填列）	-113,438,295.65	-113,438,295.65
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	71,795,151.82	71,795,151.82

注：申购含红利再投以及转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

##### 华宝红利精选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,049,849.80	-20,607,276.73	9,442,573.07
本期期初	30,049,849.80	-20,607,276.73	9,442,573.07
本期利润	12,486,794.76	36,561,848.91	49,048,643.67

本期基金份额交易产生的变动数	426,926.79	-2,877,184.29	-2,450,257.50
其中：基金申购款	6,555,046.74	1,715,710.14	8,270,756.88
基金赎回款	-6,128,119.95	-4,592,894.43	-10,721,014.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,963,571.35	13,077,387.89	56,040,959.24

华宝红利精选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,703,099.47	-5,783,760.10	1,919,339.37
本期期初	7,703,099.47	-5,783,760.10	1,919,339.37
本期利润	3,304,081.81	3,457,090.19	6,761,172.00
本期基金份额交易产生的变动数	-739,714.27	5,219,793.48	4,480,079.21
其中：基金申购款	11,273,638.03	3,588,994.52	14,862,632.55
基金赎回款	-12,013,352.30	1,630,798.96	-10,382,553.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,267,467.01	2,893,123.57	13,160,590.58

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	18,813.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,570.88
其他	678.73
合计	26,062.68

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	195,215,207.06
减：卖出股票成本总额	188,853,473.04
减：交易费用	548,972.10
买卖股票差价收入	5,812,761.92

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	145,059.82
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,108.00
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	138,951.82

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	24,507,960.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,048,608.00
减：应计利息总额	465,460.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-6,108.00

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

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

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

##### 6.4.7.13.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	12,708,997.89
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	12,708,997.89

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	40,018,939.10
股票投资	40,020,833.80
债券投资	-1,894.70
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	40,018,939.10

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	80,139.52
基金转换费收入	6,299.61
合计	86,439.13

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	21,880.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	4,286.08
证券组合费	1,837.71
合计	87,676.17

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司(“华宝基金”)	基金管理人, 注册登记机构, 基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人, 基金销售机构
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management. L.P.)	基金管理人的股东
江苏省铁路集团有限公司(“江苏铁集”)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司, 基金销售机构
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)
华宝证券	-	-	2,856,008.94	3.10

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 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 2024年1月1日至2024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 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 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 (%)
华宝证券	2,631.24	3.16	2,631.24	2.47

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,391,948.73
其中：应支付销售机构的客户维护 费	404,254.84	80,853.90
应支付基金管理人的净管理费	1,987,693.89	192,159.75

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	398,658.13	45,502.32

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝红利精选混合 A	华宝红利精选混合 C	合计
华宝基金	-	38,545.28	38,545.28
合计	-	38,545.28	38,545.28
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝红利精选混合 A	华宝红利精选混合 C	合计
华宝基金	-	17,801.64	17,801.64
合计	-	17,801.64	17,801.64

注：销售服务费每日计提，按月支付。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 类基金份额的基金资产净值的 0.4% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$ ，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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	6,301,016.13	18,813.07	211,482.28	1,866.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股锁定	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达	2024年1月	6个月	新股锁定	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-

	科技	11 日									
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股锁定	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-	
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁定	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-	
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁定	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-	
301536	星辰科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股锁定	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-	
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-	
301538	骏鼎达	2024 年 5 月 22 日	3 个月	新股锁定-送股	-	91.24	43	-	3,923.32	-	
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股锁定	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-	
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-	
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股锁定	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-	
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-	
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁定	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-	

301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股锁定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定	126.89	188.01	355	45,045.95	66,743.55	-
301589	诺瓦星云	2024年5月30日	2个月	新股锁定-送股	-	188.01	284	-	53,394.84	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股锁定	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定	29.02	25.36	113	3,279.26	2,865.68	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股锁定	72.46	68.06	48	3,478.08	3,266.88	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股锁定	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股锁定	23.35	25.13	156	3,642.60	3,920.28	-
688530	欧莱	2024年4月	6个月	新股锁定	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-



	新材	29 日								
688584	XD 上海合	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定	22.66	15.89	402	9,109.32	6,387.78	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定	86.96	174.93	133	11,565.68	23,265.69	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股锁定	15.69	18.79	464	7,280.16	8,718.56	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为

抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只主动投资的混合型证券投资基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金净资产的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险（上年度末：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进

行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持证券均在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持证券均在证券交易所上市，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金和存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,301,016.13	-	-	-	6,301,016.13
结算备付金	722,917.71	-	-	-	722,917.71
存出保证金	43,495.00	-	-	-	43,495.00
交易性金融资产	18,873,202.72	-	-	-401,554,482.30	420,427,685.02
应收股利	-	-	-	1,188,821.43	1,188,821.43
应收申购款	-	-	-	233,792.28	233,792.28
应收清算款	-	-	-	3,978.75	3,978.75
资产总计	25,940,631.56	-	-	-402,981,074.76	428,921,706.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	125,852.03	125,852.03
应付管理人报酬	-	-	-	433,080.90	433,080.90
应付托管费	-	-	-	72,180.14	72,180.14
应付清算款	-	-	-	11.88	11.88
应付销售服务费	-	-	-	29,197.90	29,197.90
其他负债	-	-	-	341,576.54	341,576.54
负债总计	-	-	-	1,001,899.39	1,001,899.39
利率敏感度缺口	25,940,631.56	-	-	-401,979,175.37	427,919,806.93
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,060,807.12	-	-	-	9,060,807.12
结算备付金	223,054.60	-	-	-	223,054.60
存出保证金	169,314.33	-	-	-	169,314.33
交易性金融资产	12,831,488.22	-	-	-337,561,012.68	350,392,500.90
应收申购款	-	-	-	310,337.44	310,337.44
应收清算款	-	-	-	963,151.98	963,151.98
资产总计	22,284,664.27	-	-	-338,834,502.10	361,119,166.37
负债					

应付赎回款	-	-	-	44,869.69	44,869.69
应付管理人报酬	-	-	-	365,246.66	365,246.66
应付托管费	-	-	-	60,874.44	60,874.44
应付清算款	-	-	-	1,078,998.71	1,078,998.71
应付销售服务费	-	-	-	25,388.27	25,388.27
其他负债	-	-	-	448,481.63	448,481.63
负债总计	-	-	-	2,023,859.40	2,023,859.40
利率敏感度缺口	22,284,664.27	-	-	-336,810,642.70	359,095,306.97

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有交易性债券投资比例较低(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

#### 6.4.13.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	54,530,972.57	-	54,530,972.57
应收股利	-	1,188,821.43	-	1,188,821.43
资产合计	-	55,719,794.00	-	55,719,794.00
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	55,719,794.00	-	55,719,794.00
项目	上年度末 2023年12月31日			

	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	38,061,749.31	-	38,061,749.31
资产合计	-	38,061,749.31	-	38,061,749.31
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	38,061,749.31	-	38,061,749.31

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月 31日）
	所有外币相对人民 币升值 5%	2,726,548.63	1,903,087.47
	所有外币相对人民 币贬值 5%	-2,726,548.63	-1,903,087.47

#### 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下和自下而上相结合”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及投资组合构建的策略；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的股票投资比例为基金资产的

60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 20%），投资于红利精选主题股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	401,554,482.30	93.84	337,561,012.68	94.00
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	401,554,482.30	93.84	337,561,012.68	94.00

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	24,475,836.06	21,277,440.98
	业绩比较基准下降 5%	-24,475,836.06	-21,277,440.98



6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定: 第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价; 第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值; 第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	401,200,426.73	337,303,202.98
第二层次	18,918,813.83	12,831,488.22
第三层次	308,444.46	257,809.70
合计	420,427,685.02	350,392,500.90

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等, 若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况, 本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券等的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次, 确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末: 同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	401,554,482.30	93.62
	其中：股票	401,554,482.30	93.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,873,202.72	4.40
	其中：债券	18,873,202.72	4.40
	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	7,023,933.84	1.64
8	其他各项资产	1,470,087.46	0.34
9	合计	428,921,706.32	100.00

注：1、通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 54,530,972.57 元，占基金资产净值的比例为 12.74%。

2、本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	63,463,921.60	14.83
C	制造业	104,802,077.27	24.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供	24,622,122.00	5.75

	应业		
E	建筑业	4,360,605.78	1.02
F	批发和零售业	1,308,644.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	34,949,006.00	8.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	931,883.96	0.22
J	金融业	77,103,778.00	18.02
K	房地产业	6,693,248.00	1.56
L	租赁和商务服务业	9,020,427.12	2.11
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	19,767,796.00	4.62
S	综合	-	-
	合计	347,023,509.73	81.10

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通讯	9,058,604.55	2.12
科技	-	-
公用事业	-	-
非必须消费品	-	-
必须消费品	-	-
能源	9,363,238.87	2.19
金融	13,450,311.18	3.14
房地产	-	-
医疗保健	-	-
工业	12,122,261.41	2.83
材料	10,536,556.56	2.46
合计	54,530,972.57	12.74

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

### 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	601088	中国神华	280,100	12,428,037.00	2.90
1	01088	中国神华	175,000	5,741,898.05	1.34
2	601939	建设银行	1,112,900	8,235,460.00	1.92
2	00939	建设银行	626,000	3,296,618.41	0.77
3	601398	工商银行	1,562,500	8,906,250.00	2.08

3	01398	工商银行	563,000	2,384,212.22	0.56
4	601288	农业银行	2,125,200	9,265,872.00	2.17
4	01288	农业银行	549,000	1,673,544.81	0.39
5	600282	南钢股份	2,177,200	10,842,456.00	2.53
6	000937	冀中能源	1,558,800	10,443,960.00	2.44
7	601328	交通银行	1,126,300	8,413,461.00	1.97
7	03328	交通银行	342,000	1,913,397.11	0.45
8	600350	山东高速	1,007,900	8,919,915.00	2.08
9	600188	兖矿能源	208,200	4,732,386.00	1.11
9	01171	兖矿能源	322,400	3,283,808.04	0.77
10	601000	唐山港	1,696,500	7,973,550.00	1.86
11	601225	陕西煤业	307,700	7,929,429.00	1.85
12	600398	海澜之家	824,500	7,618,380.00	1.78
13	601169	北京银行	1,294,500	7,559,880.00	1.77
14	600028	中国石化	659,900	4,170,568.00	0.97
14	00386	中国石油化工股份	731,000	3,375,875.54	0.79
15	601006	大秦铁路	1,033,500	7,399,860.00	1.73
16	601077	渝农商行	1,414,700	7,101,794.00	1.66
17	600900	长江电力	232,000	6,709,440.00	1.57
18	000932	华菱钢铁	1,462,800	6,480,204.00	1.51
19	00941	中国移动	76,500	5,376,141.54	1.26
19	600941	中国移动	8,300	892,250.00	0.21
20	600919	江苏银行	811,500	6,029,445.00	1.41
21	600015	华夏银行	939,100	6,010,240.00	1.40
22	601098	中南传媒	459,800	5,710,716.00	1.33
23	00883	中国海洋石油	271,000	5,540,332.67	1.29
24	600373	中文传媒	358,100	5,314,204.00	1.24
25	00995	安徽皖通高速公路	400,000	3,413,423.20	0.80
25	600012	皖通高速	123,400	1,723,898.00	0.40
26	600585	海螺水泥	151,800	3,580,962.00	0.84
26	00914	海螺水泥	89,000	1,510,850.47	0.35
27	000933	神火股份	251,500	5,087,845.00	1.19
28	601229	上海银行	684,700	4,970,922.00	1.16
29	600295	鄂尔多斯	497,700	4,937,184.00	1.15
30	601928	凤凰传媒	437,000	4,789,520.00	1.12
31	002327	富安娜	463,800	4,661,190.00	1.09
32	000651	格力电器	109,100	4,278,902.00	1.00
33	600377	宁沪高速	235,900	2,972,340.00	0.69
33	00177	江苏宁沪高速公路	170,000	1,292,446.15	0.30
34	002003	伟星股份	333,200	4,181,660.00	0.98
35	600901	江苏金租	827,700	4,179,885.00	0.98

36	600674	川投能源	215,024	4,031,700.00	0.94
37	600285	羚锐制药	161,500	3,909,915.00	0.91
38	600755	厦门国贸	527,000	3,778,590.00	0.88
39	600153	建发股份	420,600	3,755,958.00	0.88
40	600886	国投电力	204,600	3,731,904.00	0.87
41	600971	恒源煤电	300,640	3,589,641.60	0.84
42	002601	龙佰集团	191,100	3,548,727.00	0.83
43	601998	中信银行	341,100	2,285,370.00	0.53
43	00998	中信银行	274,000	1,252,872.34	0.29
44	601666	平煤股份	298,700	3,345,440.00	0.78
45	002128	电投能源	158,300	3,340,130.00	0.78
46	000429	粤高速 A	320,800	3,339,528.00	0.78
47	600801	华新水泥	235,300	3,235,375.00	0.76
48	601668	中国建筑	590,500	3,135,555.00	0.73
49	600985	淮北矿业	184,800	3,093,552.00	0.72
50	00728	中国电信	698,000	2,949,544.46	0.69
51	601985	中国核电	273,600	2,916,576.00	0.68
52	600066	宇通客车	112,500	2,902,500.00	0.68
53	601818	光大银行	905,000	2,868,850.00	0.67
54	600757	长江传媒	350,000	2,821,000.00	0.66
55	600741	华域汽车	171,300	2,805,894.00	0.66
56	000157	中联重科	348,500	2,676,480.00	0.63
57	600997	开滦股份	384,700	2,639,042.00	0.62
58	601857	中国石油	210,300	2,170,296.00	0.51
58	00857	中国石油股份	62,000	447,030.66	0.10
59	600027	华电国际	375,500	2,605,970.00	0.61
60	600348	华阳股份	258,900	2,578,644.00	0.60
61	600325	华发股份	376,900	2,449,850.00	0.57
62	600873	梅花生物	239,800	2,402,796.00	0.56
63	600461	洪城环境	206,000	2,385,480.00	0.56
64	000333	美的集团	35,400	2,283,300.00	0.53
65	605368	蓝天燃气	164,300	2,241,052.00	0.52
66	06198	青岛港	406,000	2,208,466.56	0.52
67	600048	保利发展	252,000	2,207,520.00	0.52
68	001965	招商公路	185,500	2,200,030.00	0.51
69	002737	葵花药业	91,300	2,134,594.00	0.50
70	601636	旗滨集团	321,200	2,071,740.00	0.48
71	600064	南京高科	335,400	2,035,878.00	0.48
72	002884	凌霄泵业	101,900	1,956,480.00	0.46
73	601699	潞安环能	101,700	1,843,821.00	0.43
74	01186	中国铁建	360,000	1,830,105.94	0.43
75	600660	福耀玻璃	37,300	1,786,670.00	0.42
76	000708	中信特钢	129,600	1,758,672.00	0.41

77	600104	上汽集团	122,300	1,695,078.00	0.40
78	600989	宝丰能源	93,500	1,620,355.00	0.38
79	01800	中国交通建设	378,000	1,604,217.64	0.37
80	02628	中国人寿	157,000	1,581,929.99	0.37
81	600123	兰花科创	170,400	1,525,080.00	0.36
82	600750	江中药业	65,800	1,520,638.00	0.36
83	002818	富森美	121,000	1,483,460.00	0.35
84	01339	中国人民保险集团	551,000	1,347,736.30	0.31
85	600489	中金黄金	89,000	1,317,200.00	0.31
86	605599	莱百股份	102,800	1,308,644.00	0.31
87	000338	潍柴动力	78,300	1,271,592.00	0.30
88	000090	天健集团	304,739	1,225,050.78	0.29
89	000830	鲁西化工	104,800	1,214,632.00	0.28
90	600479	千金药业	118,300	1,203,111.00	0.28
91	601019	山东出版	95,800	1,132,356.00	0.26
92	00390	中国中铁	263,000	1,034,550.16	0.24
93	000983	山西焦煤	92,700	955,737.00	0.22
94	000425	徐工机械	126,700	905,905.00	0.21
95	600177	雅戈尔	125,100	890,712.00	0.21
96	600036	招商银行	25,100	858,169.00	0.20
97	000895	双汇发展	35,985	855,363.45	0.20
98	600582	天地科技	108,800	749,632.00	0.18
99	03969	中国通号	241,000	739,051.76	0.17
100	000786	北新建材	24,800	735,568.00	0.17
101	00762	中国联通	112,000	732,918.55	0.17
102	002126	银轮股份	38,300	666,803.00	0.16
103	600737	中粮糖业	68,000	652,120.00	0.15
104	603886	元祖股份	40,800	614,448.00	0.14
105	002372	伟星新材	37,100	572,082.00	0.13
106	002540	亚太科技	87,100	460,759.00	0.11
107	600031	三一重工	27,600	455,400.00	0.11
108	000581	威孚高科	27,800	452,584.00	0.11
109	600548	深高速	39,500	419,885.00	0.10
110	000001	平安银行	41,200	418,180.00	0.10
111	002833	弘亚数控	9,200	167,808.00	0.04
112	301589	诺瓦星云	639	120,138.39	0.03
113	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
114	688692	达梦数据	133	23,265.69	0.01
115	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
116	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
117	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
118	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
119	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00

120	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
121	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
122	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
123	688709	成都华微	464	8,718.56	0.00
124	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
125	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
126	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
127	688584	上海合晶	402	6,387.78	0.00
128	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
129	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
130	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
131	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
132	603381	永臻股份	156	3,920.28	0.00
133	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
134	603325	博隆技术	48	3,266.88	0.00
135	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
136	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
137	603312	西典新能	113	2,865.68	0.00
138	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
139	301578	辰奕智能	53	2,097.21	0.00

#### 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	601288	农业银行	3,742,364.00	1.04
1	01288	农业银行	2,743,939.76	0.76
2	601088	中国神华	4,384,114.00	1.22
2	01088	中国神华	1,982,990.17	0.55
3	601398	工商银行	3,692,284.00	1.03
3	01398	工商银行	1,219,687.04	0.34
4	601939	建设银行	3,453,957.00	0.96
4	00939	建设银行	1,105,993.96	0.31
5	000937	冀中能源	4,366,294.00	1.22
6	601328	交通银行	3,296,230.00	0.92
6	03328	交通银行	696,834.44	0.19
7	600188	兖矿能源	2,175,422.00	0.61
7	01171	兖矿能源	1,622,649.77	0.45
8	00728	中国电信	3,793,543.39	1.06
9	600282	南钢股份	3,504,956.00	0.98
10	000932	华菱钢铁	3,483,092.00	0.97
11	601225	陕西煤业	3,419,654.00	0.95
12	00386	中国石油化工	1,836,591.70	0.51

		股份		
12	600028	中国石化	1,532,924.94	0.43
13	600350	山东高速	3,298,488.00	0.92
14	601077	渝农商行	3,282,649.00	0.91
15	601006	大秦铁路	3,250,898.00	0.91
16	600398	海澜之家	3,239,967.00	0.90
17	601636	旗滨集团	2,955,655.00	0.82
18	601000	唐山港	2,848,062.00	0.79
19	600015	华夏银行	2,833,751.00	0.79
20	00941	中国移动	2,238,591.02	0.62
20	600941	中国移动	482,573.00	0.13

注：买入金额不包括相关交易费用。

#### 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	601288	农业银行	3,018,915.00	0.84
1	01288	农业银行	2,263,568.40	0.63
2	601088	中国神华	3,500,375.00	0.97
2	01088	中国神华	1,329,098.36	0.37
3	600282	南钢股份	4,798,484.40	1.34
4	06818	中国光大银行	2,503,534.03	0.70
4	601818	光大银行	2,178,687.00	0.61
5	000937	冀中能源	4,190,339.00	1.17
6	002563	森马服饰	3,843,770.00	1.07
7	00728	中国电信	3,818,925.25	1.06
8	600548	深高速	3,613,389.00	1.01
9	601398	工商银行	2,975,448.00	0.83
9	01398	工商银行	581,605.91	0.16
10	601225	陕西煤业	3,516,697.00	0.98
11	600919	江苏银行	3,279,269.00	0.91
12	601939	建设银行	2,352,042.00	0.65
12	00939	建设银行	909,004.48	0.25
13	600585	海螺水泥	2,379,803.00	0.66
13	00914	海螺水泥	842,404.36	0.23
14	000778	新兴铸管	3,072,615.00	0.86
15	600350	山东高速	2,985,627.00	0.83
16	601328	交通银行	2,472,799.00	0.69
16	03328	交通银行	490,413.45	0.14
17	000932	华菱钢铁	2,932,514.00	0.82
18	600188	兖矿能源	1,682,315.00	0.47
18	01171	兖矿能源	1,081,055.39	0.30
19	601006	大秦铁路	2,723,549.00	0.76



20	600377	宁沪高速	2,359,233.00	0.66
20	00177	江苏宁沪高速公路	337,474.79	0.09

注：卖出金额不包括相关交易费用。

### 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	212,826,108.86
卖出股票收入（成交）总额	195,215,207.06

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

### 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	18,873,202.72	4.41
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	18,873,202.72	4.41

### 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	019709	23 国债 16	60,000	6,093,690.41	1.42
2	019685	22 国债 20	43,000	4,372,482.69	1.02
3	019733	24 国债 02	43,000	4,346,141.95	1.02
4	019727	23 国债 24	20,000	2,036,380.82	0.48
5	019698	23 国债 05	20,000	2,024,506.85	0.47

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

华宝红利精选混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国农业银行股份有限公司因：一、农户贷款发放后流入房地产企业二、农村个人生产经营贷款贷后管理不到位三、农户小额贷款发放后转为定期存款四、违规向房地产开发企业提供融资五、违规发放流动资金贷款六、装修贷款发放不审慎七、商业用房贷款发放不审慎八、违规向关系人发放信用贷款九、贷款风险分类不准确导致不良率失实十、违规发放固定资产贷款十一、对不具备法人资格的分支公司客户单独办理授信十二、集团客户统一授信管理不到位十三、贷款回流用于归还本行贷款十四、贷款回流用于缴纳银承保证金十五、贷款回流用于转存定期存款十六、贴现资金回流出票人十七、信贷资金流入证券账户十八、贷后管理不尽责导致信贷资金实质被关联企业占用十九、扶贫小额信贷户贷企用；于 2023 年 08 月 15 日收到国家金融监督管理总局罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝红利精选混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国农业银行股份有限公司因：一、流动资金贷款被用于固定资产投资二、贷款受托支付问题整改不到位三、贷款风险分类不准确四、个别精准扶贫贷款被挪用五、不良资产转让流程问题整改不到位六、小微企业划型不准确七、贷款资金转存银承汇票保证金问题整改不到位八、个人贷款违规流入房地产市场问题整改不到位九、审计人员配备不足问题未整改十、非现场数据报送不准确，整改不到位十一、人员内部问责不到位十二、向关系人发放信用贷款十三、个人贷款管理不到位，部分贷款资金被挪用；于 2023 年 11 月 16 日收到国家金融监督管理总局罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝红利精选混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国农业银行股份有限公司因：1. 办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查 2. 违反规定办理资本项目资金收付 3. 违反规定办理结汇、售汇业务 4. 未按照规定报送财

务会计报告、统计报表等资料；于 2023 年 11 月 17 日收到国家外汇管理局北京市分局警告，罚款，没收违法所得的处罚措施。

华宝红利精选混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司因信贷业务违规，违规销售或推介，违规收费，信息披露及资料、文件等上报违规，内部管理与控制制度不健全或执行监督不力，信托公司设立、管理信托计划违法违规，内控管理未形成有效风险控制，保险业务违规；于 2023 年 12 月 01 日收到国家金融监督管理总局罚款，没收违法所得的处罚措施。

华宝红利精选混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司因内部管理与控制制度不健全或执行监督不力，未经任职资格审查或核准任命董事、高级管理人员、首席代表，内控管理未形成有效风险控制；于 2024 年 01 月 05 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

华宝红利精选混合截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司因一、安全测试存在薄弱环节二、运行管理存在漏洞三、数据安全不足四、灾备管理不足；于 2024 年 06 月 03 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	43,495.00
2	应收清算款	3,978.75
3	应收股利	1,188,821.43
4	应收利息	-

5	应收申购款	233,792.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,470,087.46

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
华宝红利精选混合 A	3,084	93,036.03	261,184,174.69	91.03	25,738,930.60	8.97
华宝红利精选混合 C	1,967	36,499.82	61,653,286.47	85.87	10,141,865.35	14.13
合计	5,051	71,019.26	322,837,461.16	90.00	35,880,795.95	10.00

### 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	华宝红利精选混合 A	175,472.96	0.0612
	华宝红利精选混合 C	745,878.09	1.0389
	合计	921,351.05	0.2568

## 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	华宝红利精选混合 A	0
	华宝红利精选混合 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝红利精选混合 A	0~10
	华宝红利精选混合 C	10~50
	合计	10~50

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝红利精选混合 A	华宝红利精选混合 C
基金合同生效日 (2020年6月3日) 基金份额总额	458,509,723.78	-
本报告期期初基金份额总额	274,795,969.65	72,937,424.88
本报告期基金总申购份额	62,965,209.58	112,296,022.59
减：本报告期基金总赎回份额	50,838,073.94	113,438,295.65
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	286,923,105.29	71,795,151.82

## §10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

## 1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

## 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投	2	95,376,677.58	23.45	89,729.60	23.91	-
上海证券	2	76,183,791.97	18.73	72,062.36	19.20	-
广发证券	4	52,978,676.54	13.02	42,384.15	11.29	-
长江证券	1	42,470,329.63	10.44	40,173.70	10.70	-
浙商证券	2	31,773,277.95	7.81	29,903.37	7.97	-
德邦证券	1	22,993,830.05	5.65	21,519.98	5.73	-
中银国际	2	19,514,026.80	4.80	18,263.60	4.87	-
华泰证券	2	17,562,958.67	4.32	16,437.94	4.38	-
国泰君安	1	15,298,292.94	3.76	14,470.23	3.86	-
国海证券	2	10,262,509.6	2.52	9,674.05	2.58	-

		1				
中信证券	4	7,095,435.68	1.74	6,428.49	1.71	-
天风证券	3	3,979,379.50	0.98	3,724.32	0.99	-
方正证券	1	3,464,827.96	0.85	3,242.96	0.86	-
财通证券	3	3,245,500.97	0.80	3,037.35	0.81	-
国信证券	1	1,881,916.40	0.46	1,779.97	0.47	-
申万宏源	3	1,795,680.66	0.44	1,698.85	0.45	-
东北证券	2	632,829.09	0.16	598.64	0.16	-
中泰证券	1	165,412.02	0.04	156.45	0.04	-
东吴证券	2	75,368.32	0.02	71.30	0.02	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
大和证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海 证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	3	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
麦高证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-

招商证券	4	-	-	-	-	-
中金国际	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元退租的有：国投证券、天风证券。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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 (%)
中信建投	-	-	-	-	-	-
上海证券	10,133,605.66	33.32	75,900,000.00	100.00	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	9,211,453.56	30.29	-	-	-	-
德邦证券	4,993,121.98	16.42	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-



国海证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	6,074,436.1 8	19.97	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证 券	-	-	-	-	-	-
大和证 券	-	-	-	-	-	-
第一创 业	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东海证 券	-	-	-	-	-	-
东亚前 海证券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-

国元证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华林证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
联储证 券	-	-	-	-	-	-
麦高证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证 券	-	-	-	-	-	-
五矿证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金国 际	-	-	-	-	-	-

中邮证 券	-	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金关于旗下部分基金新增银泰证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-01-05
2	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-01-19
3	华宝基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-03-29
4	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-04-19
5	华宝基金关于旗下部分基金新增华西证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-05-09
6	华宝基金关于旗下部分基金新增华福证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-05-20
7	华宝基金关于旗下部分基金新增国信证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-05-21
8	华宝基金关于旗下部分基金新增平安证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-06-07
9	华宝基金关于华宝红利精选混合型证券投资基金新增国泰君安证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2024-06-13
10	关于华宝红利精选混合型证券投资基金开通同一基金不同类别基金份额相互转换业务的公告	基金管理人网站, 中国证券报	2024-06-19
11	华宝基金关于旗下部分基金新增湘财证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-06-21
12	华宝红利精选混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要(更新)	基金管理人网站	2024-06-28
13	华宝红利精选混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要(更新)	基金管理人网站	2024-06-28

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
华宝红利精选混合型证券投资基金基金合同；  
华宝红利精选混合型证券投资基金招募说明书；  
华宝红利精选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。

### 12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人办公场所和基金托管人住所备投资者查阅。

### 12.3 查阅方式

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

华宝基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日