

华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证 券投资基金（LOF） 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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：2023 年 3 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 2023 年 03 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已经审计，安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	26
§ 8 投资组合报告	53

8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
8.3 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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
8.6 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	68
8.7 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	68
8.8 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	68
8.9 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	68
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	69
§ 9 基金份额持有人信息	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2 期末上市基金前十名持有人	70
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
9.4 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	71
§ 10 开放式基金份额变动	71
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
11.2 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	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.8 其他重大事件	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1 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	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 13 备查文件目录	75
13.1 备查文件目录	75
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 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	36,514,348.04 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	32,842,313.78 份	3,672,034.26 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		黄孔威	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2022 年	2021 年	2021 年 7 月 9 日(基金合同生效)	2020 年
---------------	--------	--------	------------------------	--------

					日)-2021 年 12 月 31 日	
	华宝 MSCI ESG 指数	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数 (LOF) C	华宝 MSCI ESG 指数	华宝 MSCI 中 国 A 股国际 通 ESG 指数 (LOF) C	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	-2,590,403.03	-163,255.93	5,130,410.03	11,044.17	11,376,655.67	-
本期利润	-8,568,816.56	120,289.78	1,173,296.19	6,970.99	12,727,218.88	-
加权平均基金份额本期利润	-0.2923	0.0758	0.0443	0.0385	0.3250	-
本期加权平均净值利润率	-22.56%	6.15%	2.93%	2.56%	27.70%	-
本期基金份额净值增长率	-18.42%	-18.58%	2.70%	-0.54%	37.57%	-
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	7,878,638.30	868,889.85	13,357,923.26	43,067.99	7,237,323.05	-
期末可供分配基金份额利润	0.2399	0.2366	0.5142	0.5130	0.3161	-
期末基金资产净值	40,720,952.08	4,540,924.11	39,483,078.43	127,489.33	33,877,331.62	-
期末基金份额净值	1.2399	1.2366	1.5198	1.5187	1.4798	-
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	23.99%	-19.02%	51.98%	-0.54%	47.98%	-

- 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
过去三个月	2.39%	1.14%	2.99%	0.76%	-0.60%	0.38%
过去六个月	-11.07%	0.99%	-11.37%	0.82%	0.30%	0.17%
过去一年	-18.42%	1.19%	-19.53%	1.12%	1.11%	0.07%
过去三年	15.26%	1.21%	2.36%	1.19%	12.90%	0.02%
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同生效 起至今	23.99%	1.16%	10.45%	1.15%	13.54%	0.01%

华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数 (LOF) C

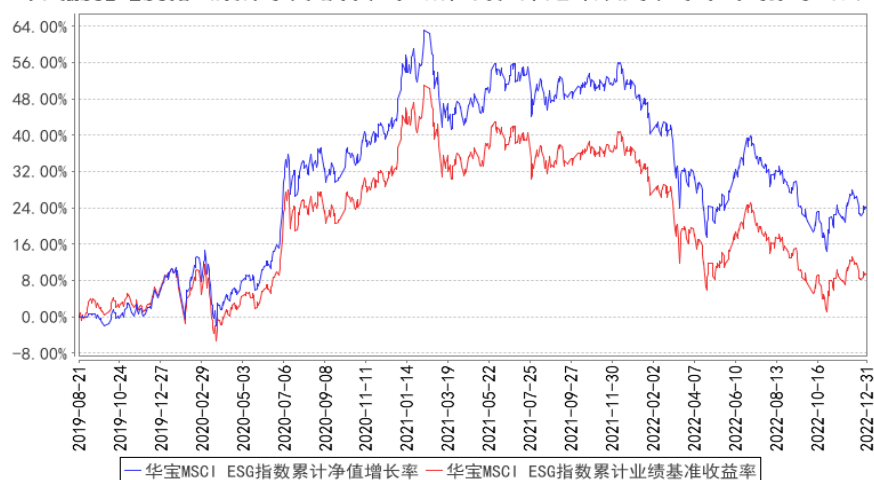
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.33%	1.14%	2.99%	0.76%	-0.66%	0.38%
过去六个月	-11.16%	0.99%	-11.37%	0.82%	0.21%	0.17%
过去一年	-18.58%	1.19%	-19.53%	1.12%	0.95%	0.07%
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同生效 起至今	-19.02%	1.11%	-20.49%	1.07%	1.47%	0.04%

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

华宝 MSCI ESG 指数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 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数 (LOF) C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2020 年 02 月 21 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金成立未满五年，基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

§ 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 12 月 31 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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 133 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	-	17 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	本基金经理	2021-03-08	-	12 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，2022 年 12 月起任华宝中证绿色能源交易型开放式指数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》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 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，

由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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，全球经济环境复杂严峻，需求收缩，供给冲击贯穿全年，叠加俄乌冲突、美联储加息等事件的影响，对全球金融市场带来较大扰动。面对多变的宏观环境，国内采取了“稳增长”措施积极应对，加大了宏观调控力度，多措施对经济保驾护航，全年维持了弱复苏的态势。随着下半年二十大的胜利召开，地产相关政策的推出，各项经济政策逐步发力，稳定了市场信心。市场方面，2022 年 A 股市场全年呈现出整体下行趋势下的结构性行情。煤炭、消费者服务、交通运输等板块表现亮眼，而电子、计算机、传媒等板块表现较弱。风格上价值股全年走势较于成长股而言相对稳健，小盘股走势总体强于大盘股。指数方面，市场上大部分基准指数呈现普跌态势。本报告期内，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 22.07% 和 21.63%；而作为成长股代表的中证 500 指数和中证 1000 指数分别下跌了 20.31% 和 21.58%。在本报告期内，MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数累计下跌了 21.26%。

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 类净值增长率为-18.42%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为-18.58%；同期业绩比较基准收益率为-19.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，展望 2023 年，全球经济与中国经济或将存在错位。由于通胀问题还未系统性解决，全球大部分央行的利率仍将维持高位。跟随经济周期的节奏，以及资金成本的影响，全球经济大概率逐步下滑，步入“衰退”阶段。相反，随着国内居民消费逐步走向复苏，中国整体经济回升动力明显。此外，中国的流动性仍将维持“合理充裕”，保证实体经济的合理融资需求。随着资本市场基础制度体系进一步完善，A 股逐步走向成熟，叠加居民资产配置的结构化变化以及国际资金的配置，进一步提升了 A 股市场的相对吸引力。2023 年或将存在结构性向上行情，同时也要密切关注国内外不确定因素对资本市场的潜在扰动。

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。二十大报告明确提出，中国式现代化是人与自然和谐共生的现代化，并专章论述推动绿色发展，促进人与自然和谐共生，专门部署积极稳妥推进“碳达峰碳

中和”。ESG 投资是资本市场实现“碳达峰碳中和”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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求 and 业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）有重点地全面开展内部审计稽核工作。2022 年，合规审计部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计、依据各项监管规定对公司相关内部流程进行了评估、根据监管要求开展了涉及投研、运营、销售等方面的专项自查；并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业

务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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、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。

4.8 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。

4.9 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合规守信、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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 年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2023）审字第 61471289_B32 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不

	对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）不能持续经营。

	(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	许培菁	张亚旒
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2023 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	3,137,703.46	3,516,257.14
结算备付金		74,031.02	1,706.74
存出保证金		6,906.92	4,553.15
交易性金融资产	7.4.7.2	42,731,634.57	37,362,005.07
其中：股票投资		42,731,634.57	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	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
债权投资	7.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	7.4.7.6	—	—
其他权益工具投资	7.4.7.7	—	—
应收清算款		—	48,411.89
应收股利		—	—
应收申购款		4,054.94	6,699.53
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.8	—	446.48
资产总计		45,954,330.91	40,940,080.00

负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	40.98
应付赎回款		42,513.27	827,761.29
应付管理人报酬		20,580.80	20,749.39
应付托管费		4,116.16	4,149.86
应付销售服务费		963.09	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	7.4.7.9	624,281.40	476,778.70
负债合计		692,454.72	1,329,512.24
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	36,514,348.04	26,063,567.79
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	8,747,528.15	13,546,999.97
净资产合计		45,261,876.19	39,610,567.76
负债和净资产总计		45,954,330.91	40,940,080.00

注：1. 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 36,514,348.04 份，其中华宝 MSCI ESG 指数 A 基金份额总额 32,842,313.78 份，基金份额净值 1.2399 元；华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C 基金份额总额 3,672,034.26 份，基金份额净值 1.2366 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 年年度报告资产负债表中“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 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
-----	-----	---	--

一、营业总收入		-7,989,086.13	1,742,415.54
1. 利息收入		13,953.13	10,796.11
其中：存款利息收入	7.4.7.13	13,953.13	10,796.11
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）		-2,485,638.61	5,662,093.02
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-3,163,722.39	5,054,215.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	678,083.78	607,877.06
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）	7.4.7.20	-5,694,867.82	-3,961,187.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	177,467.17	30,713.43
减：二、营业总支出		459,440.65	562,148.36
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	200,243.57	201,027.90
2. 托管费	7.4.10.2.2	40,048.68	40,205.55
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	4,120.38	269.25
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	215,028.02	320,645.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,448,526.78	1,180,267.18
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,448,526.78	1,180,267.18
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,448,526.78	1,180,267.18

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 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	10,450,780.25	-	-4,799,471.82	5,651,308.43
（一）、综合收益总额	-	-	-8,448,526.78	-8,448,526.78

(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)	10,450,780.25	-	3,649,054.96	14,099,835.21
其中:1. 基金申购款	45,014,479.60	-	12,715,283.15	57,729,762.75
2. 基金赎回款	-34,563,699.35	-	-9,066,228.19	-43,629,927.54
(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)	36,514,348.04	-	8,747,528.15	45,261,876.19
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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、本期末期初净资产(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)	3,171,013.87	-	2,562,222.27	5,733,236.14
(一)、综合收益总额	-	-	1,180,267.18	1,180,267.18
(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)	3,171,013.87	-	1,381,955.09	4,552,968.96
其中:1.基金申购款	24,665,125.06	-	12,480,615.48	37,145,740.54
2.基金赎回款	-21,494,111.19	-	-11,098,660.39	-32,592,771.58
(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)	26,063,567.79	-	13,546,999.97	39,610,567.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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 $\times$ 95%+人民币银行活期存款利率（税后） $\times$ 5% 本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2023 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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 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>》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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足

证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 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）转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；（8）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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配；（2）若《基金合同》生效不满 3 个月，可不进行收益分配；（3）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的 A 类基金份额以及登记在基金管理人注册登记系统下的 C 类基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人上海证券账户下的 A 类基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；（4）本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，但由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号）。

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。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债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和金融负债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，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币

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，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 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，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 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，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

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和金融负债项目无影响。

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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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，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发展费附加的单位外）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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	3,137,703.46	3,516,257.14
等于：本金	3,137,357.61	3,516,257.14
加：应计利息	345.85	-

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	3,137,703.46	3,516,257.14

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		44,738,988.65	-	42,731,634.57	-2,007,354.08
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		0.00	-	0.00	0.00
合计		44,738,988.65	-	42,731,634.57	-2,007,354.08
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		33,674,491.33	-	37,362,005.07	3,687,513.74
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		33,674,491.33	-	37,362,005.07	3,687,513.74

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	446.48
其他应收款	-	-

待摊费用	-	-
合计	-	446.48

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	139.98	3,075.64
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	245,712.92	222,788.56
其中：交易所市场	245,712.92	222,788.56
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	85,200.00	85,200.00
应付指数使用费	293,228.50	165,714.50
合计	624,281.40	476,778.70

7.4.7.10 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 12 月 31 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	30,793,583.35	30,793,583.35
本期赎回（以“-”号填列）	-23,930,889.77	-23,930,889.77
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	32,842,313.78	32,842,313.78

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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	83,947.59	83,947.59
本期申购	14,220,896.25	14,220,896.25
本期赎回（以“-”号填列）	-10,632,809.58	-10,632,809.58
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	3,672,034.26	3,672,034.26

7.4.7.11 其他综合收益

无

7.4.7.12 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	-2,590,403.03	-5,978,413.53	-8,568,816.56
本期基金份额交易产生的变动数	3,198,026.74	-254,030.11	2,943,996.63
其中：基金申购款	14,577,651.94	-5,356,855.40	9,220,796.54
基金赎回款	-11,379,625.20	5,102,825.29	-6,276,799.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,965,546.97	-6,086,908.67	7,878,638.30

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	-163,255.93	283,545.71	120,289.78
本期基金份额交易产生的变动数	1,668,881.28	-963,822.95	705,058.33
其中：基金申购款	6,424,068.80	-2,929,582.19	3,494,486.61
基金赎回款	-4,755,187.52	1,965,759.24	-2,789,428.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,548,693.34	-679,803.49	868,889.85

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	11,737.10	10,046.79
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	642.40	357.48
其他	1,573.63	391.84
合计	13,953.13	10,796.11

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

无

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	38,629,735.26	32,759,088.15
减：卖出股票成本总额	41,663,132.29	27,704,872.19
减：交易费用	130,325.36	—
买卖股票差价收入	-3,163,722.39	5,054,215.96

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	678,083.78	607,877.06
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	678,083.78	607,877.06

7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-5,694,867.82	-3,961,187.02
股票投资	-5,694,867.82	-3,961,187.02
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	-5,694,867.82	-3,961,187.02

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021
----	-----------------------------------	---------------------------------

	31 日	年 12 月 31 日
基金赎回费收入	177,467.17	30,713.43
合计	177,467.17	30,713.43

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。

7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	35,200.00	35,200.00
信息披露费	50,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	2,314.02	2,340.40
指数使用费	127,514.00	130,498.00
交易费用	-	102,607.26
合计	215,028.02	320,645.66

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
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：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据华宝基金股东会第十一次会议决议，并经中国证监会证监许可[2022]888 号《关于核准华宝基金管理有限公司变更股权的批复》核准，华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）将其持有的华宝基金 20%股权转让给江苏省铁路集团有限公司，并于 2022 年 5 月 24 日完成了工商变更登记手续。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	829,351.60	0.91	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

无

7.4.10.1.3 债券回购交易

无

7.4.10.1.4 权证交易

无

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例（%）
华宝证券	764.13	0.91	764.13	0.31
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例（%）
-	-	-	-	-

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

务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	200,243.57	201,027.90
其中：支付销售机构的客户维护费	43,133.40	40,109.20

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：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	40,048.68	40,205.55

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：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.3 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 12 月 31 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	-	2,442.04	2,442.04
合计	-	2,442.04	2,442.04

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 12 月 31 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	-	0.26	0.26
合计	-	0.26	0.26

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

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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 12 月 31 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	30.45	9,999,450.00	38.49

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	3,137,703.46	11,737.10	3,516,257.14	10,046.79

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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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）112,600 股，期末公允价值为人民币 488,684.00 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%）

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600038	中直股份	2022 年 12 月 26 日	重大事项停牌	46.41	2023 年 1 月 10 日	51.05	400	20,549.46	18,564.00	-
300850	新强联	2022 年 12 月 30 日	重大事项停牌	53.28	2023 年 1 月 10 日	56.88	200	17,054.00	10,656.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、存出保证金和应收申购款。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	3,137,703.46	-	-	-	3,137,703.46
结算备付金	74,031.02	-	-	-	74,031.02
存出保证金	6,906.92	-	-	-	6,906.92
交易性金融资产	-	-	-	42,731,634.57	42,731,634.57
应收申购款	1.00	-	-	4,053.94	4,054.94
资产总计	3,218,642.40	-	-	42,735,688.51	45,954,330.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	42,513.27	42,513.27
应付管理人报酬	-	-	-	20,580.80	20,580.80
应付托管费	-	-	-	4,116.16	4,116.16
应付销售服务费	-	-	-	963.09	963.09
其他负债	-	-	-	624,281.40	624,281.40
负债总计	-	-	-	692,454.72	692,454.72
利率敏感度缺口	3,218,642.40	-	-	42,043,233.79	45,261,876.19
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	42,731,634.57	94.41	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	42,731,634.57	94.41	37,362,005.07	94.32

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	2,225,834.74	1,957,620.17
	2. 业绩比较基准下降 5%	-2,225,834.74	-1,957,620.17

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	42,702,414.57	37,358,335.41
第二层次	29,220.00	3,669.66

第三层次	-	-
合计	42,731,634.57	37,362,005.07

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无

7.4.14.3 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)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

除上述事项外，截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2023 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	42,731,634.57	92.99

	其中：股票	42,731,634.57	92.99
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	3,211,734.48	6.99
8	其他各项资产	10,961.86	0.02
9	合计	45,954,330.91	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	515,498.30	1.14
B	采矿业	1,343,393.00	2.97
C	制造业	22,750,018.04	50.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,359,210.40	3.00
E	建筑业	529,174.90	1.17
F	批发和零售业	468,311.80	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,370,754.20	3.03
H	住宿和餐饮业	60,685.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,506,258.67	3.33
J	金融业	9,528,835.52	21.05
K	房地产业	868,154.40	1.92
L	租赁和商务服务业	914,817.00	2.02
M	科学研究和技术服务业	839,061.20	1.85
N	水利、环境和公共设施管理业	49,021.40	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	393,267.50	0.87
R	文化、体育和娱乐业	126,688.00	0.28

S	综合	63,851.00	0.14
	合计	42,687,000.33	94.31

8.2.2 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	44,634.24	0.10
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	44,634.24	0.10

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	1,100	1,899,700.00	4.20
2	300750	宁德时代	4,400	1,731,048.00	3.82
3	600036	招商银行	36,900	1,374,894.00	3.04
4	601888	中国中免	3,500	756,105.00	1.67

5	300760	迈瑞医疗	2,200	695,134.00	1.54
6	600900	长江电力	32,600	684,600.00	1.51
7	002594	比亚迪	2,600	668,122.00	1.48
8	603259	药明康德	7,384	598,104.00	1.32
9	601012	隆基绿能	13,540	572,200.40	1.26
10	601318	中国平安	11,621	546,187.00	1.21
11	601166	兴业银行	29,800	524,182.00	1.16
12	002352	顺丰控股	8,800	508,288.00	1.12
13	000858	五粮液	2,800	505,932.00	1.12
14	601398	工商银行	112,600	488,684.00	1.08
15	000001	平安银行	34,700	456,652.00	1.01
16	600276	恒瑞医药	11,372	438,163.16	0.97
17	002475	立讯精密	12,680	402,590.00	0.89
18	002142	宁波银行	11,850	384,532.50	0.85
19	600887	伊利股份	11,500	356,500.00	0.79
20	601288	农业银行	121,900	354,729.00	0.78
21	600030	中信证券	17,490	348,225.90	0.77
22	601328	交通银行	70,300	333,222.00	0.74
23	601088	中国神华	11,800	325,916.00	0.72
24	600000	浦发银行	42,000	305,760.00	0.68
25	600690	海尔智家	11,300	276,398.00	0.61
26	300124	汇川技术	3,800	264,100.00	0.58
27	600048	保利发展	17,100	258,723.00	0.57
28	600809	山西汾酒	900	256,491.00	0.57
29	000002	万科 A	13,900	252,980.00	0.56
30	000568	泸州老窖	1,100	246,708.00	0.55
31	601601	中国太保	9,800	240,296.00	0.53
32	601919	中远海控	22,820	234,817.80	0.52
33	600905	三峡能源	41,000	231,650.00	0.51
34	002714	牧原股份	4,738	230,977.50	0.51
35	300498	温氏股份	11,760	230,848.80	0.51
36	600019	宝钢股份	39,900	223,041.00	0.49
37	002129	TCL 中环	5,800	218,428.00	0.48
38	603288	海天味业	2,726	216,989.60	0.48
39	002466	天齐锂业	2,600	205,374.00	0.45
40	600309	万华化学	2,200	203,830.00	0.45
41	002460	赣锋锂业	2,900	201,579.00	0.45
42	600028	中国石化	45,600	198,816.00	0.44
43	601988	中国银行	62,900	198,764.00	0.44
44	600585	海螺水泥	7,200	197,136.00	0.44
45	600919	江苏银行	26,400	192,456.00	0.43
46	601009	南京银行	18,400	191,728.00	0.42
47	601628	中国人寿	5,000	185,600.00	0.41

48	601066	中信建投	7,800	185,250.00	0.41
49	300059	东方财富	9,466	183,640.40	0.41
50	601818	光大银行	59,200	181,744.00	0.40
51	688111	金山办公	683	180,646.67	0.40
52	300274	阳光电源	1,600	178,880.00	0.40
53	002304	洋河股份	1,100	176,550.00	0.39
54	601658	邮储银行	38,100	176,022.00	0.39
55	600016	民生银行	50,800	175,260.00	0.39
56	000538	云南白药	3,180	172,864.80	0.38
57	002812	恩捷股份	1,300	170,677.00	0.38
58	601688	华泰证券	13,200	168,168.00	0.37
59	601138	工业富联	17,800	163,404.00	0.36
60	601668	中国建筑	30,030	163,062.90	0.36
61	300015	爱尔眼科	5,050	156,903.50	0.35
62	600588	用友网络	6,110	147,678.70	0.33
63	000063	中兴通讯	5,700	147,402.00	0.33
64	000963	华东医药	3,100	145,080.00	0.32
65	600999	招商证券	10,620	141,246.00	0.31
66	002027	分众传媒	20,700	138,276.00	0.31
67	000725	京东方 A	40,300	136,214.00	0.30
68	600196	复星医药	3,800	133,912.00	0.30
69	000776	广发证券	8,500	131,665.00	0.29
70	601169	北京银行	30,300	130,593.00	0.29
71	601633	长城汽车	4,400	130,328.00	0.29
72	000895	双汇发展	5,000	129,650.00	0.29
73	603799	华友钴业	2,330	129,617.90	0.29
74	601225	陕西煤业	6,900	128,202.00	0.28
75	600660	福耀玻璃	3,600	126,252.00	0.28
76	603806	福斯特	1,900	126,236.00	0.28
77	600438	通威股份	3,200	123,456.00	0.27
78	000338	潍柴动力	12,100	123,178.00	0.27
79	601229	上海银行	20,300	119,973.00	0.27
80	600837	海通证券	13,800	119,922.00	0.26
81	600958	东方证券	13,328	119,152.32	0.26
82	600406	国电南瑞	4,820	117,608.00	0.26
83	300142	沃森生物	2,900	116,551.00	0.26
84	300014	亿纬锂能	1,322	116,203.80	0.26
85	600436	片仔癀	400	115,384.00	0.25
86	603993	洛阳钼业	25,300	115,115.00	0.25
87	600029	南方航空	15,100	114,760.00	0.25
88	600132	重庆啤酒	900	114,642.00	0.25
89	300896	爱美客	200	113,270.00	0.25
90	002493	荣盛石化	9,100	111,930.00	0.25

91	300782	卓胜微	976	111,556.80	0.25
92	600926	杭州银行	8,500	111,180.00	0.25
93	600570	恒生电子	2,739	110,819.94	0.24
94	002230	科大讯飞	3,300	108,339.00	0.24
95	600600	青岛啤酒	1,000	107,500.00	0.24
96	688396	华润微	2,039	107,353.35	0.24
97	001979	招商蛇口	8,300	104,829.00	0.23
98	603659	璞泰来	2,000	103,780.00	0.23
99	603882	金域医学	1,300	101,660.00	0.22
100	002459	晶澳科技	1,680	100,951.20	0.22
101	601865	福莱特	3,000	99,930.00	0.22
102	600050	中国联通	22,200	99,456.00	0.22
103	300122	智飞生物	1,100	96,613.00	0.21
104	600031	三一重工	6,100	96,380.00	0.21
105	300759	康龙化成	1,400	95,200.00	0.21
106	600745	闻泰科技	1,800	94,644.00	0.21
107	000100	TCL 科技	25,100	93,372.00	0.21
108	600763	通策医疗	600	91,794.00	0.20
109	002821	凯莱英	620	91,760.00	0.20
110	600115	中国东航	16,300	90,139.00	0.20
111	002371	北方华创	400	90,120.00	0.20
112	601727	上海电气	22,700	89,438.00	0.20
113	601766	中国中车	17,400	88,914.00	0.20
114	601377	兴业证券	15,480	88,855.20	0.20
115	000792	盐湖股份	3,900	88,491.00	0.20
116	601319	中国人保	16,900	88,218.00	0.19
117	601877	正泰电器	3,100	85,870.00	0.19
118	300408	三环集团	2,700	82,917.00	0.18
119	002241	歌尔股份	4,900	82,467.00	0.18
120	600346	恒力石化	5,300	82,309.00	0.18
121	601155	新城控股	4,000	82,000.00	0.18
122	601390	中国中铁	14,700	81,732.00	0.18
123	300413	芒果超媒	2,700	81,054.00	0.18
124	601985	中国核电	13,500	81,000.00	0.18
125	000938	紫光股份	4,120	80,381.20	0.18
126	600893	航发动力	1,900	80,332.00	0.18
127	603501	韦尔股份	1,040	80,173.60	0.18
128	601995	中金公司	2,100	80,073.00	0.18
129	000596	古井贡酒	300	80,070.00	0.18
130	600522	中天科技	4,900	79,135.00	0.17
131	600176	中国巨石	5,686	77,955.06	0.17
132	601939	建设银行	13,700	77,131.00	0.17
133	601857	中国石油	15,500	77,035.00	0.17

134	000301	东方盛虹	5,900	76,936.00	0.17
135	601669	中国电建	10,800	76,464.00	0.17
136	601615	明阳智能	3,000	75,780.00	0.17
137	601111	中国国航	7,100	75,260.00	0.17
138	600332	白云山	2,500	74,475.00	0.16
139	002311	海大集团	1,200	74,076.00	0.16
140	002049	紫光国微	560	73,819.20	0.16
141	300003	乐普医疗	3,200	73,504.00	0.16
142	601211	国泰君安	5,400	73,386.00	0.16
143	300347	泰格医药	700	73,360.00	0.16
144	000625	长安汽车	5,944	73,170.64	0.16
145	603486	科沃斯	1,000	72,940.00	0.16
146	688777	中控技术	800	72,664.00	0.16
147	002603	以岭药业	2,420	72,503.20	0.16
148	002555	三七互娱	4,000	72,400.00	0.16
149	600015	华夏银行	13,800	71,622.00	0.16
150	603899	晨光股份	1,300	71,474.00	0.16
151	601607	上海医药	4,000	71,320.00	0.16
152	600150	中国船舶	3,200	71,296.00	0.16
153	601006	大秦铁路	10,600	70,808.00	0.16
154	601916	浙商银行	23,900	70,266.00	0.16
155	300496	中科创达	700	70,210.00	0.16
156	002074	国轩高科	2,400	69,192.00	0.15
157	300146	汤臣倍健	3,000	68,460.00	0.15
158	300724	捷佳伟创	600	68,412.00	0.15
159	300454	深信服	600	67,530.00	0.15
160	600085	同仁堂	1,500	67,020.00	0.15
161	600383	金地集团	6,500	66,495.00	0.15
162	300751	迈为股份	160	65,894.40	0.15
163	000999	华润三九	1,400	65,534.00	0.14
164	600111	北方稀土	2,600	65,130.00	0.14
165	603345	安井食品	400	64,752.00	0.14
166	000651	格力电器	2,000	64,640.00	0.14
167	688390	固德威	200	64,618.00	0.14
168	002080	中材科技	3,000	64,290.00	0.14
169	000166	申万宏源	16,100	64,078.00	0.14
170	002340	格林美	8,600	63,898.00	0.14
171	688063	派能科技	200	63,130.00	0.14
172	600010	包钢股份	32,600	62,592.00	0.14
173	603939	益丰药房	980	62,563.20	0.14
174	601788	光大证券	4,200	62,454.00	0.14
175	000069	华侨城 A	11,700	62,361.00	0.14
176	688180	君实生物	986	61,723.60	0.14

177	002709	天赐材料	1,400	61,404.00	0.14
178	600183	生益科技	4,200	60,522.00	0.13
179	600188	兖矿能源	1,800	60,444.00	0.13
180	300957	贝泰妮	400	59,696.00	0.13
181	600803	新奥股份	3,700	59,570.00	0.13
182	603737	三棵树	520	59,191.60	0.13
183	601100	恒立液压	936	59,108.40	0.13
184	000513	丽珠集团	1,800	58,464.00	0.13
185	601238	广汽集团	5,300	58,459.00	0.13
186	601881	中国银河	6,200	57,598.00	0.13
187	300316	晶盛机电	900	57,204.00	0.13
188	600219	南山铝业	17,100	55,917.00	0.12
189	601077	渝农商行	15,800	55,774.00	0.12
190	000157	中联重科	10,200	55,488.00	0.12
191	603392	万泰生物	435	55,114.50	0.12
192	600795	国电电力	12,800	54,656.00	0.12
193	600298	安琪酵母	1,200	54,264.00	0.12
194	600655	豫园股份	7,000	53,270.00	0.12
195	601868	中国能建	23,200	53,128.00	0.12
196	600989	宝丰能源	4,400	53,108.00	0.12
197	601600	中国铝业	11,800	52,746.00	0.12
198	002294	信立泰	1,600	52,560.00	0.12
199	600705	中航产融	16,000	52,480.00	0.12
200	600009	上海机场	900	51,939.00	0.11
201	002180	纳思达	1,000	51,890.00	0.11
202	601799	星宇股份	400	50,948.00	0.11
203	603456	九洲药业	1,200	50,916.00	0.11
204	601360	三六零	7,700	50,358.00	0.11
205	600011	华能国际	6,600	50,226.00	0.11
206	600233	圆通速递	2,500	50,225.00	0.11
207	600547	山东黄金	2,620	50,199.20	0.11
208	688008	澜起科技	800	50,080.00	0.11
209	000661	长春高新	300	49,935.00	0.11
210	000728	国元证券	7,860	49,753.80	0.11
211	300357	我武生物	900	49,590.00	0.11
212	688009	中国通号	10,283	49,255.57	0.11
213	002372	伟星新材	2,300	49,082.00	0.11
214	600426	华鲁恒升	1,470	48,730.50	0.11
215	603986	兆易创新	464	47,546.08	0.11
216	002405	四维图新	4,300	47,386.00	0.10
217	002508	老板电器	1,700	47,192.00	0.10
218	600521	华海药业	2,150	46,999.00	0.10
219	601689	拓普集团	800	46,864.00	0.10

220	603833	欧派家居	380	46,181.40	0.10
221	000977	浪潮信息	2,140	46,052.80	0.10
222	002600	领益智造	10,100	45,854.00	0.10
223	603369	今世缘	900	45,810.00	0.10
224	000733	振华科技	400	45,692.00	0.10
225	600845	宝信软件	1,015	45,472.00	0.10
226	601336	新华保险	1,500	45,120.00	0.10
227	300763	锦浪科技	250	45,012.50	0.10
228	002240	盛新锂能	1,200	44,988.00	0.10
229	000009	中国宝安	3,700	44,733.00	0.10
230	688036	传音控股	555	44,133.60	0.10
231	002624	完美世界	3,450	43,884.00	0.10
232	601168	西部矿业	4,300	43,860.00	0.10
233	300999	金龙鱼	1,000	43,560.00	0.10
234	000027	深圳能源	6,840	43,502.40	0.10
235	688188	柏楚电子	200	43,416.00	0.10
236	000425	徐工机械	8,500	43,095.00	0.10
237	688012	中微公司	438	42,928.38	0.09
238	002044	美年健康	7,000	42,910.00	0.09
239	600256	广汇能源	4,700	42,394.00	0.09
240	002797	第一创业	7,500	42,225.00	0.09
241	002920	德赛西威	400	42,136.00	0.09
242	600875	东方电气	2,000	42,040.00	0.09
243	002353	杰瑞股份	1,500	41,865.00	0.09
244	002001	新 和 成	2,212	41,475.00	0.09
245	600170	上海建工	15,900	41,340.00	0.09
246	000876	新 希 望	3,200	41,312.00	0.09
247	002507	涪陵榨菜	1,600	41,232.00	0.09
248	000591	太阳能	5,600	41,048.00	0.09
249	603707	健友股份	2,273	41,004.92	0.09
250	002736	国信证券	4,600	40,848.00	0.09
251	600754	锦江酒店	700	40,845.00	0.09
252	600536	中国软件	700	40,831.00	0.09
253	600848	上海临港	3,420	40,766.40	0.09
254	600688	上海石化	13,100	40,741.00	0.09
255	601618	中国中冶	12,800	40,704.00	0.09
256	002202	金风科技	3,700	40,700.00	0.09
257	600872	中炬高新	1,100	40,557.00	0.09
258	688516	奥特维	200	40,200.00	0.09
259	603605	珀莱雅	240	40,195.20	0.09
260	600741	华域汽车	2,300	39,859.00	0.09
261	601838	成都银行	2,600	39,780.00	0.09
262	002497	雅化集团	1,700	39,525.00	0.09

263	300073	当升科技	700	39,480.00	0.09
264	300033	同花顺	400	39,444.00	0.09
265	300628	亿联网络	650	39,383.50	0.09
266	002531	天顺风能	2,600	39,338.00	0.09
267	002192	融捷股份	400	39,160.00	0.09
268	002030	达安基因	2,500	38,900.00	0.09
269	300661	圣邦股份	225	38,835.00	0.09
270	688122	西部超导	410	38,822.90	0.09
271	600499	科达制造	2,700	38,367.00	0.08
272	601456	国联证券	3,400	38,250.00	0.08
273	300433	蓝思科技	3,600	37,908.00	0.08
274	002153	石基信息	2,524	37,834.76	0.08
275	600039	四川路桥	3,400	37,808.00	0.08
276	600026	中远海能	3,100	37,355.00	0.08
277	002648	卫星化学	2,406	37,293.00	0.08
278	600380	健康元	3,300	37,257.00	0.08
279	002268	电科网安	1,200	36,636.00	0.08
280	000423	东阿阿胶	900	36,630.00	0.08
281	000739	普洛药业	1,700	36,618.00	0.08
282	603127	昭衍新药	620	36,214.20	0.08
283	300676	华大基因	700	36,183.00	0.08
283	600056	中国医药	2,100	36,183.00	0.08
284	000987	越秀资本	5,980	35,820.20	0.08
285	600018	上港集团	6,700	35,778.00	0.08
286	300595	欧普康视	1,000	35,700.00	0.08
287	601699	潞安环能	2,100	35,385.00	0.08
288	601117	中国化学	4,400	34,936.00	0.08
289	000983	山西焦煤	2,980	34,717.00	0.08
290	603613	国联股份	390	34,491.60	0.08
291	300529	健帆生物	1,110	34,376.70	0.08
292	600027	华电国际	5,800	34,104.00	0.08
293	603606	东方电缆	500	33,915.00	0.07
294	000960	锡业股份	2,400	33,840.00	0.07
295	605117	德业股份	100	33,120.00	0.07
296	600362	江西铜业	1,900	33,117.00	0.07
297	603290	斯达半导	100	32,930.00	0.07
298	600460	士兰微	1,000	32,790.00	0.07
299	300363	博腾股份	800	32,680.00	0.07
300	601872	招商轮船	5,800	32,422.00	0.07
301	002601	龙佰集团	1,700	32,164.00	0.07
302	002463	沪电股份	2,700	32,130.00	0.07
303	600563	法拉电子	200	31,976.00	0.07
304	600674	川投能源	2,600	31,798.00	0.07

305	603198	迎驾贡酒	500	31,390.00	0.07
306	603444	吉比特	100	31,284.00	0.07
307	000786	北新建材	1,200	31,056.00	0.07
308	002252	上海莱士	4,800	30,432.00	0.07
309	601216	君正集团	7,600	30,324.00	0.07
310	601992	金隅集团	11,900	30,226.00	0.07
311	300832	新产业	600	30,084.00	0.07
312	600153	建发股份	2,200	30,030.00	0.07
313	600584	长电科技	1,300	29,965.00	0.07
314	002120	韵达股份	2,080	29,910.40	0.07
315	002384	东山精密	1,200	29,676.00	0.07
316	600801	华新水泥	2,000	29,640.00	0.07
317	002841	视源股份	500	29,520.00	0.07
318	600160	巨化股份	1,900	29,469.00	0.07
319	002007	华兰生物	1,300	29,419.00	0.06
320	000629	钒钛股份	6,200	29,326.00	0.06
321	601555	东吴证券	4,440	28,993.20	0.06
322	300699	光威复材	400	28,900.00	0.06
323	600079	人福医药	1,200	28,668.00	0.06
324	000408	藏格矿业	1,100	28,567.00	0.06
325	600583	海油工程	4,700	28,482.00	0.06
326	603218	日月股份	1,400	28,420.00	0.06
327	002326	永太科技	1,300	28,379.00	0.06
328	002013	中航机电	2,800	28,140.00	0.06
329	000723	美锦能源	3,100	27,962.00	0.06
330	002568	百润股份	748	27,945.28	0.06
331	601878	浙商证券	2,800	27,804.00	0.06
332	000807	云铝股份	2,500	27,800.00	0.06
333	688005	容百科技	403	27,706.25	0.06
334	002756	永兴材料	300	27,651.00	0.06
335	000799	酒鬼酒	200	27,588.00	0.06
336	002430	杭氧股份	700	27,552.00	0.06
337	300144	宋城演艺	1,880	27,448.00	0.06
338	601016	节能风电	7,200	27,432.00	0.06
339	600096	云天化	1,300	27,352.00	0.06
340	600884	杉杉股份	1,500	27,300.00	0.06
341	688363	华熙生物	200	27,056.00	0.06
342	600704	物产中大	5,600	26,936.00	0.06
343	600918	中泰证券	4,200	26,922.00	0.06
344	002385	大北农	3,000	26,700.00	0.06
345	002422	科伦药业	1,000	26,610.00	0.06
346	600711	盛屯矿业	4,500	26,505.00	0.06
347	002414	高德红外	2,383	26,213.00	0.06

348	603233	大参林	656	25,977.60	0.06
349	002916	深南电路	360	25,974.00	0.06
350	600487	亨通光电	1,700	25,602.00	0.06
351	002625	光启技术	1,500	25,530.00	0.06
352	600549	厦门钨业	1,300	25,415.00	0.06
353	603185	上机数控	240	25,404.00	0.06
354	300207	欣旺达	1,200	25,380.00	0.06
355	600779	水井坊	300	25,326.00	0.06
356	300776	帝尔激光	200	25,200.00	0.06
357	603816	顾家家居	590	25,198.90	0.06
358	002236	大华股份	2,200	24,882.00	0.05
359	300601	康泰生物	780	24,593.40	0.05
360	601233	桐昆股份	1,700	24,565.00	0.05
361	002064	华峰化学	3,600	24,480.00	0.05
362	603517	绝味食品	400	24,436.00	0.05
363	300037	新宙邦	560	24,343.20	0.05
364	688187	时代电气	446	24,338.22	0.05
365	600348	华阳股份	1,700	24,225.00	0.05
366	603596	伯特利	300	23,940.00	0.05
367	000933	神火股份	1,600	23,936.00	0.05
368	601108	财通证券	3,350	23,852.00	0.05
369	002850	科达利	200	23,762.00	0.05
370	000066	中国长城	2,300	23,460.00	0.05
371	000703	恒逸石化	3,330	23,409.90	0.05
372	000630	铜陵有色	7,500	23,400.00	0.05
373	300438	鹏辉能源	300	23,397.00	0.05
374	600141	兴发集团	800	23,200.00	0.05
375	000738	航发控制	900	23,076.00	0.05
376	603589	口子窖	400	23,068.00	0.05
377	600985	淮北矿业	1,800	23,040.00	0.05
378	000932	华菱钢铁	4,900	23,030.00	0.05
379	000831	中国稀土	700	23,016.00	0.05
380	300769	德方纳米	100	22,959.00	0.05
381	601966	玲珑轮胎	1,100	22,528.00	0.05
382	300390	天华超净	400	22,352.00	0.05
383	002223	鱼跃医疗	700	22,302.00	0.05
384	000975	银泰黄金	2,020	22,300.80	0.05
385	601058	赛轮轮胎	2,200	22,044.00	0.05
386	000825	太钢不锈	5,100	22,032.00	0.05
387	002078	太阳纸业	1,900	21,888.00	0.05
388	601880	辽港股份	13,500	21,870.00	0.05
389	603568	伟明环保	1,180	21,865.40	0.05
390	601636	旗滨集团	1,900	21,641.00	0.05

391	002532	天山铝业	2,800	21,616.00	0.05
392	002299	圣农发展	900	21,321.00	0.05
393	000783	长江证券	4,000	21,320.00	0.05
394	605358	立昂微	500	21,300.00	0.05
395	601696	中银证券	2,000	21,140.00	0.05
396	300223	北京君正	300	21,132.00	0.05
397	300373	扬杰科技	400	21,040.00	0.05
398	603712	七一二	600	20,952.00	0.05
399	002176	江特电机	1,200	20,940.00	0.05
400	002791	坚朗五金	200	20,790.00	0.05
401	600486	扬农化工	200	20,780.00	0.05
402	600415	小商品城	3,900	20,436.00	0.05
403	000683	远兴能源	2,600	20,384.00	0.05
404	603267	鸿远电子	200	20,232.00	0.04
405	002602	世纪华通	5,300	20,193.00	0.04
406	603338	浙江鼎力	420	20,097.00	0.04
407	002738	中矿资源	300	19,998.00	0.04
408	002939	长城证券	2,400	19,872.00	0.04
409	600258	首旅酒店	800	19,840.00	0.04
410	002032	苏泊尔	400	19,784.00	0.04
411	300919	中伟股份	300	19,683.00	0.04
412	000519	中兵红箭	1,000	19,640.00	0.04
413	000155	川能动力	1,100	19,624.00	0.04
414	601577	长沙银行	2,900	19,604.00	0.04
415	002673	西部证券	3,200	19,488.00	0.04
416	603077	和邦生物	6,300	19,152.00	0.04
417	300568	星源材质	900	19,134.00	0.04
418	600673	东阳光	2,200	19,118.00	0.04
419	002028	思源电气	500	19,110.00	0.04
420	002185	华天科技	2,300	19,067.00	0.04
421	000893	亚钾国际	700	19,026.00	0.04
422	600038	中直股份	400	18,564.00	0.04
423	601666	平煤股份	1,700	18,377.00	0.04
424	600392	盛和资源	1,300	18,200.00	0.04
425	300251	光线传媒	2,100	18,186.00	0.04
426	002156	通富微电	1,100	18,128.00	0.04
427	600369	西南证券	4,800	18,000.00	0.04
428	002152	广电运通	1,800	17,892.00	0.04
429	600598	北大荒	1,300	17,888.00	0.04
430	601198	东兴证券	2,300	17,756.00	0.04
431	000830	鲁西化工	1,400	17,346.00	0.04
432	002128	电投能源	1,400	17,276.00	0.04
433	601866	中远海发	7,100	17,182.00	0.04

434	000709	河钢股份	7,600	17,176.00	0.04
435	000800	一汽解放	2,200	17,006.00	0.04
436	600998	九州通	1,300	16,952.00	0.04
437	603858	步长制药	800	16,808.00	0.04
438	600516	方大炭素	2,740	16,768.80	0.04
439	002407	多氟多	500	16,660.00	0.04
440	300308	中际旭创	600	16,218.00	0.04
441	600338	西藏珠峰	700	16,044.00	0.04
442	000937	冀中能源	2,500	15,900.00	0.04
443	002138	顺络电子	600	15,708.00	0.03
444	000401	冀东水泥	1,900	15,637.00	0.03
445	000050	深天马 A	1,800	15,588.00	0.03
446	002409	雅克科技	300	15,111.00	0.03
447	603866	桃李面包	968	14,907.20	0.03
448	002266	浙富控股	3,800	14,858.00	0.03
449	300558	贝达药业	300	14,781.00	0.03
450	000998	隆平高科	900	14,463.00	0.03
451	002926	华西证券	1,900	14,307.00	0.03
452	688099	晶晨股份	200	14,102.00	0.03
453	002408	齐翔腾达	2,000	14,080.00	0.03
454	600699	均胜电子	1,000	14,050.00	0.03
455	600885	宏发股份	420	14,032.20	0.03
456	002500	山西证券	2,620	13,886.00	0.03
457	002465	海格通信	1,700	13,804.00	0.03
458	002541	鸿路钢构	460	13,473.40	0.03
459	002145	中核钛白	2,150	13,244.00	0.03
460	300726	宏达电子	300	13,242.00	0.03
461	002065	东华软件	2,300	13,018.00	0.03
462	000750	国海证券	3,900	12,987.00	0.03
463	688006	杭可科技	287	12,561.99	0.03
464	300070	碧水源	2,600	12,298.00	0.03
465	002506	协鑫集成	4,200	12,222.00	0.03
466	600295	鄂尔多斯	800	12,152.00	0.03
467	000988	华工科技	700	11,487.00	0.03
468	300850	新强联	200	10,656.00	0.02
469	002557	洽洽食品	200	10,000.00	0.02
470	688002	睿创微纳	236	8,776.84	0.02

8.3.2 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	001301	尚太科技	756	44,634.24	0.10

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600519	贵州茅台	1,942,008.00	4.90
2	300750	宁德时代	1,938,884.00	4.89
3	600036	招商银行	1,420,630.00	3.59
4	600900	长江电力	1,212,506.00	3.06
5	601012	隆基绿能	778,425.00	1.97
6	002594	比亚迪	772,584.00	1.95
7	300760	迈瑞医疗	754,926.00	1.91
8	601888	中国中免	689,077.60	1.74
9	603259	药明康德	668,367.00	1.69
10	601166	兴业银行	572,894.00	1.45
11	002352	顺丰控股	561,775.00	1.42
12	601318	中国平安	539,474.00	1.36
13	601398	工商银行	533,638.00	1.35
14	300274	阳光电源	529,790.00	1.34
15	600276	恒瑞医药	495,767.40	1.25
16	000858	五粮液	490,828.00	1.24
17	002475	立讯精密	466,347.00	1.18
18	000001	平安银行	466,308.00	1.18
19	002812	恩捷股份	410,707.00	1.04
20	601088	中国神华	405,826.00	1.02

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 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	600519	贵州茅台	1,233,038.00	3.11
2	600036	招商银行	1,180,636.00	2.98
3	300750	宁德时代	900,808.00	2.27
4	600900	长江电力	718,240.00	1.81
5	300274	阳光电源	652,407.00	1.65
6	300760	迈瑞医疗	636,732.00	1.61
7	002594	比亚迪	603,509.00	1.52
8	601012	隆基绿能	590,167.00	1.49
9	603259	药明康德	543,940.80	1.37
10	002304	洋河股份	502,628.00	1.27
11	601166	兴业银行	481,778.00	1.22
12	601318	中国平安	454,517.00	1.15

13	601888	中国中免	440,167.00	1.11
14	601398	工商银行	438,215.00	1.11
15	000858	五粮液	379,197.00	0.96
16	002475	立讯精密	332,556.00	0.84
17	000001	平安银行	325,946.00	0.82
18	688599	天合光能	308,746.99	0.78
19	002142	宁波银行	303,425.00	0.77
20	600030	中信证券	294,400.00	0.74

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 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	52,727,629.61
卖出股票收入（成交）总额	38,629,735.26

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

华宝 MSCI ESG 指数截止 2022 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的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。

华宝 MSCI ESG 指数截止 2022 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的中国平安保险(集团)股份有限公司因未按照规定进行国际收支统计申报于 2022 年 8 月 22 日收到国家外汇管理局深圳市分局责令改正、给予警告并处罚款人民币 30 万元的处罚决定。

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

8.12.2 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。

8.12.3 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	6,906.92
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,054.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,961.86

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	4,335	7,576.08	20,499,861.42	62.42	12,342,452.36	37.58
华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C	128	28,687.77	3,288,932.74	89.57	383,101.52	10.43
合计	4,463	8,181.57	23,788,794.16	65.15	12,725,553.88	34.85

9.2 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	广发证券股份有限公司	544,735.00	24.54
2	郑宏	363,149.00	16.36
3	王星宇	227,385.00	10.24
4	黄钰婷	169,755.00	7.65
5	李奇	91,891.00	4.14
6	马其龙	77,500.00	3.49

7	钱中明	68,637.00	3.09
8	蒙以贤	57,349.00	2.58
9	郑崇	45,911.00	2.07
10	罗兰琦	42,319.00	1.91

9.3 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	1,649.54	0.0050
	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C	0.00	0.0000
	合计	1,649.54	0.0045

9.4 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

§ 10 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	30,793,583.35	14,220,896.25
减：本报告期基金总赎回份额	23,930,889.77	10,632,809.58
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	32,842,313.78	3,672,034.26

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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（黄小薏）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。

2022 年 7 月 2 日，基金管理人发布董事长变更公告，黄孔威担任公司董事长，朱永红不再担任公司董事长。

2022 年 10 月 15 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任向辉为公司总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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在本报告期的审计报酬为 35,200.00 元人民币。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：自 2019 年 11 月 20 日起至本报告期末。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	56,992,823.30	62.61	52,994.68	62.84	-
南京证券	1	8,475,489.92	9.31	7,808.59	9.26	-
华西证券	2	5,206,911.62	5.72	4,797.09	5.69	-
长江证券	1	5,167,043.69	5.68	4,760.53	5.64	-
华金证券	2	4,747,908.40	5.22	4,374.21	5.19	-
东方证券	1	4,503,890.10	4.95	4,112.62	4.88	-
海通证券	1	1,590,467.39	1.75	1,481.21	1.76	-
野村东方国际证券	2	1,135,571.41	1.25	1,039.73	1.23	-
东方财富	2	1,039,079.42	1.14	967.83	1.15	-
华宝证券	1	829,351.60	0.91	764.13	0.91	-
星展证券	2	428,962.00	0.47	390.93	0.46	-
招商证券	2	375,311.88	0.41	345.79	0.41	-
天风证券	2	275,857.00	0.30	254.16	0.30	-
华创证券	1	264,106.86	0.29	243.38	0.29	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	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：资质雄厚，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：华金证券；退租交易单元：中泰证券、天风证券。

11.7.2 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。

11.8 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
7	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 2 季度报告	基金管理人网站	2022-07-21
8	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	基金管理人网站	2022-08-31
9	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加泰信财富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	2022-09-29
10	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中正达广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	2022-10-12
11	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 3 季度报告	基金管理人网站	2022-10-26
12	华宝基金关于旗下部分基金新增五矿证券有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2022-10-27
13	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF) 溢价风险提示	基金管理人网站, 证券时报	2022-11-29

	公告		
14	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF) (A 类份额) 基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2022-12-21
15	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF) (C 类份额) 基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2022-12-21
16	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 (更新)	基金管理人网站	2022-12-21

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20220101~20221231	9,999,450.00	0.00	0.00	9,999,450.00	27.38
	2	20220811~20220922	0.00	7,668,532.86	7,668,532.86	0.00	0.00
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。 在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

2022 年 7 月 2 日，基金管理人发布董事长变更公告，黄孔威担任公司董事长，朱永红不再担任公司董事长。

2022 年 10 月 15 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任向辉为公司总经理。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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

2023 年 3 月 31 日