

华宝绿色主题混合型证券投资基金 清算报告

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：2024年4月

一、重要提示

华宝绿色主题混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华宝绿色主题混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2018】273号文）进行募集，本基金基金合同于2018年9月4日正式生效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华宝绿色主题混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的有关规定，本基金已出现基金合同终止事由，本基金管理人根据法律法规的规定及基金合同的约定履行了基金财产清算程序，此事项无需召开基金份额持有人大会。本基金的最后运作日为2024年4月8日，自2024年4月9日起，本基金进入清算程序。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见基金管理人于2024年3月29日发布的《关于华宝绿色主题混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

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、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

华宝绿色主题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[2018]273号文准予注册，由基金管理人华宝基金管理有限公司向社会公开募集，首次设立时募集规模为310,527,790.46份基金份额，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（18）第00008号的验资报告。基金合同于2018年9月4日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金的基金管理人及注册登记机构均为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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，投资于绿色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、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800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

根据《关于华宝绿色主题混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于2024年4月9日起进入清算期，本基金进入清算程序后，不再收取基金管理费、基金托管费。

三、基金运作情况

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可【2018】273号文准予注册，由华宝基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依照法律法规的规定及《华宝绿色主题混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的约定自2018年8月3日至2018年8月30日止期间向社会公开募集。本基金基金合同于2018年9月4日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为310,527,790.46份（含募集期间利息结转的份额），有效认购户数为2,291户。

根据基金合同“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”约定：“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形之一的，本基金将依据《基金合同》第十九部分的约定进入基金财产清算程序并终止，不需召开基金份额持有人大会。”

截至2024年3月28日日终，本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，基金管理人应终止本基金基金合同并依法履行基金财产清算程序，不需召开基金份额持有人大会。本基金的最后运作日为2024年4月8日，自2024年4月9日起，本基金进入清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

四、财务会计报告

（一）华宝绿色主题混合型证券投资基金最后运作日资产负债表

单位：人民币元

	最后运作日 2024年4月8日
资产：	
货币资金	11,399,624.84
结算备付金	68,760.86
存出保证金	15,364.16
资产合计	11,483,749.86
负债：	
应付赎回款	1,044,672.65
应付管理人报酬	3,378.01
应付托管费	563.01
应付销售服务费	155.92
其他负债	19,495.44
负债合计	1,068,265.03
净资产：	
实收基金	10,820,916.92
未分配利润	-405,432.09
净资产合计	10,415,484.83
负债和净资产合计	11,483,749.86

五、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《资产管理产品相关会计处理规定》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表无比较期间的相关数据列示。

六、清算情况

自2024年4月9日起至2024年4月11日止的清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、 资产处置情况

- (1) 本基金最后运作日货币资金为人民币11,399,624.84元，其中托管户存款为人民币11,398,676.96元，应计银行存款利息为人民币947.88元，由于银行尚未结息，应计银行存款利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。
- (2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币68,760.86元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金为人民币29,862.33元，存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金为人民币38,839.82元，应计结算备付金利息为人民币58.71元，由于银行尚未结息，该部分利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。
- (3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币15,364.16元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金为人民币6,180.53元，存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金为人民币9,171.48元，应计存出保证金利息为人民币12.15元，由于银行尚未结息，该部分利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

2、 负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币3,378.01元，该款项已于2024年4月10日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币563.01元，该款项已于2024年4月10日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币155.92元，该款项已于2024年4月10日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币1,044,672.65元，该款项已于2024年4月9日、2024年4月10日支付。
- (5) 本基金最后运作日其他负债为人民币19,495.44元。其中应付审计费人民币5,000.00元，应付律师费人民币10,000.00元，应付上证报信息披露费人民币4,234.91元，以上款项已于2024年4月11日支付；应付赎回费人民币260.48元，该款项已于2024年4月9日和2024年4月10日支付；应付转出费人民币0.05元，该款项已于2024年4月10日支付。

3、 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

自2024年4月9日
至2024年4月11日
止清算期间

项目	
一、收益	
1、利息收入（注1）	318.14
收益小计	<u>318.14</u>
二、费用	
1、其他费用（注2）	77.00
费用小计	<u>77.00</u>
三、清算期间净损益	<u><u>241.14</u></u>

注1：利息收入系自2024年4月9日至2024年4月11日止清算期间计提的银行存款利息收入、存出保证金利息收入、结算备付金利息收入。

注2：其他费用系自2024年4月9日至2024年4月11日止清算期间的银行汇划手续费。

4、 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2024年4月8日基金净资产	10,415,484.83
加：清算期间净损益	241.14
二、2024年4月11日基金净资产	10,415,725.97

资产处置及负债清偿后，截至本次清算结束日2024年4月11日，本基金剩余财产为人民币10,415,725.97元，根据基金合同的约定，本基金依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自清算起始日2024年4月9日至清算款划出日前一日的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息亦属基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，尚未结息的利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。基金管理人自有资金垫款产生的利息归属基金管理人所有。

七、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 《华宝绿色主题混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 关于《华宝绿色主题混合型证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

以上文件存于基金管理人办公场所备投资者查阅。

3、查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件。

华宝绿色主题混合型证券投资基金基金财产清算小组
2024年4月