

# 华宝 ESG 责任投资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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	44

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 .....	44
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 .....	44
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 .....	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	44
7.12 投资组合报告附注 .....	44
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</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 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝 ESG 责任投资混合型证券投资基金	
基金简称	华宝 ESG 责任投资混合	
基金主代码	018118	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 4 月 28 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	88,525,782.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝 ESG 责任投资混合 A	华宝 ESG 责任投资混合 C
下属分级基金的交易代码	018118	018119
报告期末下属分级基金的份额总额	80,111,750.77 份	8,414,031.35 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选 ESG 责任投资主题股票，在力争控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策以及市场流动性等方面的因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。本基金通过将环境、社会和公司治理（ESG）因素纳入投资决策开展责任投资实践，本基金基于内部 ESG 评价体系与第三方 ESG 评级相结合的 ESG 评价数据库，在构建基金风格库时，主要采用负面筛查的投资策略，从政策、行业、公司等不同层面对投资标的进行差异化负面剔除，对于综合 ESG 风险位于后 30% 的投资标的，不纳入风格库，同时，对于符合责任投资标准的公司，深入分析公司基本面和业务前景，判断企业投资价值，有选择性地纳入风格库。对于风格库内公司的 ESG 状况进行持续跟踪和定期评估，以使组合内公司符合 ESG 投资标准，践行责任投资。
业绩比较基准	沪深 300ESG 基准指数收益率×55%+中证综合债指数收益率×30%+恒生指数收益率×15%。
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，理论上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	中国建设银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	周雷	王小飞
	联系电话	021-38505888	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-700-5588、400-820-5050	021-60637228	
传真	021-38505777	021-60635778	
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼	
邮政编码	200120	100033	
法定代表人	黄孔威	张金良	

## 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	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 ESG 责任投资混合 A	华宝 ESG 责任投资混合 C
本期已实现收益	-9,210,610.90	-925,043.02
本期利润	1,208,050.01	45,803.63
加权平均基金份 额本期利润	0.0140	0.0053
本期加权平均净 值利润率	1.75%	0.66%
本期基金份额净	1.32%	1.19%

值增长率		
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-15,038,678.25	-1,605,136.46
期末可供分配基金份额利润	-0.1877	-0.1908
期末基金资产净值	65,073,072.52	6,808,894.89
期末基金份额净值	0.8123	0.8092
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	-18.77%	-19.08%

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 ESG 责任投资混合 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	-4.28%	0.61%	-1.75%	0.35%	-2.53%	0.26%
过去三个月	1.88%	1.00%	0.53%	0.52%	1.35%	0.48%
过去六个月	1.32%	1.18%	2.83%	0.63%	-1.51%	0.55%
过去一年	-20.82%	1.13%	-3.98%	0.63%	-16.84%	0.50%
过去三年	-	-	-	-	-	-

自基金合同生效起 至今	-18.77%	1.07%	-5.69%	0.62%	-13.08 %	0.45%
----------------	---------	-------	--------	-------	-------------	-------

华宝 ESG 责任投资混合 C

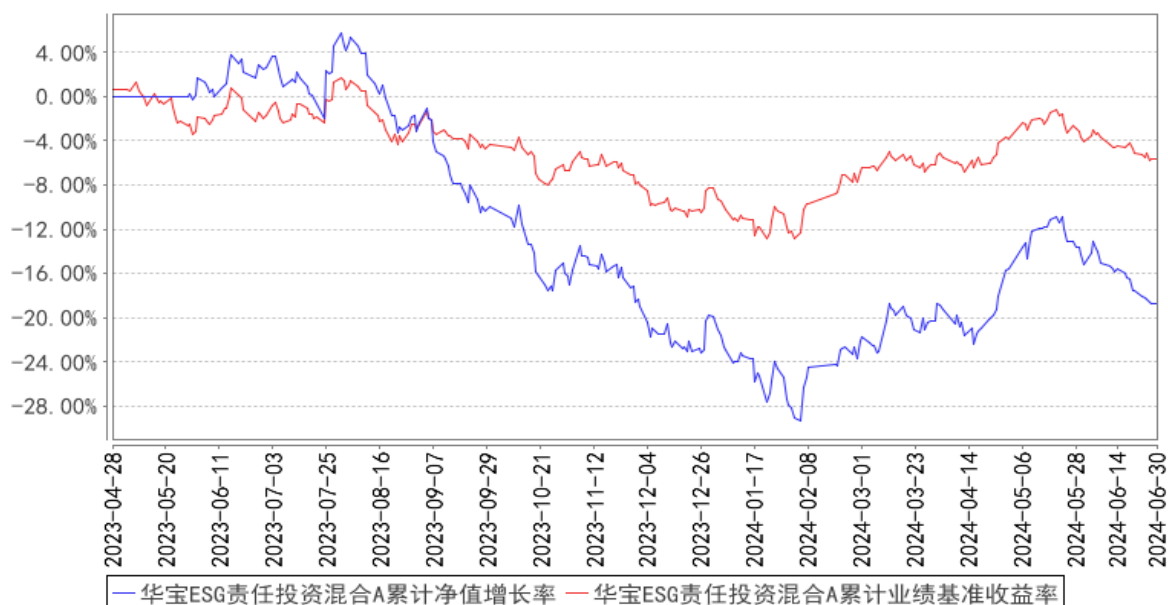
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.32%	0.61%	-1.75%	0.35%	-2.57%	0.26%
过去三个月	1.77%	1.00%	0.53%	0.52%	1.24%	0.48%
过去六个月	1.19%	1.18%	2.83%	0.63%	-1.64%	0.55%
过去一年	-21.08%	1.13%	-3.98%	0.63%	-17.10 %	0.50%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起 至今	-19.08%	1.07%	-5.69%	0.62%	-13.39 %	0.45%

注：(1) 基金业绩基准：沪深 300 ESG 基准指数收益率×55%+中证综合债指数收益率×30%+恒生指数收益率×15%。

(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）。

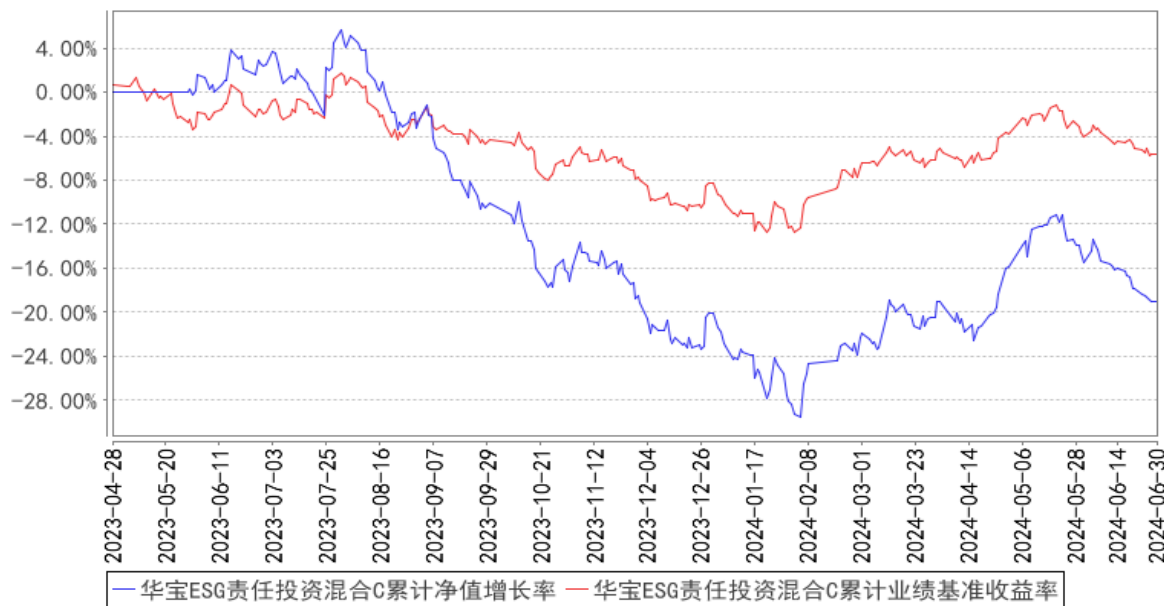
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华宝ESG责任投资混合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ESG责任投资混合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 2023 年 10 月 28 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		
毛文	本基金	2023-04-	-	14 年	硕士。曾任智库合力管理咨询有限公司研究

博	基金经 理	28			部研究员。2010 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任研究员、基金经理助理等职务。2015 年 4 月起任华宝收益增长混合型证券投资基金基金经理，2017 年 5 月至 2020 年 7 月任华宝国策导向混合型证券投资基金基金经理，2023 年 4 月起任华宝 ESG 责任投资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遵规守信情况的说明

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 ESG 责任投资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

整个 24 年上半年,我们的任务主要集中在寻找具备核心竞争力,且长期价值低估的公司上面。我们的优势产业面临非市场化因素的干扰,这是我们在投资中遇到的最大困难,那些最具备竞争力的产业和公司在海外频繁面临非市场化手段的围追堵截,使得短期股价脱离价值,出现压力。尊重市场,才能赢得市场。非市场化竞争手段短期会对市场产生干扰,看上去是保护,但长期来讲,会受到市场的惩罚。这些手段会拉大产业间的差距,使我们的优势产业竞争力更加强大,在长期依靠创新和成本优势在全球保持市场地位。

我们在新能源行业中挑选了一批极具优势的细分行业龙头。这些公司有的在全行业亏现金流的情况下,还保持了比较好的盈利,龙头市占率自然的大幅上升。有的产能扩张受到约束,产量增长和下游需求增长基本平衡。还有的在全球来看都具备遥遥领先的竞争实力。

比如我们的新能源电池龙头,从去年到今年在行业的低潮期维持了盈利和现金流的良性增长。同时期,国内外同行业公司,包括以前的跨国巨头,都处于微利或者亏损状态,而这甚至是建立在这些跨国公司能够拿到美国高额补贴的基础上。另外龙头公司的折旧年限大幅低于同业,会计政策更加严谨,未来自由现金流状况甚至会好于盈利水平。这样的公司,即使短期遇到非市场化因素干扰,长期也能依靠创新和成本优势在全球保持市场地位。在行业低潮期,按照比较低的景气度进行估值,股价依然便宜。长期来看我们认为大概率会有很好的投资回报。

我们去年下半年对品牌功能性服饰的投资,在整个上半年为我们贡献了比较丰厚的收益。在经历了近一个季度的股价波动之后,相关公司在服装行业整体竞争加剧的情况下,在全年交出了比较靓丽的答卷,我们的投资也因此取得了收益。我们所投资的的港股互联网龙头,也在上半年走出了比较好的上涨行情。在去年股价的低点,市场很多人提出了很多负面的观点,让我们有机会以极低的成本买入并持有公司股票。社交始终是最大的护城河,相关公司依靠深厚的护城河,从游戏、到广告、到短视频,各项业务维持了健康的增长态势。几乎没有受到全球经济周期或者地缘政治的影响。

我们在二季度发现了一些新的标的随着股价调整,进入了比较好的长期回报区域。比如电梯传媒,虽然和经济周期具有一定相关性,但行业属性是典型的赢家通吃型行业。第一名的公司,拥有最好的点位资源,最强的规模效应,具备最强的品牌引爆能力。广告主不会因为价格退而求其次去选择效果不好的点位。龙头具有深厚的护城河。同时电梯传媒和线上的效果广告存在互补关系,相关业务具有长期的生命力。从现实情况上看,我们观察到,行业龙头每年具有超高的 ROE 和现金流水平。但行业里的其他公司情况不太好,今年甚至于有比较大的竞争对手结束营业。从

成本端看，先发优势和竞争态势好转使得公司具有更强的议价能力，今年也观察到有小区和办公楼对龙头租用点位的收费大幅降价的新闻。这些因素叠加，让我们认为龙头公司周期底部和盈利中枢在持续提升，叠加比较优秀的自由现金流水平。当前位置是具备吸引力的。

我们还在细分领域找到了一些低估的公司。比如玻纤行业的某些民营企业，中国的玻纤行业在全球具有统治地位，但目前盈利周期处于底部区域。一些民营企业表现出了很强的经营特质。在成本控制方面，已经逐渐能够赶上行业巨头。在欧盟对中国玻纤双反高税率的前提下，只有少数企业通过法律手段取得了豁免，这使得在出口欧盟方面，在税收上面相对于同行就有巨大的优势。最后，在产量上面，公司还有较多的产能指标没有投建，未来产能具有扩张空间。从价量利的角度，公司经营都处于底部区域，在此前提下，我们相信未来潜在的自由现金流水平具备提升空间。

我们还在有色金属领域找到了一些行业和公司，符合我们选择的标准，也取得了一些收益。另外，我们调整了在房地产行业上的持仓，仅保留了央企龙头，房地产行业的冬天比想象的要长，活下去才能在下一阶段获益于市场的出清。所以活下去的能力才是现在房地产行业最大的差异化能力。

最后，我们也结合各个行业的长期发展前景、价值评估状况、景气度情况，在季度间进行了一些短期调整。其中有比较成功的操作，也有比较失败的操作。比如比较好的在市场兴奋的高点，降低了家电、中药、药房的配置。也有比较失败的太早对某些板块进行加仓产生了损失。这些会产生短期影响，但更重要的是我们要选对具备差异化竞争能力的公司，并买到比较好的价格。

我们未来一段时间的任务也主要是选出这些具备合理价格的优秀公司，不断的使我们的组合构建更加扎实。市场目前的走势展示出大部分投资者处于极度悲观的状态。无论是 06 年、13-14 年、还是 18-19 年在那些未来能创造巨大收益空间的时间段里面，人们往往都充满了绝望，每天都在承受股价下跌的痛苦。我们知道这样的时间是最宝贵的时间，但我们没法预测市场什么时候进入下一阶段。

就像霍华德马克思最近的备忘录中写的那样：在 2016 年总统选举期间，几乎每个人都确信两件事：1、希拉里？克林顿会赢。2、如果特朗普爆冷赢了，那么美股将会崩溃。然而结果却是，特朗普赢了，然后美股在接下来的 14 个月里上涨了 30%以上。这件事充分证明了：1、人们实际上无法预测事情的走向；2、也不知道事情发生后市场反应会怎样。

我们所能做的是，选好公司和价格，因为当市场从恐慌回复正常之后，好的公司和好的价格会创造好的收益。

#### 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 1.32%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 1.19%；同期业绩比较基准收益率为 2.83%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们无法通过预测宏观和市场赚钱，这是我们在过去一直强调的。霍华德马克思在最新的备忘录《放弃对于确定性的预测》中写道：在 2016 年总统选举期间，几乎每个人都确信两件事：1、希拉里？克林顿会赢。2、如果特朗普爆冷赢了，那么美股将会崩溃。然而结果却是，特朗普赢了，然后美股在接下来的 14 个月里上涨了 30%以上。这件事充分证明了：1、人们实际上无法预测事情的走向；2、也不知道事情发生后市场反应会怎样。

我们在去年年中曾经尝试从概率和价值角度对市场做一些判断。但去年三四季度以来，国际资金流动导致的对优质公司的不计成本的甩卖，以及海外基于行业保护的各种非市场化因素的干扰，都使得价格对价值的偏离时间和幅度都超过了我们的判断，使我们的期望落空。而净值的下跌，大部分也出现在这个阶段。诸如此类的各种各样的因素还有很多，冷暖自知，然实在无法一一具述。

我们能够判断长期来讲，哪些时刻大概率是价值低估的，但我们无法判断重估的时间以及低估的幅度。所以我们的任务始终聚焦于寻找具备差异化竞争能力，具备核心竞争力的企业上，聚焦于等待合理的价格上。在市场充满悲观氛围的阶段，我们需要使自己的组合更加扎实，不断修正，减少判断错误和认知错误。在悲观氛围下，这些公司的股价也不可避免的会受到影响，但一旦市场正常化，这些公司将率先价值重估。

06 年、14 年、18 年，那些未来取得丰厚收益的时刻，无不伴随着市场参与者的痛苦、悲观、损失。08 年、15 年、21 年，那些未来可能产生重大亏损的时刻，无一不是伴随着鲜花和欢笑。犹记得 2020 年的时候，市场有人讽刺煤炭龙头赚的是假钱，无论再高的股息率，再好的现金流和盈利稳定性，都没能阻止股价的慢慢下跌。然而事实证明，正是这样的时刻，才有了后面几年煤炭龙头股价的高歌猛进。市场先生是一个情绪怪物，时而发疯，时而自闭，我们预测不了他，控制不了他。寒冬虽长，但在时间面前，唯有价值永存。

#### 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其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

本基金本报告期未进行利润分配，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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华宝 ESG 责任投资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	6,146,927.65	6,455,012.21
结算备付金		50,886.48	94,560.67
存出保证金		9,915.33	21,600.90
交易性金融资产	6.4.7.2	66,167,344.42	74,286,869.57
其中：股票投资		66,167,344.42	74,286,869.57
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		345,218.20	-
应收股利		-	91,116.16
应收申购款		359.55	44.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		72,720,651.63	80,949,204.50
<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		577,211.15	3.93
应付赎回款		12,204.94	1,587,180.69

应付管理人报酬		73,773.28	80,038.62
应付托管费		12,295.52	13,339.77
应付销售服务费		2,309.98	2,447.66
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	160,889.35	220,350.73
负债合计		838,684.22	1,903,361.40
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	88,525,782.12	98,616,200.55
未分配利润	6.4.7.8	-16,643,814.71	-19,570,357.45
净资产合计		71,881,967.41	79,045,843.10
负债和净资产总计		72,720,651.63	80,949,204.50

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 88,525,782.12 份，其中华宝 ESG 责任投资混合 A 基金份额总额 80,111,750.77 份，基金份额净值 0.8123 元；华宝 ESG 责任投资混合 C 基金份额总额 8,414,031.35 份，基金份额净值 0.8092 元。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝 ESG 责任投资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 4 月 28 日（基金 合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		1,860,201.39	4,604,469.83
1. 利息收入		11,872.23	514,764.83
其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,872.23	119,206.86
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		-	395,557.97
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,541,446.43	625,331.71
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-10,471,718.97	-108,644.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	33,893.77
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益		-	-



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	930,272.54	700,082.28
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	11,389,507.56	3,349,984.19
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	268.03	114,389.10
<b>减：二、营业总支出</b>		606,347.75	770,871.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	454,160.43	581,057.95
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	75,693.35	96,843.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	13,724.47	58,479.11
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	62,769.50	34,490.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,253,853.64	3,833,598.75
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,253,853.64	3,833,598.75
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,253,853.64	3,833,598.75

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华宝 ESG 责任投资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	98,616,200.55	-	-19,570,357.45	79,045,843.10
二、本期期初净资产	98,616,200.55	-	-19,570,357.45	79,045,843.10
三、本期增减变	-10,090,418.43	-	2,926,542.74	-7,163,875.69

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	1,253,853.64	1,253,853.64
(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)	-10,090,418.43	-	1,672,689.10	-8,417,729.33
其中:1.基金申购款	558,107.91	-	-107,202.75	450,905.16
2.基金赎回款	-10,648,526.34	-	1,779,891.85	-8,868,634.49
(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	88,525,782.12	-	-16,643,814.71	71,881,967.41
项目	上年度可比期间			
	2023年4月28日(基金合同生效日)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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	301,638,512.91	-	-	301,638,512.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-167,833,952.94	-	3,457,250.99	-164,376,701.95
(一)、综合收益总额	-	-	3,833,598.75	3,833,598.75
(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)	-167,833,952.94	-	-376,347.76	-168,210,300.70
其中:1.基金申购款	1,824,727.86	-	31,555.01	1,856,282.87
2.基金赎回款	-169,658,680.80	-	-407,902.77	-170,066,583.57
(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	133,804,559.97	-	3,457,250.99	137,261,810.96

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：

<u>向辉</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
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 ESG 责任投资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[2023]65 号文《关于准予华宝 ESG 责任投资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自 2023 年 4 月 6 日至 2023 年 4 月 26 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（2023）验字第 61471289\_B11 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 2023 年 4 月 28 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 301,589,857.48 元，其中 A 类基金份额的净认购金额为人民币 149,565,678.97 元；C 类基金份额的净认购金额为人民币 152,024,178.51 元；在募集期间产生利息为人民币 48,655.43 元，其中 A 类基金份额的有效认购资金在初始募集期内产生的利息为人民币 35,763.42 元；C 类基金份额的有效认购资金在初始募集期内产生的利息为人民币 12,892.01 元。以上实收基金（本息）合计为人民币 301,638,512.91 元，折合 301,638,512.91 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝 ESG 责任投资混合型证券投资基金基金合同》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、国债期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可参与融资业务。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 50%）；其中，投资于 ESG 责任投资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、国债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：沪深 300ESG 基准指数收益率×55%+中证综合债指数收益率×30%+恒生指数收益率×15%。

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### （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	6,146,927.65
等于：本金	6,146,370.23
加：应计利息	557.42
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	6,146,927.65

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	70,703,163.84	-	66,167,344.42	-4,535,819.42

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	70,703,163.84	-	66,167,344.42	-4,535,819.42

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	99,227.75
其中：交易所市场	99,227.75
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	61,661.60
合计	160,889.35

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝 ESG 责任投资混合 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	89,440,832.33	89,440,832.33
本期申购	348,226.56	348,226.56



本期赎回（以“-”号填列）	-9,677,308.12	-9,677,308.12
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	80,111,750.77	80,111,750.77

华宝 ESG 责任投资混合 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	9,175,368.22	9,175,368.22
本期申购	209,881.35	209,881.35
本期赎回（以“-”号填列）	-971,218.22	-971,218.22
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	8,414,031.35	8,414,031.35

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 ESG 责任投资混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,381,434.68	-15,350,917.45	-17,732,352.13
本期期初	-2,381,434.68	-15,350,917.45	-17,732,352.13
本期利润	-9,210,610.90	10,418,660.91	1,208,050.01
本期基金份额交易产生的变动数	976,285.28	509,338.59	1,485,623.87
其中：基金申购款	-16,647.57	-53,207.78	-69,855.35
基金赎回款	992,932.85	562,546.37	1,555,479.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,615,760.30	-4,422,917.95	-15,038,678.25

华宝 ESG 责任投资混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-265,924.85	-1,572,080.47	-1,838,005.32
本期期初	-265,924.85	-1,572,080.47	-1,838,005.32
本期利润	-925,043.02	970,846.65	45,803.63
本期基金份额交易产生的变动数	44,969.01	142,096.22	187,065.23
其中：基金申购款	-19,976.54	-17,370.86	-37,347.40
基金赎回款	64,945.55	159,467.08	224,412.63
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-1,145,998.86	-459,137.60	-1,605,136.46
-----	---------------	-------------	---------------

#### 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	10,524.46	
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	1,253.08	
其他	94.69	
合计	11,872.23	

#### 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

-

##### 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	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	68,426,114.77	
减：卖出股票成本总额	78,729,235.88	
减：交易费用	168,597.86	
买卖股票差价收入	-10,471,718.97	

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

-

#### 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

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

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

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	930,272.54
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	930,272.54

#### 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	11,389,507.56
股票投资	11,389,507.56
债券投资	-
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	11,389,507.56

#### 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	236.79
基金转换费收入	31.24
合计	268.03

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	39,781.56

证券出借违约金	-
银行费用	470.00
证券组合费	637.90
合计	62,769.50

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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4月28日(基金合同生效日)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	2,186,939.00	1.71	-	-

### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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

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4月28日（基金合同生效日） 至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）
华宝证券	-	-	280,508,000.00	20.60

### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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（%）
华宝证券	2,069.08	1.76	2,069.08	2.09
关联方名称	上年度可比期间 2023年4月28日（基金合同生效日）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（%）
-	-	-	-	-

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4月28日（基金合 同生效日）至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	454,160.43	581,057.95
其中：应支付销售机构的客户维护	223,316.88	273,846.93

费		
应支付基金管理人的净管理费	230,843.55	307,211.02

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	75,693.35	96,843.04

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 ESG 责任投资混合 A	华宝 ESG 责任投资混合 C	合计
华宝基金	-	21.82	21.82
建设银行	-	12,547.09	12,547.09
合计	-	12,568.91	12,568.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）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 ESG 责任投资混合 A	华宝 ESG 责任投资混合 C	合计

建设银行	-	57,462.68	57,462.68
合计	-	57,462.68	57,462.68

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自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自有资金投资本基金。

##### 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 4 月 28 日(基金合同生效日)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
中国建设银行	6,146,927.65	10,524.46	13,081,165.44	24,443.74

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 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

本基金是一只混合型的证券投资基金，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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，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	6,146,927.65	-	-	-	6,146,927.65
结算备付金	50,886.48	-	-	-	50,886.48
存出保证金	9,915.33	-	-	-	9,915.33
交易性金融资产	-	-	-	66,167,344.42	66,167,344.42
应收申购款	-	-	-	359.55	359.55
应收清算款	-	-	-	345,218.20	345,218.20
资产总计	6,207,729.46	-	-	66,512,922.17	72,720,651.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,204.94	12,204.94
应付管理人报酬	-	-	-	73,773.28	73,773.28
应付托管费	-	-	-	12,295.52	12,295.52
应付清算款	-	-	-	577,211.15	577,211.15
应付销售服务费	-	-	-	2,309.98	2,309.98

其他负债	-	-	-	160,889.35	160,889.35
负债总计	-	-	-	838,684.22	838,684.22
利率敏感度缺口	6,207,729.46	-	-	65,674,237.95	71,881,967.41
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	6,455,012.21	-	-	-	6,455,012.21
结算备付金	94,560.67	-	-	-	94,560.67
存出保证金	21,600.90	-	-	-	21,600.90
交易性金融资产	-	-	-	74,286,869.57	74,286,869.57
应收股利	-	-	-	91,116.16	91,116.16
应收申购款	-	-	-	44.99	44.99
资产总计	6,571,173.78	-	-	74,378,030.72	80,949,204.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,587,180.69	1,587,180.69
应付管理人报酬	-	-	-	80,038.62	80,038.62
应付托管费	-	-	-	13,339.77	13,339.77
应付清算款	-	-	-	3.93	3.93
应付销售服务费	-	-	-	2,447.66	2,447.66
其他负债	-	-	-	220,350.73	220,350.73
负债总计	-	-	-	1,903,361.40	1,903,361.40
利率敏感度缺口	6,571,173.78	-	-	72,474,669.32	79,045,843.10

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，本基金未持有交易性债券投资(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			合计
	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	
以外币计价的				

资产				
交易性金融资产	-	14,545,372.04	-	14,545,372.04
资产合计	-	14,545,372.04	-	14,545,372.04
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	-	14,545,372.04	-	14,545,372.04
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	-	17,978,462.33	-	17,978,462.33
应收股利	-	91,116.16	-	91,116.16
资产合计	-	18,069,578.49	-	18,069,578.49
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	-	18,069,578.49	-	18,069,578.49

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）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	727,268.60	903,478.92
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-727,268.60	-903,478.92

### 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”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，做出资产配置及组合构建的决定；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 50%）；其中，投资于 ESG 责任投资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、国债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%。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	66,167,344.42	92.05	74,286,869.57	93.98
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	66,167,344.42	92.05	74,286,869.57	93.98

### 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）
	1. 业绩比较基准上升 5%	5,875,553.22	-
2. 业绩比较基准下降 5%	-5,875,553.22	-	

注：上年度末，该基金成立未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

### 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	66,167,344.42	74,286,869.57
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	66,167,344.42	74,286,869.57

##### 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	66,167,344.42	90.99
	其中：股票	66,167,344.42	90.99
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	6,197,814.13	8.52
8	其他各项资产	355,493.08	0.49
9	合计	72,720,651.63	100.00

注：1、通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 14,545,372.04 元，占基金资产净值的比例为 20.24%。

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	-	-
C	制造业	39,729,026.38	55.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,213,960.00	1.69
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,467,992.00	7.61
L	租赁和商务服务业	5,210,994.00	7.25
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	51,621,972.38	71.81

### 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	6,797,640.64	9.46
科技	-	-
公用事业	-	-
非必须消费品	7,747,731.40	10.78
必须消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
房地产	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
材料	-	-
合计	14,545,372.04	20.24

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	03998	波司登	1,580,000	7,022,707.53	9.77
2	00700	腾讯控股	20,000	6,797,640.64	9.46
3	300750	宁德时代	34,520	6,214,635.60	8.65
4	603486	科沃斯	130,491	6,156,565.38	8.56
5	600048	保利发展	624,200	5,467,992.00	7.61
6	002027	分众传媒	859,900	5,210,994.00	7.25
7	002594	比亚迪	16,000	4,004,000.00	5.57
8	300274	阳光电源	54,180	3,360,785.40	4.68
9	000807	云铝股份	205,500	2,776,305.00	3.86
10	603806	福斯特	186,000	2,734,200.00	3.80
11	600176	中国巨石	219,100	2,421,055.00	3.37
12	000792	盐湖股份	126,300	2,203,935.00	3.07
13	601865	福莱特	106,000	2,130,600.00	2.96
14	002475	立讯精密	50,100	1,969,431.00	2.74
15	300196	长海股份	173,200	1,754,516.00	2.44
16	600519	贵州茅台	1,100	1,614,129.00	2.25
17	002415	海康威视	48,500	1,499,135.00	2.09
18	605368	蓝天燃气	89,000	1,213,960.00	1.69
19	002372	伟星新材	57,700	889,734.00	1.24
20	02015	理想汽车-W	11,300	725,023.87	1.01

## 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	601865	福莱特	5,885,226.00	7.45
2	002027	分众传媒	5,547,193.00	7.02
3	603806	福斯特	4,567,375.00	5.78
4	601888	中国中免	4,497,446.00	5.69
5	300274	阳光电源	4,013,790.00	5.08
6	002594	比亚迪	3,734,163.97	4.72
7	000792	盐湖股份	3,654,982.00	4.62
8	000807	云铝股份	3,052,259.00	3.86
9	300750	宁德时代	3,051,099.45	3.86
10	601633	长城汽车	2,881,868.00	3.65
11	300196	长海股份	2,639,164.00	3.34
12	00968	信义光能	1,961,211.14	2.48
13	600048	保利发展	1,876,732.00	2.37
14	600519	贵州茅台	1,630,402.00	2.06

15	600298	安琪酵母	1,483,998.00	1.88
16	600176	中国巨石	1,478,290.00	1.87
17	605368	蓝天燃气	1,165,754.00	1.47
18	002572	索菲亚	1,159,577.00	1.47
19	600566	济川药业	969,084.00	1.23
20	002372	伟星新材	911,836.00	1.15

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	002709	天赐材料	5,115,378.00	6.47
2	000807	云铝股份	5,082,167.00	6.43
3	300750	宁德时代	4,624,429.00	5.85
4	601888	中国中免	4,249,548.08	5.38
5	000002	万科 A	4,181,937.00	5.29
6	000858	五粮液	4,018,602.00	5.08
7	00968	信义光能	3,242,681.51	4.10
8	03998	波司登	3,060,781.16	3.87
9	601633	长城汽车	3,001,833.00	3.80
10	600298	安琪酵母	2,850,549.00	3.61
11	601865	福莱特	2,730,661.00	3.45
12	603939	益丰药房	2,674,204.00	3.38
13	600566	济川药业	2,463,587.00	3.12
14	00700	腾讯控股	2,204,940.30	2.79
15	000333	美的集团	2,169,502.00	2.74
16	600048	保利发展	1,867,288.04	2.36
17	00868	信义玻璃	1,612,678.08	2.04
18	600176	中国巨石	1,500,818.00	1.90
19	002938	鹏鼎控股	1,429,666.00	1.81
20	000792	盐湖股份	1,425,640.00	1.80

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	59,220,203.17
卖出股票收入（成交）总额	68,426,114.77

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

**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**

本基金本报告期末未持有债券投资。

**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**

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。

**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	9,915.33
2	应收清算款	345,218.20
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	359.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	355,493.08

### 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 ESG 责任投资混合 A	670	119,569.78	0.00	0.00	80,111,750.77	100.00
华宝 ESG 责任投资混合 C	296	28,425.78	50,034.38	0.59	8,363,996.97	99.41
合计	966	91,641.60	50,034.38	0.06	88,475,747.74	99.94

### 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 ESG 责任投资混合 A	1,353,722.29	1.6898
	华宝 ESG 责任投资混合 C	9,571.20	0.1138
	合计	1,363,293.49	1.5400

### 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	华宝 ESG 责任投资混合 A	0
	华宝 ESG 责任投资混合 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有 本开放式基金	华宝 ESG 责任投资混合 A	>100
	华宝 ESG 责任投资混合 C	0
	合计	>100

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝 ESG 责任投资混合 A	华宝 ESG 责任投资混合 C
基金合同生效日 (2023 年 4 月 28 日) 基金份额总额	149,601,442.39	152,037,070.52
本报告期期初基金份 额总额	89,440,832.33	9,175,368.22
本报告期基金总申购 份额	348,226.56	209,881.35
减：本报告期基金总 赎回份额	9,677,308.12	971,218.22
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	80,111,750.77	8,414,031.35

### § 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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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 (%)	
招商证券	2	23,939,277.92	18.75	22,404.88	19.08	-
华泰证券	1	15,884,583.80	12.44	13,150.92	11.20	-
中信证券	2	15,833,716.00	12.40	14,976.41	12.75	-
中信建投	2	10,704,026.00	8.39	10,017.81	8.53	-
民生证券	1	9,797,183.08	7.68	9,266.74	7.89	-
华福证券	2	6,878,699.00	5.39	6,506.21	5.54	-
海通证券	1	5,549,646.00	4.35	5,250.02	4.47	-
西部证券	1	4,642,365.00	3.64	3,416.35	2.91	-
东北证券	1	4,300,030.00	3.37	4,067.38	3.46	-
天风证券	2	3,358,850.00	2.63	3,143.55	2.68	-
华创证券	1	3,344,222.04	2.62	3,163.20	2.69	-
山西证券	2	3,022,722.40	2.37	2,849.08	2.43	-
国泰君安	2	2,769,259.00	2.17	2,599.69	2.21	-
国信证券	1	2,398,315.70	1.88	2,268.49	1.93	-
申万宏源	2	2,188,504.00	1.71	2,069.92	1.76	-
华宝证券	1	2,186,939.00	1.71	2,069.08	1.76	-
兴业证券	2	1,754,167.00	1.37	1,659.25	1.41	-
中泰证券	2	1,587,554.00	1.24	1,485.88	1.27	-
开源证券	1	1,487,962.00	1.17	1,392.52	1.19	-
华西证券	2	1,485,019.00	1.16	1,405.09	1.20	-

方正证券	2	994,613.00	0.78	940.72	0.80	-
长城证券	3	871,846.00	0.68	824.68	0.70	-
瑞银证券	1	817,503.00	0.64	773.38	0.66	-
银河证券	1	745,248.00	0.58	704.92	0.60	-
长江证券	1	729,199.00	0.57	689.73	0.59	-
广发证券	2	374,868.00	0.29	354.61	0.30	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
大和证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海 证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
高盛（中 国）证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	3	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
中山证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
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新增的有：华福证券；退租交易单元：申港证券。

### 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

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 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
2	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
3	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
4	华宝基金关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2024-06-24
5	华宝 ESG 责任投资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
6	华宝 ESG 责任投资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

## § 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

-

## § 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 ESG 责任投资混合型证券投资基金基金合同；  
华宝 ESG 责任投资混合型证券投资基金招募说明书；  
华宝 ESG 责任投资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及基金托管人办公场所备投资者查阅。

## 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