华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 29 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 13
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 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
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 15

§5 托管人报告 15

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
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 15

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15

6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 17
6.3 净资产（基金净值）变动表 18
6.4 报表附注 21

§7 投资组合报告 45

7.1 期末基金资产组合情况 45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 46
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 47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 60
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 60
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 60
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 60

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.....60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....60
7.12 投资组合报告附注.....61

§8 基金份额持有人信息.....62

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....62
8.2 期末上市基金前十名持有人.....62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....63
8.4 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.....63

§9 开放式基金份额变动.....63

§10 重大事件揭示.....64

10.1 基金份额持有人大会决议.....64
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.....64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....64
10.4 基金投资策略的改变.....64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....64
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.....64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....64
10.8 其他重大事件.....66

§11 影响投资者决策的其他重要信息.....67

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.....67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....67

§12 备查文件目录.....67

12.1 备查文件目录.....67
12.2 存放地点.....68
12.3 查阅方式.....68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）	
基金简称	华宝 MSCI ESG 指数	
场内简称	ESG 基金 LOF	
基金主代码	501086	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 8 月 21 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	22,479,449.10 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2019 年 9 月 12 日	
下属分级基金的基金简称	华宝 MSCI ESG 指数	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C
下属分级基金的场内简称	ESG 基金 LOF	-
下属分级基金的交易代码	501086	012811
报告期末下属分级基金的份额总额	22,077,286.22 份	402,162.88 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

	对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周雷	郭明
	联系电话	021-38505888	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	95588
传真		021-38505777	010-66105798
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 55 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 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		XIAOYI HELEN HUANG	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人	北京市西城区太平桥大街 17 号、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(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	华宝 MSCI ESG 指数	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数

		（LOF）C
本期已实现收益	-1,737,821.93	-10,288.19
本期利润	-4,857,701.30	29,359.74
加权平均基金份额本期利润	-0.1841	0.1453
本期加权平均净值利润率	-13.70%	10.95%
本期基金份额净值增长率	-8.26%	-8.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	8,701,919.29	157,620.91
期末可供分配基金份额利润	0.3942	0.3919
期末基金资产净值	30,779,205.51	559,783.79
期末基金份额净值	1.3942	1.3919
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	39.42%	-8.85%

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 MSCI ESG 指数

阶段	份额净	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①－③	②－④

	值增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	9.20%	0.98%	8.74%	1.00%	0.46%	-0.02%
过去三个月	6.29%	1.35%	5.21%	1.37%	1.08%	-0.02%
过去六个月	-8.26%	1.37%	-9.20%	1.38%	0.94%	-0.01%
过去一年	-10.55%	1.17%	-12.23%	1.18%	1.68%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	39.42%	1.19%	24.63%	1.20%	14.79%	-0.01%

华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C

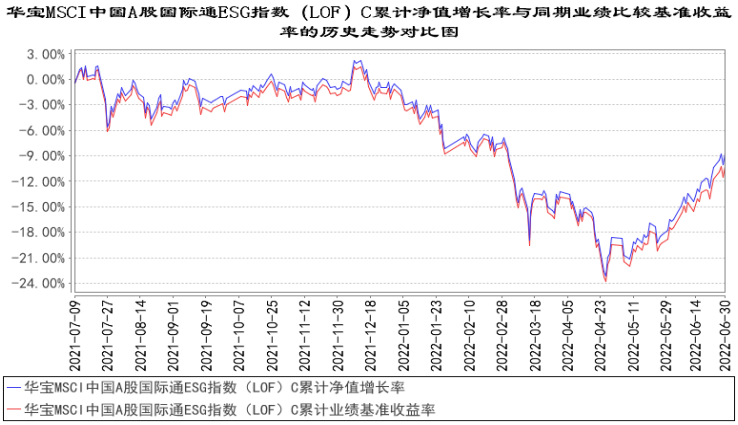
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	9.19%	0.98%	8.74%	1.00%	0.45%	-0.02%
过去三个月	6.24%	1.35%	5.21%	1.37%	1.03%	-0.02%
过去六个月	-8.35%	1.37%	-9.20%	1.38%	0.85%	-0.01%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-8.85%	1.16%	-10.29%	1.18%	1.44%	-0.02%

注：（1）基金业绩基准：MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数收益率×95%＋人民币银行活期存

款利率（税后）×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



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 02 月 21 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，公司注册资本为人民币 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、深圳等地设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理(香港）有限公司。

截至本报告期末（2022 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的证券投资基金包括：华宝宝康债券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合混合型证券投资基金、华宝先进成长混合型证券投资基金、华宝行业精选混合型证券投资基金、华宝海外中国成长混合型证券投资基金、华宝大盘精选混合型证券投资基金、华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝中证 100 指数证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)、华宝资源优选混合型证券投资基金、华宝现金添益交易型货币市场基金、华宝创新优选混合型证券投资基金、华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金(LOF)、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝浮动净值型发起式货币市场基金、华宝致远混合型证券投资基金（QDII）、华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）、华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金等，共 128 只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡洁	本基金基金经理、指数投资总监、指数研发投资部总经理	2019-08-21	-	16 年	硕士。2006 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，现任指数投资总监、指数研发投资部总经理。2012 年 10 月至 2018 年 11 月任华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2012 年 10 月至 2019 年 1 月任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2015 年 5 月至 2020 年 12 月任华宝中证医

					疗指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 6 月至 2018 年 8 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 8 月起任华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2017 年 1 月起任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金经理，2017 年 7 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018 年 11 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019 年 1 月至 2021 年 3 月任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金(LOF)基金经理，2019 年 5 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 7 月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 8 月起任华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金(LOF)基金经理，2019 年 8 月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2019 年 12 月起任华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金经理，2021 年 1 月至 2021 年 5 月任华宝中证医疗指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 5 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2021 年 6 月起任华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 8 月起任华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 9 月起任华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
张放	本基金基金经理	2021-03-08	-	11 年	硕士。曾在海通期货股份有限公司、长江证券股份有限公司从事分析研究工作。2014 年 9 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任投资经理、基金经理助理等职务。2021 年 1 月起任华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月起任华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金(LOF)基金经

					理，2021 年 5 月起任华宝中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 9 月起任华宝中证养老产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 10 月起任华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 12 月起任华宝国证治理指数型发起式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》及其各项实施细则、《华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）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，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

2022 年上半年，全球股市受到地缘政治风险的冲击，市场避险情绪升温，震荡明显。一季度全球股市由于受到俄乌冲突影响，在 2 月后出现明显下跌；二季度全球经济环境日趋严峻，美国高企的通胀水平令美联储不得不放弃经济增长目标而推行紧缩的货币政策，俄乌冲突后衍生出各国间的经济制裁行为令本就不景气的欧洲经济前景变得更加不乐观，同时推升了欧洲乃至全球的资源价格水平，世界经济呈现增长乏力和通胀高企的迹象。相比之下，国内经济在今年上半年克服了诸多超预期因素的不利影响，GDP 依然取得了 2.5%的正增长，表现出较强的韧劲。政府采取的维稳经济政策成效明显。展望 2022 年下半年，预计“稳增长”仍然会是国内经济政策的主要目标，宏观流动性预计将维持总体宽松的基调。市场方面，A 股上半年走出了先抑后扬的走势。一季度在疫情与地缘政治的共同影响，市场避险情绪蔓延，A 股震荡加剧，特别是前期涨幅较大的热门股出现了比较明显的下跌。随后市场筑底回升，走出结构性行情，成长板块反弹强劲。行业方面，煤炭、交运等行业表现较好，电子、计算机、传媒等行业表现较弱。本报告期中，以中证 100 指数和沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股指数分别下跌了 8.07%和 9.22%；而作为成长股代表的中证 1000 指数和创业板指数分别下跌了 12.67%和 15.41%。在本报告期中， MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数累计下跌了 9.73%。

本报告期本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 净值增长率为-8.26%，本报告期基金份额 C 净值增长率为-8.35%;同期业绩比较基准收益率为-9.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济与市场方面，展望 2022 年下半年，随着政府出台的一系列稳住经济大盘的政策措施，货币、财政、稳就业等方面政策形成合力，稳增长政策将充分发挥出效果，助力经济修复。宏观流动性上预计将维持总体宽松的基调。证券市场方面，当前正处于估值修复期，市场整体向好，但波动在增加，结构性行情或将延续。

随着中国经济的发展，政策的重视以及资本市场的开放，ESG 投资在中国受到了更多的关注。监管机构对于上市企业披露 ESG 信息要求也越来越严，注重环境保护、健全公司治理、公开透明的公司也更容易获得投资者的信任。同时，ESG 投资也是资本市场实现“碳达峰和碳中和”的很

好的工具。MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数是在 MSCI 中国 A 股国际通指数（母指数）基础上，通过 ESG 评分重新调整自由流通市值权重而编制的指数。该指数主要通过增加 ESG 评级较好或 ESG 评级趋势向上的股票的权重，来体现 ESG 对指数的影响。该指数聚焦了中国核心资产，市值风格偏向大市值公司；从行业分布上看，指数行业分布均衡，风险相对分散，囊括了银行、医药生物、电气设备、食品饮料、非银金融、电子等众多行业，是适合投资者中长期配置的良好工具。

作为指数基金的管理人，我们将继续严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，积极应对成分股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对目标指数的跟踪误差，实现对 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数的有效跟踪。

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。

（1）日常估值流程

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帐务处理；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。

（2）特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》等有关规定及本公司的估值制度，对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况，量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存

在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

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

截至本报告期末，本基金基金资产净值存在连续超过六十个工作日低于五千万元的情形。根据相关规定，本基金管理人已拟定了相应的解决方案，并已将方案报告监管机构。

§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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——华宝基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对华宝基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	2,390,669.92	3,516,257.14
结算备付金		21,823.81	1,706.74
存出保证金		6,709.27	4,553.15

交易性金融资产	6.4.7.2	29,513,266.86	37,362,005.07
其中：股票投资		29,513,266.86	37,362,005.07
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	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	48,411.89
应收股利		-	-
应收申购款		23,224.58	6,699.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	446.48
资产总计		31,955,694.44	40,940,080.00
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2022 年 6 月 30 日**	**上年度末 2021 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	40.98
应付赎回款		111,540.27	827,761.29
应付管理人报酬		12,450.45	20,749.39
应付托管费		2,490.11	4,149.86
应付销售服务费		118.38	32.02
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	6.4.7.9	490,105.93	476,778.70
负债合计		616,705.14	1,329,512.24
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	22,479,449.10	26,063,567.79
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	8,859,540.20	13,546,999.97
净资产合计		31,338,989.30	39,610,567.76

负债和净资产总计		31,955,694.44	40,940,080.00

注： 1.报告截止日 2022 年 06 月 30 日,基金份额总额 22,479,449.10 份，其中华宝 MSCI ESG 指数基金份额总额 22,077,286.22 份，基金份额净值 1.3942 元；华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C 基金份额总额 402,162.88 份，基金份额净值 1.3919 元

2.以上比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-4,614,581.27	2,283,308.59
1.利息收入		5,438.69	4,738.83
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,438.69	4,738.83
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,703,369.80	2,512,540.85
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,948,778.70	2,248,798.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	245,408.90	263,741.86
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-

其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-3,080,231.44	-241,736.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	163,581.28	7,765.43
减：二、营业总支出		213,760.29	242,988.27
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	88,621.59	90,714.64
2．托管费	6.4.10.2.2	17,724.30	18,142.90
3．销售服务费	6.4.10.2.3	254.66	-
4．投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7．税金及附加		-	-
8．其他费用	6.4.7.23	107,159.74	134,130.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,828,341.56	2,040,320.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,828,341.56	2,040,320.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,828,341.56	2,040,320.32

注：以上比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	26,063,567.79	-	13,546,999.97	39,610,567.76

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	26,063,567.79	-	13,546,999.97	39,610,567.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,584,118.69	-	-4,687,459.77	-8,271,578.46
（一）、综合收益总额	-	-	-4,828,341.56	-4,828,341.56
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,584,118.69	-	140,881.79	-3,443,236.90
其中：1.基金申购款	13,070,073.66	-	4,682,710.15	17,752,783.81
2.基金赎回款	-16,654,192.35	-	-4,541,828.36	-21,196,020.71
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收	-	-	-	-

益结转留存收益				
四、本期期末净资产（基金净值）	22,479,449.10	-	8,859,540.20	31,338,989.30
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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（基金净值）	22,892,553.92	-	10,984,777.70	33,877,331.62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	22,892,553.92	-	10,984,777.70	33,877,331.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,004,411.49	-	3,483,439.60	6,487,851.09
（一）、综合收益总额	-	-	2,040,320.32	2,040,320.32
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,004,411.49	-	1,443,119.28	4,447,530.77
其中：1.基金申购款	9,857,710.44	-	5,048,760.36	14,906,470.80
2.基金赎回	-6,853,298.95	-	-3,605,641.08	-10,458,940.03

款				
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	25,896,965.41	-	14,468,217.30	40,365,182.71

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 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）（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[2019]113 号文《关于准予华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）注册的批复》准予注册，由基金管理人华宝基金管理有限公司于 2019 年 7 月 19 日至 2019 年 8 月 16 日止期间向社会公开募集，募集期结束经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具德师报（验）字（19）第 00225 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 2019 年 8 月 21 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 316,782,770.10 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 73,536.96 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 316,856,306.97 元，折合 316,856,306.97 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。 经与基金托管人中国工商银行股份有限公司

协商一致，并报中国证监会备案，华宝基金管理有限公司决定自 2021 年 7 月 9 日起，增设华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）的 C 类基金份额，并相应修改基金合同等法律文件相关条款。增加 C 类基金份额后，本基金将设 A 类基金份额和 C 类基金份额两个类别，本基金原有份额调整为 A 类基金份额。 本基金的投资范围包括标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的其他股票（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。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。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。 基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且投资于标的指数成份股及其备选成份股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，应保持不低于基金资产净值 5%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。本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数收益率×95%＋人民币银行活期存款利率（税后）×5%。 本财务报表已于 2022 年 8 月 31 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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）和在财务报表附注所列示依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监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 2 号《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。 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 2022 年 6 月 30 日的财

务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和

实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益 ，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映

在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，原金融资产账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,516,257.14 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 443.40 元，重新计量金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,516,700.54 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,706.74 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.88 元，重新计量金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,707.62 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,553.15 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2.20 元，重新计量金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,555.35 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 446.48 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 443.40 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 0.88 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 2.20 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息在新金融工具准则下不再单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产项目无影响。于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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‰； 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暂行条例（2011 年修订）》、《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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	2,390,669.92
等于：本金	2,390,433.64
加：应计利息	236.28
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	2,390,669.92

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		28,905,984.56	-	29,513,266.86	607,282.30
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		28,905,984.56	-	29,513,266.86	607,282.30

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。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	170.07
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	218,213.53
其中：交易所市场	218,213.53
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	42,250.83
应付指数使用费	229,471.50
合计	490,105.93

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华宝 MSCI ESG 指数

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,979,620.20	25,979,620.20

本期申购	10,908,228.87	10,908,228.87
本期赎回（以“-”号填列）	-14,810,562.85	-14,810,562.85
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	22,077,286.22	22,077,286.22

华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	83,947.59	83,947.59
本期申购	2,161,844.79	2,161,844.79
本期赎回（以“-”号填列）	-1,843,629.50	-1,843,629.50
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	402,162.88	402,162.88

6.4.7.11 其他综合收益

无

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华宝 MSCI ESG 指数

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	13,357,923.26	145,534.97	13,503,458.23
本期利润	-1,737,821.93	-3,119,879.37	-4,857,701.30
本期基金份额交易产生的变动数	-1,824,599.93	1,880,762.29	56,162.36
其中：基金申购款	5,587,380.97	-1,590,601.68	3,996,779.29
基金赎回款	-7,411,980.90	3,471,363.97	-3,940,616.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,795,501.40	-1,093,582.11	8,701,919.29

华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	43,067.99	473.75	43,541.74
本期利润	-10,288.19	39,647.93	29,359.74
本期基金份额交易产生的变动数	144,768.74	-60,049.31	84,719.43
其中：基金申购款	972,264.30	-286,333.44	685,930.86
基金赎回款	-827,495.56	226,284.13	-601,211.43
本期已分配利润	-	-	-

本期末	177,548.54	-19,927.63	157,620.91

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,160.30
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	228.55
其他	49.84
合计	5,438.69

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

无

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	15,677,207.23
减：卖出股票成本总额	17,581,676.30
减：交易费用	44,309.63
买卖股票差价收入	-1,948,778.70

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无

6.4.7.16.2 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。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	245,408.90
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	245,408.90

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-3,080,231.44
股票投资	-3,080,231.44
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	-3,080,231.44

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	163,581.28
合计	163,581.28

注：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。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	17,455.64
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	1,151.91
指数使用费	63,757.00
合计	107,159.74

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

2022 年 4 月 25 日，中国证监会核准华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management，L.P.）将持有的华宝基金管理有限公司 20%股权转让

给江苏省铁路集团。2022 年 5 月 24 日股权变更完成之后，华宝基金管理有限公司控股股东仍为华宝信托（持股 51%），华平投资（29%）、江苏省铁路集团（20%）分列第二、第三大股东。

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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	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
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
江苏省铁路集团有限公司("江苏铁集")	基金管理人的股东
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

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交易。

6.4.10.1.2 债券交易

无

6.4.10.1.3 债券回购交易

无

6.4.10.1.4 权证交易

无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	88,621.59	90,714.64
其中：支付销售机构的客户维护费	19,175.12	19,178.63

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 0.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.50%÷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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,724.30	18,142.90

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 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%÷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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝 MSCI ESG 指数	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C	合计
华宝基金	-	0.57	0.57
合计	-	0.57	0.57
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝 MSCI ESG 指数	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C	合计
合计	-	-	-

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 0.20%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×0.20%÷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

无

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内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

份额单位：份

华宝 MSCI ESG 指数

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 （%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
华宝投资有限公司	9,999,450.00	45.29	9,999,450.00	38.49

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国工商银行股份有限公司	2,390,669.92	5,160.30	2,712,890.62	4,556.88

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期末投资于基金托管人中国工商银行发行的股票——工商银行（证券代码：

601398）71,100 股，期末公允价值为人民币 339,147.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 1.08%。（上年度末：持有 89,400 股，期末公允价值为人民币 413,922.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 1.05%）

除以上情况外，无其他需要说明的关联方交易事项。

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(2022 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

本基金为指数型基金，采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，跟踪 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数。本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。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与跟踪指数相同的风险收益目标。　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信用良好的银行，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资产净值的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险(上年度末：同)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无

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，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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，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。

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因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银行存款、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 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	2,390,669.92	-	-	-	2,390,669.92
结算备付金	21,823.81	-	-	-	21,823.81
存出保证金	6,709.27	-	-	-	6,709.27
交易性金融资产	-	-	-	29,513,266.86	29,513,266.86
应收申购款	5.00	-	-	23,219.58	23,224.58
资产总计	2,419,208.00	-	-	29,536,486.44	31,955,694.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	111,540.27	111,540.27
应付管理人报酬	-	-	-	12,450.45	12,450.45
应付托管费	-	-	-	2,490.11	2,490.11
应付销售服务费	-	-	-	118.38	118.38
其他负债	-	-	-	490,105.93	490,105.93
负债总计	-	-	-	616,705.14	616,705.14
利率敏感度缺口	2,419,208.00	-	-	28,919,781.30	31,338,989.30
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,516,257.14	-	-	-	3,516,257.14
结算备付金	1,706.74	-	-	-	1,706.74
存出保证金	4,553.15	-	-	-	4,553.15
交易性金融资产	-	-	-	37,362,005.07	37,362,005.07
应收申购款	5.00	-	-	6,694.53	6,699.53
应收证券清算款	-	-	-	48,411.89	48,411.89
其他资产	-	-	-	446.48	446.48
资产总计	3,522,522.03	-	-	37,417,557.97	40,940,080.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	827,761.29	827,761.29
应付管理人报酬	-	-	-	20,749.39	20,749.39
应付托管费	-	-	-	4,149.86	4,149.86
应付证券清算款	-	-	-	40.98	40.98
应付销售服务费	-	-	-	32.02	32.02
其他负债	-	-	-	476,778.70	476,778.70
负债总计	-	-	-	1,329,512.24	1,329,512.24
利率敏感度缺口	3,522,522.03	-	-	36,088,045.73	39,610,567.76

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或持有比例较低，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

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。

本基金采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标，股票资产跟踪的标的指数为 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且投资于标的指数成份股及其备选成份股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，应保持不低于基金资产净值 5%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。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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021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	29,513,266.86	94.17	37,362,005.07	94.32
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	29,513,266.86	94.17	37,362,005.07	94.32

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		
	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 （2022 年 6 月 30 日）	上年度末 （2021 年 12 月

			31 日 ）
分析	1.业绩比较基准上升 5%	1,549,714.17	1,957,620.17
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,549,714.17	-1,957,620.17

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	29,513,266.86	37,358,335.41
第二层次	-	3,669.66
第三层次	-	-
合计	29,513,266.86	37,362,005.07

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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	29,513,266.86	92.36
	其中：股票	29,513,266.86	92.36
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	2,412,493.73	7.55
8	其他各项资产	29,933.85	0.09
9	合计	31,955,694.44	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	356,615.66	1.14
B	采矿业	781,714.20	2.49
C	制造业	15,985,082.88	51.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,083,986.40	3.46
E	建筑业	355,418.60	1.13
F	批发和零售业	271,727.20	0.87
G	交通运输、仓储和邮政业	860,099.80	2.74
H	住宿和餐饮业	25,160.00	0.08

I	信息传输、软件和信息技术服务业	949,616.44	3.03
J	金融业	6,469,732.97	20.64
K	房地产业	675,368.20	2.16
L	租赁和商务服务业	560,902.00	1.79
M	科学研究和技术服务业	678,158.16	2.16
N	水利、环境和公共设施管理业	39,854.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	268,891.25	0.86
R	文化、体育和娱乐业	105,556.00	0.34
S	综合	31,027.00	0.10
	合计	29,498,910.76	94.13

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	14,356.10	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公	-	-

	共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,356.10	0.05

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

7.3.1 期末指数投资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	600519	贵州茅台	600	1,227,000.00	3.92
2	600036	招商银行	23,300	983,260.00	3.14
3	300750	宁德时代	1,600	854,400.00	2.73
4	600900	长江电力	25,700	594,184.00	1.90
5	601012	隆基绿能	8,540	569,020.20	1.82
6	002594	比亚迪	1,600	533,584.00	1.70
7	603259	药明康德	4,584	476,690.16	1.52
8	300760	迈瑞医疗	1,400	438,480.00	1.40
9	601888	中国中免	1,800	419,274.00	1.34
10	601166	兴业银行	18,800	374,120.00	1.19
11	000858	五 粮 液	1,800	363,474.00	1.16
12	601318	中国平安	7,321	341,817.49	1.09
13	601398	工商银行	71,100	339,147.00	1.08
14	002352	顺丰控股	5,500	306,955.00	0.98
15	002475	立讯精密	7,980	269,644.20	0.86
16	002142	宁波银行	7,450	266,784.50	0.85
17	000001	平安银行	17,500	262,150.00	0.84
18	002304	洋河股份	1,400	256,410.00	0.82
19	300274	阳光电源	2,600	255,450.00	0.82
20	002812	恩捷股份	1,000	250,450.00	0.80
21	600030	中信证券	10,990	238,043.40	0.76
22	601288	农业银行	76,900	232,238.00	0.74
23	600000	浦发银行	26,500	212,265.00	0.68
24	600690	海尔智家	7,100	194,966.00	0.62
25	600809	山西汾酒	600	194,880.00	0.62

26	600048	保利发展	10,800	188,568.00	0.60
27	000002	万　　科 A	8,800	180,400.00	0.58
28	601328	交通银行	35,500	176,790.00	0.56
29	000568	泸州老窖	700	172,578.00	0.55
30	600887	伊利股份	4,300	167,485.00	0.53
31	002714	牧原股份	2,938	162,383.26	0.52
32	600905	三峡能源	25,800	162,282.00	0.52
33	601658	邮储银行	30,000	161,700.00	0.52
34	603288	海天味业	1,726	155,961.36	0.50
35	300498	温氏股份	7,160	152,436.40	0.49
36	600019	宝钢股份	25,200	151,704.00	0.48
37	300059	东方财富	5,966	151,536.40	0.48
38	002460	赣锋锂业	1,000	148,700.00	0.47
39	600028	中国石化	36,000	146,880.00	0.47
40	601601	中国太保	6,200	145,886.00	0.47
41	601066	中信建投	4,900	141,659.00	0.45
42	603799	华友钴业	1,430	136,736.60	0.44
43	600309	万华化学	1,400	135,786.00	0.43
44	601988	中国银行	39,700	129,422.00	0.41
45	300014	亿纬锂能	1,322	128,895.00	0.41
46	688599	天合光能	1,918	125,149.50	0.40
47	600438	通威股份	2,000	119,720.00	0.38
48	000538	云南白药	1,980	119,572.20	0.38
49	600016	民生银行	32,000	119,040.00	0.38
50	300124	汇川技术	1,800	118,566.00	0.38
51	601688	华泰证券	8,300	117,860.00	0.38
52	601009	南京银行	11,300	117,746.00	0.38
53	000063	中兴通讯	4,500	114,885.00	0.37
54	603993	洛阳钼业	20,000	114,600.00	0.37
55	000895	双汇发展	3,900	114,270.00	0.36
56	601818	光大银行	37,400	112,574.00	0.36
57	601138	工业富联	11,200	110,208.00	0.35
58	603659	璞泰来	1,300	109,720.00	0.35
59	002027	分众传媒	16,300	109,699.00	0.35
60	300015	爱尔眼科	2,425	108,567.25	0.35
61	600436	片仔癀	300	107,019.00	0.34
62	600276	恒瑞医药	2,872	106,522.48	0.34
63	601668	中国建筑	18,930	100,707.60	0.32
64	000725	京东方 A	25,400	100,076.00	0.32
65	601088	中国神华	3,000	99,900.00	0.32
66	000776	广发证券	5,300	99,110.00	0.32
67	603806	福斯特	1,500	98,280.00	0.31

68	600999	招商证券	6,720	96,835.20	0.31
69	600660	福耀玻璃	2,300	96,163.00	0.31
70	688111	金山办公	483	95,208.96	0.30
71	600745	闻泰科技	1,100	93,621.00	0.30
72	601225	陕西煤业	4,400	93,192.00	0.30
73	601816	京沪高铁	18,500	92,870.00	0.30
74	601633	长城汽车	2,500	92,600.00	0.30
75	002202	金风科技	6,200	91,760.00	0.29
76	600029	南方航空	12,500	91,375.00	0.29
77	000963	华东医药	2,000	90,320.00	0.29
78	002129	TCL 中环	1,500	88,335.00	0.28
79	600958	东方证券	8,628	88,091.88	0.28
80	300142	沃森生物	1,800	87,102.00	0.28
81	601169	北京银行	19,100	86,714.00	0.28
82	002821	凯莱英	300	86,700.00	0.28
83	002230	科大讯飞	2,100	86,562.00	0.28
84	300759	康龙化成	900	85,698.00	0.27
85	600837	海通证券	8,700	85,347.00	0.27
86	600588	用友网络	3,910	84,886.10	0.27
87	601229	上海银行	12,800	83,840.00	0.27
88	600406	国电南瑞	3,020	81,540.00	0.26
89	600585	海螺水泥	2,300	81,144.00	0.26
90	600926	杭州银行	5,400	80,892.00	0.26
91	601919	中远海控	5,720	79,508.00	0.25
92	600196	复星医药	1,800	79,362.00	0.25
93	300782	卓胜微	576	77,760.00	0.25
94	300122	智飞生物	700	77,707.00	0.25
95	601628	中国人寿	2,500	77,700.00	0.25
96	002459	晶澳科技	980	77,322.00	0.25
97	002241	歌尔股份	2,300	77,280.00	0.25
98	600132	重庆啤酒	500	73,300.00	0.23
99	001979	招商蛇口	5,400	72,522.00	0.23
100	600031	三一重工	3,800	72,428.00	0.23
101	600522	中天科技	3,100	71,610.00	0.23
102	688396	华润微	1,210	71,474.70	0.23
103	002493	荣盛石化	4,600	70,794.00	0.23
104	601985	中国核电	10,200	69,972.00	0.22
105	600763	通策医疗	400	69,776.00	0.22
106	603501	韦尔股份	400	69,212.00	0.22
107	600383	金地集团	5,100	68,544.00	0.22
108	002074	国轩高科	1,500	68,400.00	0.22
109	601877	正泰电器	1,900	67,982.00	0.22

110	601155	新城控股	2,600	66,118.00	0.21
111	603882	金域医学	800	66,040.00	0.21
112	300496	中科创达	500	65,240.00	0.21
113	000625	长安汽车	3,744	64,846.08	0.21
114	601857	中国石油	12,200	64,660.00	0.21
115	601615	明阳智能	1,900	64,220.00	0.20
116	600176	中国巨石	3,586	62,432.26	0.20
117	600600	青岛啤酒	600	62,352.00	0.20
118	600104	上汽集团	3,500	62,335.00	0.20
119	000301	东方盛虹	3,600	60,876.00	0.19
120	600346	恒力石化	2,700	60,048.00	0.19
121	300896	爱美客	100	60,001.00	0.19
122	601727	上海电气	14,400	59,184.00	0.19
123	600570	恒生电子	1,330	57,908.20	0.18
124	601766	中国中车	11,000	57,200.00	0.18
125	601390	中国中铁	9,300	57,102.00	0.18
126	002049	紫光国微	300	56,916.00	0.18
127	300413	芒果超媒	1,700	56,712.00	0.18
128	600111	北方稀土	1,600	56,256.00	0.18
129	002709	天赐材料	900	55,854.00	0.18
130	002371	北方华创	200	55,424.00	0.18
131	600893	航发动力	1,200	54,612.00	0.17
132	603737	三棵树	420	54,360.60	0.17
133	601669	中国电建	6,900	54,303.00	0.17
134	601377	兴业证券	7,600	53,580.00	0.17
135	002555	三七互娱	2,500	53,075.00	0.17
136	601939	建设银行	8,700	52,722.00	0.17
137	601111	中国国航	4,500	52,245.00	0.17
138	601211	国泰君安	3,400	51,680.00	0.16
139	601799	星宇股份	300	51,300.00	0.16
140	300408	三环集团	1,700	51,170.00	0.16
141	000938	紫光股份	2,620	50,828.00	0.16
142	600332	白云山	1,600	50,544.00	0.16
143	603345	安井食品	300	50,361.00	0.16
144	601238	广汽集团	3,300	50,292.00	0.16
145	601916	浙商银行	15,100	50,132.00	0.16
146	000596	古井贡酒	200	49,932.00	0.16
147	600219	南山铝业	13,500	49,815.00	0.16
148	002340	格林美	5,400	49,140.00	0.16
149	601995	中金公司	1,100	48,939.00	0.16
150	603486	科沃斯	400	48,756.00	0.16
151	600050	中国联通	14,000	48,440.00	0.15

152	600010	包钢股份	20,600	48,410.00	0.15
153	002240	盛新锂能	800	48,288.00	0.15
154	000069	华侨城 A	7,400	48,026.00	0.15
155	002311	海大集团	800	48,008.00	0.15
156	600919	江苏银行	6,700	47,704.00	0.15
157	000661	长春高新	200	46,684.00	0.15
158	600089	特变电工	1,700	46,563.00	0.15
159	000100	TCL 科技	9,600	45,984.00	0.15
160	300347	泰格医药	400	45,780.00	0.15
161	300595	欧普康视	800	45,752.00	0.15
162	600115	中国东航	8,300	45,567.00	0.15
163	600015	华夏银行	8,700	45,327.00	0.14
164	601607	上海医药	2,500	45,200.00	0.14
165	300073	当升科技	500	45,170.00	0.14
166	603899	晨光股份	800	44,864.00	0.14
167	002920	德赛西威	300	44,400.00	0.14
168	300450	先导智能	700	44,226.00	0.14
169	600183	生益科技	2,600	44,174.00	0.14
170	601006	大秦铁路	6,700	44,153.00	0.14
171	688180	君实生物	586	44,149.24	0.14
172	000651	格力电器	1,300	43,836.00	0.14
173	000166	申万宏源	10,200	43,758.00	0.14
174	300390	天华超净	500	43,700.00	0.14
175	600188	兖矿能源	1,100	43,428.00	0.14
176	000977	浪潮信息	1,640	43,427.20	0.14
177	600584	长电科技	1,600	43,200.00	0.14
178	600655	豫园股份	4,400	41,536.00	0.13
179	300454	深信服	400	41,512.00	0.13
180	603456	九洲药业	800	41,360.00	0.13
181	600989	宝丰能源	2,800	41,020.00	0.13
182	601788	光大证券	2,600	40,976.00	0.13
183	601360	三六零	4,800	40,896.00	0.13
184	300769	德方纳米	100	40,868.00	0.13
185	300316	晶盛机电	600	40,554.00	0.13
186	000999	华润三九	900	40,500.00	0.13
187	601319	中国人保	8,000	40,480.00	0.13
188	002600	领益智造	8,000	40,160.00	0.13
189	601878	浙商证券	3,500	39,830.00	0.13
190	688185	康希诺	200	39,816.00	0.13
191	000157	中联重科	6,400	39,424.00	0.13
192	601100	恒立液压	636	39,253.92	0.13
193	600803	新奥股份	2,100	39,039.00	0.12

194	603444	吉比特	100	38,800.00	0.12
195	000338	潍柴动力	3,100	38,657.00	0.12
196	603290	斯达半导	100	38,590.00	0.12
197	600150	中国船舶	2,000	37,960.00	0.12
198	300999	金龙鱼	700	37,814.00	0.12
199	600109	国金证券	4,200	37,800.00	0.12
200	601881	中国银河	3,900	37,713.00	0.12
201	601901	方正证券	5,600	37,576.00	0.12
202	603986	兆易创新	264	37,543.44	0.12
203	300003	乐普医疗	2,000	37,140.00	0.12
204	688009	中国通号	8,181	37,059.93	0.12
205	002603	以岭药业	1,520	36,936.00	0.12
206	000783	长江证券	6,200	36,766.00	0.12
207	300144	宋城演艺	2,380	36,533.00	0.12
208	603392	万泰生物	235	36,495.50	0.12
209	688008	澜起科技	600	36,348.00	0.12
210	002353	杰瑞股份	900	36,270.00	0.12
211	300529	健帆生物	710	36,131.90	0.12
212	603939	益丰药房	680	35,924.40	0.11
213	300676	华大基因	500	35,850.00	0.11
214	600886	国投电力	3,400	35,700.00	0.11
215	601600	中国铝业	7,400	35,150.00	0.11
216	600499	科达制造	1,700	35,088.00	0.11
217	601868	中国能建	14,700	34,839.00	0.11
218	002268	卫 士 通	800	34,328.00	0.11
219	300628	亿联网络	450	34,267.50	0.11
220	601689	拓普集团	500	34,215.00	0.11
221	603127	昭衍新药	300	34,140.00	0.11
222	002372	伟星新材	1,400	33,656.00	0.11
223	002497	雅化集团	1,000	32,650.00	0.10
224	600233	圆通速递	1,600	32,624.00	0.10
225	603707	健友股份	1,156	32,599.20	0.10
226	300146	汤臣倍健	1,500	32,475.00	0.10
227	002001	新 和 成	1,412	32,207.72	0.10
228	600741	华域汽车	1,400	32,200.00	0.10
229	300763	锦浪科技	150	31,950.00	0.10
230	688036	传音控股	355	31,676.65	0.10
231	600795	国电电力	8,100	31,671.00	0.10
232	600256	广汇能源	3,000	31,620.00	0.10
233	300357	我武生物	600	31,218.00	0.10
234	600460	士兰微	600	31,200.00	0.10
235	600872	XD 中炬高	900	31,149.00	0.10

236	000009	中国宝安	2,300	31,027.00	0.10
237	002463	沪电股份	2,100	30,996.00	0.10
238	002624	完美世界	2,150	30,895.50	0.10
239	000728	国元证券	4,960	30,851.20	0.10
240	002192	融捷股份	200	30,740.00	0.10
241	600521	华海药业	1,350	30,645.00	0.10
242	600170	上海建工	10,100	30,603.00	0.10
243	000876	新 希 望	2,000	30,600.00	0.10
243	603369	今世缘	600	30,600.00	0.10
244	601865	福莱特	800	30,480.00	0.10
245	002756	永兴材料	200	30,442.00	0.10
246	002180	纳思达	600	30,372.00	0.10
247	600547	山东黄金	1,620	30,067.20	0.10
248	600845	宝信软件	550	30,030.00	0.10
249	600884	杉杉股份	1,000	29,720.00	0.09
250	601077	渝农商行	8,000	29,600.00	0.09
251	300751	迈为股份	60	29,454.00	0.09
252	600801	华新水泥	1,500	29,265.00	0.09
253	600298	安琪酵母	600	29,250.00	0.09
254	601336	新华保险	900	28,971.00	0.09
255	002648	卫星化学	1,119	28,926.15	0.09
256	600011	华能国际	4,100	28,864.00	0.09
257	600848	上海临港	2,120	28,747.20	0.09
258	002557	洽洽食品	500	28,465.00	0.09
259	688363	华熙生物	200	28,436.00	0.09
260	601618	中国中冶	8,100	28,350.00	0.09
261	600426	华鲁恒升	970	28,324.00	0.09
262	002032	苏 泊 尔	500	28,170.00	0.09
263	002294	信立泰	1,000	28,100.00	0.09
264	605117	德业股份	100	27,989.00	0.09
265	000027	深圳能源	4,340	27,819.40	0.09
266	688012	中微公司	238	27,786.50	0.09
267	002736	国信证券	2,900	27,753.00	0.09
268	000786	北新建材	800	27,696.00	0.09
269	600143	金发科技	2,900	27,608.00	0.09
270	000733	振华科技	200	27,194.00	0.09
271	002938	鹏鼎控股	900	27,189.00	0.09
272	600380	健康元	2,200	27,170.00	0.09
273	603833	欧派家居	180	27,122.40	0.09
274	601456	国联证券	2,200	26,994.00	0.09
275	000987	越秀金控	3,780	26,573.40	0.08
276	601838	成都银行	1,600	26,528.00	0.08

277	600688	上海石化	8,300	26,394.00	0.08
278	002531	天顺风能	1,600	26,384.00	0.08
279	601117	中国化学	2,800	26,348.00	0.08
280	002326	永太科技	800	26,344.00	0.08
281	688005	容百科技	203	26,276.32	0.08
282	002673	西部证券	4,000	26,160.00	0.08
283	002153	石基信息	1,624	25,772.88	0.08
284	000513	丽珠集团	700	25,347.00	0.08
285	300207	欣旺达	800	25,280.00	0.08
286	000983	山西焦煤	1,880	25,173.20	0.08
287	600754	锦江酒店	400	25,160.00	0.08
288	000960	锡业股份	1,500	25,155.00	0.08
289	300919	中伟股份	200	24,780.00	0.08
290	002044	美年健康	4,400	24,508.00	0.08
291	600018	上港集团	4,200	24,486.00	0.08
292	002916	深南电路	260	24,364.60	0.08
293	002797	第一创业	3,800	24,358.00	0.08
294	300433	蓝思科技	2,200	24,354.00	0.08
295	603260	合盛硅业	200	23,592.00	0.08
296	000723	美锦能源	1,900	23,180.00	0.07
297	600039	四川路桥	2,200	23,166.00	0.07
298	002236	大华股份	1,400	22,988.00	0.07
299	603218	日月股份	900	22,860.00	0.07
300	688126	沪硅产业	994	22,842.12	0.07
301	300661	圣邦股份	125	22,752.50	0.07
302	000739	普洛药业	1,100	22,704.00	0.07
303	600009	上海机场	400	22,680.00	0.07
304	002841	视源股份	300	22,596.00	0.07
305	000591	太阳能	2,700	22,545.00	0.07
306	002013	中航机电	1,800	22,230.00	0.07
307	000423	东阿阿胶	600	22,170.00	0.07
308	603816	顾家家居	390	22,085.70	0.07
309	002601	龙佰集团	1,100	22,055.00	0.07
310	002080	中材科技	800	22,000.00	0.07
311	600141	兴发集团	500	21,995.00	0.07
312	603185	上机数控	140	21,838.60	0.07
313	002120	韵达股份	1,280	21,836.80	0.07
314	300601	康泰生物	480	21,686.40	0.07
315	002508	老板电器	600	21,618.00	0.07
316	601016	节能风电	4,500	21,600.00	0.07
317	600362	江西铜业	1,200	21,396.00	0.07
318	600875	东方电气	1,300	21,385.00	0.07

319	000703	恒逸石化	2,030	21,335.30	0.07
320	300223	北京君正	200	21,250.00	0.07
321	002958	青农商行	6,300	20,916.00	0.07
322	300383	光环新网	2,000	20,840.00	0.07
323	601992	金隅集团	7,500	20,775.00	0.07
324	600026	中远海能	2,000	20,660.00	0.07
325	600563	法拉电子	100	20,516.00	0.07
326	601699	潞安环能	1,400	20,468.00	0.07
327	600674	川投能源	1,700	20,264.00	0.06
328	605358	立昂微	300	20,214.00	0.06
329	688099	晶晨股份	200	20,200.00	0.06
330	002176	江特电机	800	20,032.00	0.06
331	603568	伟明环保	600	20,022.00	0.06
332	600918	中泰证券	2,600	19,890.00	0.06
333	603198	迎驾贡酒	300	19,542.00	0.06
334	600711	盛屯矿业	2,500	19,400.00	0.06
335	688122	西部超导	210	19,362.00	0.06
336	300033	同花顺	200	19,230.00	0.06
337	002414	高德红外	1,483	19,086.21	0.06
338	300037	新宙邦	360	18,921.60	0.06
339	000425	徐工机械	3,500	18,865.00	0.06
340	002926	华西证券	2,400	18,816.00	0.06
341	000860	顺鑫农业	700	18,774.00	0.06
342	000799	酒鬼酒	100	18,581.00	0.06
343	002064	华峰化学	2,200	18,568.00	0.06
344	601216	君正集团	3,800	18,544.00	0.06
345	600779	水井坊	200	18,508.00	0.06
346	002384	东山精密	800	18,344.00	0.06
347	002007	华兰生物	800	18,240.00	0.06
348	600392	盛和资源	800	18,080.00	0.06
349	002010	传化智联	2,800	18,004.00	0.06
350	600704	物产中大	3,500	17,955.00	0.06
351	300724	捷佳伟创	200	17,870.00	0.06
352	000683	远兴能源	1,700	17,867.00	0.06
353	002092	中泰化学	2,300	17,848.00	0.06
354	002252	上海莱士	3,000	17,790.00	0.06
355	601966	玲珑轮胎	700	17,759.00	0.06
356	603589	口子窖	300	17,583.00	0.06
357	600885	宏发股份	420	17,577.00	0.06
358	000519	中兵红箭	600	17,490.00	0.06
359	601233	桐昆股份	1,100	17,468.00	0.06
360	603517	绝味食品	300	17,346.00	0.06

361	601696	中银证券	1,300	17,290.00	0.06
362	002625	光启技术	1,000	17,270.00	0.06
363	603077	和邦生物	4,000	17,040.00	0.05
364	600153	建发股份	1,300	16,991.00	0.05
365	601108	财通证券	2,150	16,920.50	0.05
366	000738	航发控制	600	16,860.00	0.05
367	603613	国联股份	190	16,834.00	0.05
368	300253	卫宁健康	1,910	16,769.80	0.05
369	002405	四维图新	1,100	16,577.00	0.05
370	002602	世纪华通	3,400	16,388.00	0.05
371	000066	中国长城	1,500	16,230.00	0.05
372	603338	浙江鼎力	320	16,224.00	0.05
373	600161	天坛生物	660	16,024.80	0.05
374	600487	亨通光电	1,100	15,994.00	0.05
375	688187	时代电气	246	15,987.54	0.05
376	002850	科达利	100	15,900.00	0.05
377	000807	云铝股份	1,600	15,808.00	0.05
378	600160	巨化股份	1,200	15,780.00	0.05
379	000932	华菱钢铁	3,100	15,779.00	0.05
380	601058	赛轮轮胎	1,400	15,778.00	0.05
381	000630	铜陵有色	4,800	15,648.00	0.05
382	000830	鲁西化工	900	15,561.00	0.05
383	601555	东吴证券	2,240	15,523.20	0.05
384	000155	川能动力	700	15,505.00	0.05
385	601636	旗滨集团	1,200	15,300.00	0.05
386	002385	大北农	1,900	14,839.00	0.05
387	000629	攀钢钒钛	3,900	14,820.00	0.05
388	002078	太阳纸业	1,200	14,772.00	0.05
389	002407	多氟多	300	14,673.00	0.05
390	600027	华电国际	3,700	14,541.00	0.05
391	300568	星源材质	500	14,520.00	0.05
392	601577	长沙银行	1,800	14,274.00	0.05
393	603233	大参林	456	14,272.80	0.05
394	300677	英科医疗	560	14,201.60	0.05
395	601990	南京证券	1,700	14,178.00	0.05
396	000825	太钢不锈	2,600	14,170.00	0.05
397	600415	小商品城	2,500	13,925.00	0.04
398	600177	雅戈尔	2,100	13,923.00	0.04
399	600705	中航产融	4,000	13,840.00	0.04
400	002507	涪陵榨菜	400	13,808.00	0.04
401	000656	金科股份	4,800	13,728.00	0.04
402	600038	中直股份	300	13,560.00	0.04

403	300832	新产业	300	13,533.00	0.04
404	601866	中远海发	4,500	13,500.00	0.04
405	002568	百润股份	448	13,457.92	0.04
406	603267	鸿远电子	100	13,433.00	0.04
407	601198	东兴证券	1,500	13,350.00	0.04
408	600486	扬农化工	100	13,328.00	0.04
409	600516	方大炭素	1,740	13,224.00	0.04
410	002185	华天科技	1,400	13,132.00	0.04
411	000800	一汽解放	1,400	13,076.00	0.04
412	601168	西部矿业	1,100	13,013.00	0.04
413	002152	广电运通	1,400	12,978.00	0.04
414	002791	坚朗五金	100	12,972.00	0.04
414	600549	厦门钨业	600	12,972.00	0.04
415	002223	鱼跃医疗	500	12,830.00	0.04
416	600988	赤峰黄金	800	12,760.00	0.04
417	002430	杭氧股份	400	12,504.00	0.04
418	000831	五矿稀土	400	12,500.00	0.04
419	600583	海油工程	3,000	12,450.00	0.04
420	300308	中际旭创	400	12,420.00	0.04
421	300251	光线传媒	1,300	12,311.00	0.04
422	300726	宏达电子	200	12,234.00	0.04
423	002939	长城证券	1,200	12,192.00	0.04
424	300558	贝达药业	200	12,160.00	0.04
425	002456	欧菲光	1,800	12,078.00	0.04
426	002541	鸿路钢构	360	12,024.00	0.04
427	600369	西南证券	3,000	11,910.00	0.04
428	000975	银泰黄金	1,220	11,882.80	0.04
429	002925	盈趣科技	550	11,836.00	0.04
430	600598	北大荒	800	11,808.00	0.04
431	300699	光威复材	200	11,774.00	0.04
432	002532	天山铝业	1,800	11,754.00	0.04
433	601598	中国外运	3,000	11,640.00	0.04
434	000988	华工科技	500	11,585.00	0.04
435	002299	圣农发展	600	11,508.00	0.04
436	002266	浙富控股	2,400	11,496.00	0.04
437	600338	西藏珠峰	400	11,480.00	0.04
438	002422	科伦药业	600	11,220.00	0.04
439	600079	人福医药	700	11,200.00	0.04
440	002409	雅克科技	200	11,102.00	0.04
441	000050	深天马 A	1,100	10,967.00	0.03
442	002138	顺络电子	400	10,900.00	0.03
443	000709	河钢股份	4,800	10,848.00	0.03

444	002028	思源电气	300	10,698.00	0.03
445	002408	齐翔腾达	1,300	10,543.00	0.03
446	002030	达安基因	600	10,314.00	0.03
447	002558	巨人网络	1,100	10,065.00	0.03
448	000998	隆平高科	600	9,996.00	0.03
449	603858	步长制药	500	9,855.00	0.03
450	002506	协鑫集成	2,600	9,672.00	0.03
451	002145	中核钛白	1,350	9,625.50	0.03
452	600998	九州通	800	9,528.00	0.03
453	603712	七一二	300	9,450.00	0.03
454	600699	均胜电子	600	9,426.00	0.03
455	603866	桃李面包	568	9,400.40	0.03
456	688002	睿创微纳	236	9,373.92	0.03
457	002500	山西证券	1,620	9,298.80	0.03
458	002156	通富微电	600	9,240.00	0.03
459	002465	海格通信	1,000	9,090.00	0.03
460	000750	国海证券	2,500	9,075.00	0.03
461	300850	新强联	100	8,903.00	0.03
462	002065	东华软件	1,400	8,848.00	0.03
463	600895	张江高科	700	8,715.00	0.03
464	002157	正邦科技	1,400	8,484.00	0.03
465	300070	碧水源	1,600	8,336.00	0.03
466	300418	昆仑万维	500	8,000.00	0.03
467	000686	东北证券	1,100	7,689.00	0.02
468	600498	烽火通信	500	7,240.00	0.02
469	002563	森马服饰	1,200	7,104.00	0.02
470	603605	珀莱雅	40	6,607.20	0.02
471	688006	杭可科技	87	6,095.22	0.02

7.3.2 期末积极投资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	601089	福元医药	682	14,356.10	0.05

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	600900	长江电力	439,090.00	1.11
2	600036	招商银行	406,486.00	1.03
3	600519	贵州茅台	380,486.00	0.96
4	300750	宁德时代	250,380.00	0.63

5	002352	顺丰控股	209,099.00	0.53
6	603259	药明康德	178,653.00	0.45
7	601012	隆基绿能	175,431.00	0.44
8	002812	恩捷股份	172,297.00	0.43
9	600905	三峡能源	164,754.00	0.42
10	300760	迈瑞医疗	158,808.00	0.40
11	002594	比亚迪	153,643.00	0.39
12	601166	兴业银行	151,902.00	0.38
13	601318	中国平安	143,198.00	0.36
14	688599	天合光能	130,816.81	0.33
15	601398	工商银行	126,660.00	0.32
16	601888	中国中免	118,471.00	0.30
17	002475	立讯精密	116,580.00	0.29
18	600028	中国石化	115,272.00	0.29
19	000858	五 粮 液	111,621.00	0.28
20	600030	中信证券	106,864.70	0.27

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	600036	招商银行	589,292.00	1.49
2	600519	贵州茅台	554,748.00	1.40
3	300750	宁德时代	372,969.00	0.94
4	603259	药明康德	290,421.80	0.73
5	002594	比亚迪	284,303.00	0.72
6	601012	隆基绿能	278,478.00	0.70
7	300760	迈瑞医疗	248,039.00	0.63
8	601166	兴业银行	240,729.00	0.61
9	601318	中国平安	215,028.00	0.54
10	601398	工商银行	211,877.00	0.53
11	002304	洋河股份	195,317.00	0.49
12	601888	中国中免	178,120.00	0.45
13	000001	平安银行	167,566.00	0.42
14	000858	五 粮 液	162,649.00	0.41
15	002475	立讯精密	150,884.00	0.38
16	600030	中信证券	136,511.00	0.34
17	600900	长江电力	134,242.00	0.34
18	002142	宁波银行	134,062.00	0.34
19	600000	浦发银行	133,527.00	0.34
20	300274	阳光电源	129,565.00	0.33

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	12,813,169.53
卖出股票收入（成交）总额	15,677,207.23

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

ESG 基金(LOF)基金截至 2022 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的招商银行(600036)的发行人招商银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；二、漏报贷款核销业务 EAST 数据；三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；四、未报送权益类投资业务 EAST 数据；五、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；六、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；七、漏报委托贷款业务 EAST 数据；八、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十一、漏报分户账 EAST 数据；十二、EAST 系统《个人活期

存款分户账明细记录》表错报；十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报。于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 300 万元的行政处罚决定。

ESG 基金(LOF)基金截至 2022 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的兴业银行(601166)的发行人兴业银行股份有限公司因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，于 2021 年 8 月 13 日收到中国人民银行处罚款 5 万元的行政处罚措施。

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八名证券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

-

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	6,709.27
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	23,224.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,933.85

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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 MSCI ESG 指数	4,610	4,789.00	9,999,450.00	45.29	12,077,836.22	54.71
华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C	184	2,185.67	-	-	402,162.88	100.00
合计	4,794	4,689.08	9,999,450.00	44.48	12,479,999.10	55.52

8.2 期末上市基金前十名持有人

华宝 MSCI ESG 指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	王德娥	481,200.00	30.82
2	郑宏	339,377.00	21.74
3	黄铄婷	169,755.00	10.87
4	蒙以贤	62,349.00	3.99
5	赵鑫	51,215.00	3.28
6	郑崇	39,024.00	2.50
7	罗兰琦	38,603.00	2.47
8	单凤双	35,556.00	2.28
9	钱中明	34,600.00	2.22
10	杨哲尧	30,000.00	1.92

8.3 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 MSCI ESG 指数	1,650.79	0.0075
	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C	0.00	0.0000
	合计	1,650.79	0.0073

8.4 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 MSCI ESG 指数	0
	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝 MSCI ESG 指数	0
	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝 MSCI ESG 指数	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C
基金合同生效日（2019 年 8 月 21 日）基金份额总额	316,856,306.97	-
本报告期期初基金份额总额	25,979,620.20	83,947.59
本报告期基金总申购份额	10,908,228.87	2,161,844.79
减：本报告期基金总赎回份额	14,810,562.85	1,843,629.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	22,077,286.22	402,162.88

§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

2022 年 4 月 18 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，XIAOYI HELEN HUANG（黄小蕙）不再担任公司总经理，公司副总经理向辉代为履行总经理职责。

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

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：2019 年 11 月 20 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

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无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(%)	

广发证券	2	18,621,548.61	65.70	17,289.75	65.98	-
东方证券	1	4,503,890.10	15.89	4,112.62	15.69	-
南京证券	1	2,090,646.30	7.38	1,926.20	7.35	-
野村东方国际证券	2	1,135,571.41	4.01	1,039.73	3.97	-
东方财富	2	898,056.00	3.17	836.44	3.19	-
星展证券	2	428,962.00	1.51	390.93	1.49	-
招商证券	2	375,311.88	1.32	345.79	1.32	-
天风证券	2	242,150.00	0.85	223.10	0.85	-
华创证券	1	45,289.86	0.16	41.74	0.16	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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、本基金本报告期新增交易单元：华金证券；退租交易单元：中泰证券。

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(%)
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
星展证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）2021 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2022-01-24
2	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）2021 年年度报告	基金管理人网站	2022-03-31
3	华宝基金关于旗下部分基金增加招商银行招赢通为销售平台并参加招商银行招赢通平台费率优惠活动的公告	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	2022-04-20
4	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）2022 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2022-04-22

5	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海攀赢基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	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	2022-05-24
6	华宝基金关于旗下部分基金新增中国人寿为代销机构的公告	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	2022-06-15

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20220101~20220630	9,999,450.00	0.00	0.00	9,999,450.00	44.48
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。 在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本公司于 2022 年 5 月完成工商变更登记，公司变更后的股东信息为：华宝信托有限责任公司（持股 51%）、Warburg Pincus Asset Management, L.P. （“华平投资”，持股 29%）、江苏省铁路集团有限公司（持股 20%）。

§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 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）基金合同；

华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）招募说明书；

华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）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

2022 年 8 月 31 日