

华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数
证券投资基金（LOF）
2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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合规守信情况的说明	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	12
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	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55

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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末上市基金前十名持有人	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 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	25,970,249.68 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	25,336,546.68 份	633,703.00 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	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
和指标	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	-1,019,977.38	-140,305.59
本期利润	-356,967.29	-22,667.14
加权平均基金份额本期利润	-0.0124	-0.0072
本期加权平均净值利润率	-0.98%	-0.57%
本期基金份额净值增长率	-1.39%	-1.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	5,641,554.70	138,194.05
期末可供分配基金份额利润	0.2227	0.2181
期末基金资产净值	30,978,101.38	771,897.05
期末基金份额净值	1.2227	1.2181
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	22.27%	-20.23%

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	0.86%	0.81%	0.41%	0.82%	0.45%	-0.01%
过去三个月	-4.64%	0.74%	-5.48%	0.75%	0.84%	-0.01%
过去六个月	-1.39%	0.74%	-2.35%	0.75%	0.96%	-0.01%
过去一年	-12.30%	0.88%	-14.21%	0.90%	1.91%	-0.02%
过去三年	4.72%	1.10%	-3.41%	1.12%	8.13%	-0.02%
自基金合同生效起至今	22.27%	1.12%	6.92%	1.13%	15.35%	-0.01%

华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数 (LOF) C

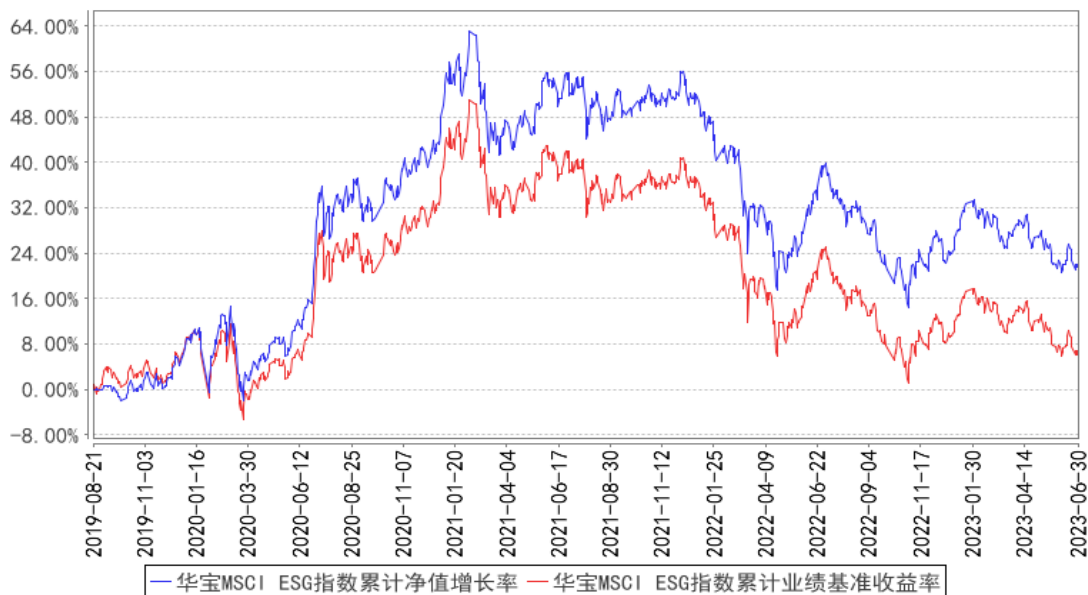
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.82%	0.81%	0.41%	0.82%	0.41%	-0.01%
过去三个月	-4.69%	0.74%	-5.48%	0.75%	0.79%	-0.01%
过去六个月	-1.50%	0.74%	-2.35%	0.75%	0.85%	-0.01%
过去一年	-12.49%	0.88%	-14.21%	0.90%	1.72%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-20.23%	1.03%	-23.04%	1.04%	2.81%	-0.01%

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%；

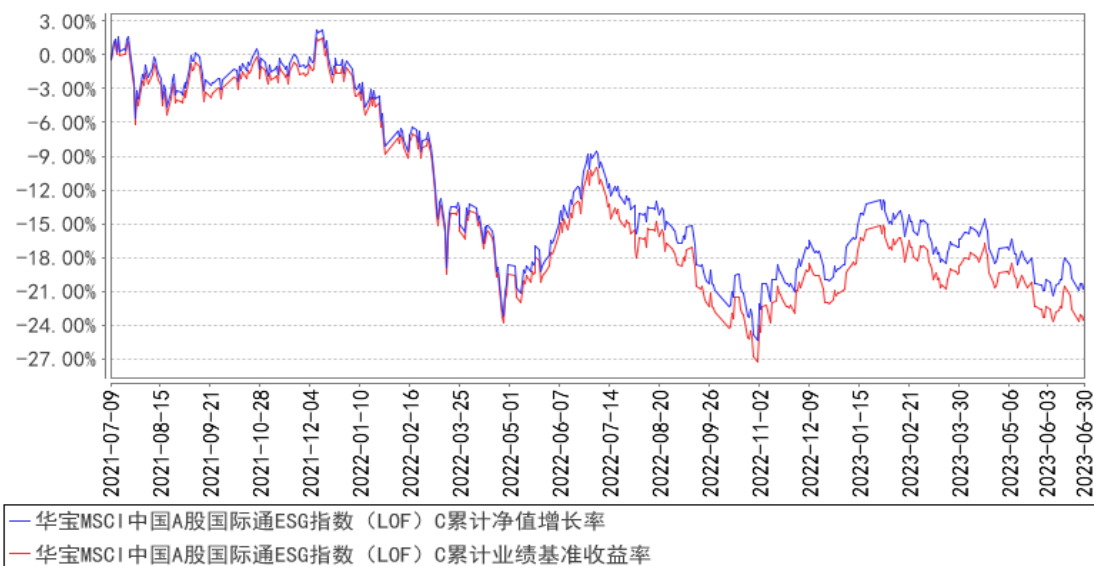
(2) 净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资

基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司，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（2023 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 139 只。

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发起式联接基金、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，2023 年 4 月起任华宝中证沪港深新消费指数型证券投资基金基金经理。
张放	本基金基金经理	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，2023 年 4 月起任华宝中证沪港深新消费指数型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》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

2023 年上半年，中国经济内生修复动力从快变慢，各类经济数据从低位快速反弹，目前维持高位震荡，表明中国经济持续处于良好的复苏态势中。今年上半年，央行继续精准有力实施稳健的货币政策，于 6 月 20 日时隔近一年再次下调一年期和五年期的贷款市场报价利率（LPR），保持金融市场对实体经济的支持力度。全球来看，中美利差维持倒挂，全球经济韧性仍强，但已进入去库存周期。市场方面，A 股整体呈现结构性行情，不同板块表现差异明显。2023 年上半年，通信、传媒、计算机、机械设备等行业表现较好，商业贸易、房地产、建筑材料等行业表现较弱。指数方面，市场上基准指数呈现分化态势，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 1.26%和 0.75%，而作为成长股代表的中证 500 指数和中证 1000 指数分别上涨了 2.29%和 5.10%。在本报告期内，MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数累计下跌了 2.5%。

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-1.39%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为-1.50%；同期业绩比较基准收益率为-2.35%。

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 年下半年，国内经济仍处于稳步复苏期，随着下半年各项会议与密集政策的发布，消费、地产、汽车等多领域的相关政策将会更好的支持下半年经济进一步恢复。流动性层面，央行、住建部等多部委的表态，对保交楼贷款、住房租赁、城中村改造、保障性住房建设等民生领域将持续提供金融支持，同时首次表示将指导商业银行有序调整存量个人住房贷款利率，国内流动性将持续“合理充裕”。全球来看，重点在于美联储货币政策对全球流动性的影响趋缓，全球经济对市场的影响或强于流动性的边际变化。对于资本市场风险偏好，政治局会议强调“活跃资本市场，提振投资者信心”，或将为后续资本市场注入新活力。随着注册制在 A 股的持续推进与加深，A 股逐步走向成熟，当前市场估值性价比也进一步提升了 A 股市场的相对吸引力。但同时，仍需关注当前 A 股市场所处的结构性市场环境，国内外短期的不确定因素仍会对资本市场带来潜在扰动。

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、电力设备、食品饮料、医药生物、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、适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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，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 2023 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,982,884.76	3,137,703.46
结算备付金		132,594.55	74,031.02
存出保证金		7,013.97	6,906.92
交易性金融资产	6.4.7.2	29,851,802.20	42,731,634.57
其中：股票投资		29,851,802.20	42,731,634.57
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,755.30	4,054.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		31,983,050.78	45,954,330.91

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		-	-
应付赎回款		6,056.46	42,513.27
应付管理人报酬		15,045.39	20,580.80
应付托管费		3,009.07	4,116.16
应付销售服务费		887.91	963.09
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	208,053.52	624,281.40
负债合计		233,052.35	692,454.72
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	25,970,249.68	36,514,348.04
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	5,779,748.75	8,747,528.15
净资产合计		31,749,998.43	45,261,876.19
负债和净资产总计		31,983,050.78	45,954,330.91

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 25,970,249.68 份，其中华宝 MSCI ESG 指数基金份额总额 25,336,546.68 份，基金份额净值 1.2227 元；华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数 (LOF) C 基金份额总额 633,703.00 份，基金份额净值 1.2181 元。

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-119,555.82	-4,614,581.27
1. 利息收入		6,572.10	5,438.69
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,572.10	5,438.69
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）		-920,421.42	-1,703,369.80
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,247,410.37	-1,948,778.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	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	326,988.95	245,408.90
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	780,648.54	-3,080,231.44
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	13,644.96	163,581.28
减：二、营业总支出		260,078.61	213,760.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	100,429.72	88,621.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	20,085.92	17,724.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,801.18	254.66
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	135,761.79	107,159.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-379,634.43	-4,828,341.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-379,634.43	-4,828,341.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-379,634.43	-4,828,341.56

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	36,514,348.04	-	8,747,528.15	45,261,876.19
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)	36,514,348.04	-	8,747,528.15	45,261,876.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-10,544,098.36	-	-2,967,779.40	-13,511,877.76
(一)、综合收益总额	-	-	-379,634.43	-379,634.43
(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)	-10,544,098.36	-	-2,588,144.97	-13,132,243.33
其中：1. 基金申购款	21,361,363.90	-	4,972,957.58	26,334,321.48
2. 基金赎回款	-31,905,462.26	-	-7,561,102.55	-39,466,564.81
(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)	25,970,249.68	-	5,779,748.75	31,749,998.43
项目	上年度可比期间 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

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

基金管理人负责人

向辉

主管会计工作负责人

张幸骏

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 \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 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	1,982,884.76
等于：本金	1,982,699.07
加：应计利息	185.69
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	1,982,884.76

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	31,078,507.74	-	29,851,802.20	-1,226,705.54
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	31,078,507.74	-	29,851,802.20	-1,226,705.54

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

本基金本报告期末及上年度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

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

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

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	96,156.69
其中：交易所市场	96,156.69
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	42,250.83
应付指数使用费	69,646.00
合计	208,053.52

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,842,313.78	32,842,313.78
本期申购	4,445,641.49	4,445,641.49
本期赎回（以“-”号填列）	-11,951,408.59	-11,951,408.59
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	25,336,546.68	25,336,546.68

华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,672,034.26	3,672,034.26
本期申购	16,915,722.41	16,915,722.41
本期赎回（以“-”号填列）	-19,954,053.67	-19,954,053.67
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	633,703.00	633,703.00

6.4.7.11 其他综合收益

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
上年度末	13,965,546.97	-6,086,908.67	7,878,638.30
本期利润	-1,019,977.38	663,010.09	-356,967.29
本期基金份额交易产生的变动数	-3,150,751.36	1,270,635.05	-1,880,116.31
其中：基金申购款	1,872,044.35	-620,658.05	1,251,386.30
基金赎回款	-5,022,795.71	1,891,293.10	-3,131,502.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,794,818.23	-4,153,263.53	5,641,554.70

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
上年度末	1,548,693.34	-679,803.49	868,889.85
本期利润	-140,305.59	117,638.45	-22,667.14
本期基金份额交易产生的变动数	-1,166,435.16	458,406.50	-708,028.66
其中：基金申购款	6,927,703.45	-3,206,132.17	3,721,571.28
基金赎回款	-8,094,138.61	3,664,538.67	-4,429,599.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	241,952.59	-103,758.54	138,194.05

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,651.75
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	217.90
其他	702.45
合计	6,572.10

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

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	36,471,557.69
减：卖出股票成本总额	37,621,888.62
减：交易费用	97,079.44
买卖股票差价收入	-1,247,410.37

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

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

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

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

6.4.7.16 资产支持证券投资

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

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

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

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

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

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	326,988.95
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	326,988.95

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	780,648.54
股票投资	780,648.54
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	780,648.54

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,644.96
合计	13,644.96

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。2. 本基金的

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

6.4.7.22 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	1,430.10
指数使用费	92,080.86
合计	135,761.79

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司(“华宝基金”)	基金管理人, 注册登记机构, 基金销售机构
中国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：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

6.4.10.1.3 债券回购交易

6.4.10.1.4 权证交易

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	100,429.72	88,621.59
其中：支付销售机构的客户维护费	19,905.68	19,175.12

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	20,085.92	17,724.30

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

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝 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	-	1,899.51	1,899.51
合计	-	1,899.51	1,899.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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 0.2% 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： $H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$ ，H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

华宝 MSCI ESG 指数

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	39.47	9,999,450.00	30.45

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	1,982,884.76	5,651.75	2,390,669.92	5,160.30

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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）77,300 股，期末公允价值为人民币 372,586.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 1.17%。（上年度末：持有 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%）

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（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功 认购日	受限期	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 （单 位： 股）	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
601916	浙商银行	2023 年 6 月 27 日	1 个月 内 （含）	配股流 通受限	2.02	2.64	6,150	12,423.00	16,236.00	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，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

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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 2023 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	1,982,884.76	-	-	-	1,982,884.76
结算备付金	132,594.55	-	-	-	132,594.55
存出保证金	7,013.97	-	-	-	7,013.97
交易性金融资产	-	-	-	29,851,802.20	29,851,802.20
应收申购款	1.00	-	-	8,754.30	8,755.30
资产总计	2,122,494.28	-	-	29,860,556.50	31,983,050.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,056.46	6,056.46
应付管理人报酬	-	-	-	15,045.39	15,045.39
应付托管费	-	-	-	3,009.07	3,009.07
应付销售服务费	-	-	-	887.91	887.91
其他负债	-	-	-	208,053.52	208,053.52
负债总计	-	-	-	233,052.35	233,052.35
利率敏感度缺口	2,122,494.28	-	-	29,627,504.15	31,749,998.43
上年度末 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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	29,851,802.20	94.02	42,731,634.57	94.41
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	29,851,802.20	94.02	42,731,634.57	94.41

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）

1. 业绩比较基准上 升 5%	1, 551, 524. 02	2, 225, 834. 74
2. 业绩比较基准下 降 5%	-1, 551, 524. 02	-2, 225, 834. 74

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	29, 835, 566. 20	42, 702, 414. 57
第二层次	16, 236. 00	29, 220. 00
第三层次	-	-
合计	29, 851, 802. 20	42, 731, 634. 57

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6. 4. 14. 3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6. 4. 14. 4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	29,851,802.20	93.34
	其中：股票	29,851,802.20	93.34
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	2,115,479.31	6.61
8	其他各项资产	15,769.27	0.05
9	合计	31,983,050.78	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	203,709.70	0.64
B	采矿业	983,936.60	3.10
C	制造业	15,726,016.01	49.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,096,989.60	3.46
E	建筑业	402,867.20	1.27
F	批发和零售业	395,295.73	1.25
G	交通运输、仓储和邮政业	1,040,969.80	3.28
H	住宿和餐饮业	26,411.00	0.08

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,517,535.57	4.78
J	金融业	6,711,429.40	21.14
K	房地产业	550,130.00	1.73
L	租赁和商务服务业	385,005.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	416,510.04	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	26,146.80	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	14,100.00	0.04
Q	卫生和社会工作	198,649.75	0.63
R	文化、体育和娱乐业	115,110.00	0.36
S	综合	40,990.00	0.13
	合计	29,851,802.20	94.02

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

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

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	800	1,352,800.00	4.26
2	300750	宁德时代	5,380	1,230,890.20	3.88
3	002594	比亚迪	3,600	929,772.00	2.93
4	600036	招商银行	20,300	665,028.00	2.09
5	600900	长江电力	23,200	511,792.00	1.61
6	601318	中国平安	10,621	492,814.40	1.55
7	600276	恒瑞医药	7,872	377,068.80	1.19
8	601398	工商银行	77,300	372,586.00	1.17
9	601288	农业银行	104,500	368,885.00	1.16
10	601166	兴业银行	20,400	319,260.00	1.01
11	603259	药明康德	5,084	316,784.04	1.00
12	000858	五粮液	1,900	310,783.00	0.98
13	601138	工业富联	12,200	307,440.00	0.97

14	600030	中信证券	14,990	296,502.20	0.93
15	601328	交通银行	48,200	279,560.00	0.88
16	002352	顺丰控股	6,000	270,540.00	0.85
17	300760	迈瑞医疗	900	269,820.00	0.85
18	000001	平安银行	23,800	267,274.00	0.84
19	601888	中国中免	2,400	265,272.00	0.84
20	600000	浦发银行	36,000	260,640.00	0.82
21	601088	中国神华	8,100	249,075.00	0.78
22	688111	金山办公	483	228,082.26	0.72
23	600887	伊利股份	7,900	223,728.00	0.70
24	601012	隆基绿能	7,440	213,304.80	0.67
25	600436	片仔癀	700	200,452.00	0.63
26	600028	中国石化	31,100	197,796.00	0.62
27	600690	海尔智家	7,700	180,796.00	0.57
28	000063	中兴通讯	3,900	177,606.00	0.56
29	601988	中国银行	43,100	168,521.00	0.53
30	002129	TCL 中环	5,000	166,000.00	0.52
31	002142	宁波银行	6,450	163,185.00	0.51
32	002230	科大讯飞	2,300	156,308.00	0.49
33	600048	保利发展	11,800	153,754.00	0.48
34	000725	京东方 A	36,800	150,512.00	0.47
35	601919	中远海控	15,620	146,828.00	0.46
36	000568	泸州老窖	700	146,699.00	0.46
37	601818	光大银行	45,600	139,992.00	0.44
38	601658	邮储银行	28,600	139,854.00	0.44
39	000002	万科 A	9,600	134,592.00	0.42
40	600919	江苏银行	18,100	133,035.00	0.42
41	600309	万华化学	1,500	131,760.00	0.41
42	600016	民生银行	34,800	130,500.00	0.41
43	300274	阳光电源	1,100	128,293.00	0.40
44	601607	上海医药	5,500	123,255.00	0.39
45	002460	赣锋锂业	2,000	121,920.00	0.38
46	601628	中国人寿	3,400	118,864.00	0.37
47	601668	中国建筑	20,630	118,416.20	0.37
48	600585	海螺水泥	4,900	116,326.00	0.37
49	600905	三峡能源	21,100	113,307.00	0.36
50	002714	牧原股份	2,638	111,191.70	0.35
51	600809	山西汾酒	600	111,042.00	0.35
52	300059	东方财富	7,819	111,029.80	0.35
53	600837	海通证券	11,900	109,718.00	0.35
54	603288	海天味业	2,291	107,333.35	0.34
55	002466	天齐锂业	1,500	104,865.00	0.33
56	601066	中信建投	4,300	104,060.00	0.33

57	000338	潍柴动力	8,300	103,418.00	0.33
58	600999	招商证券	7,320	99,332.40	0.31
59	601688	华泰证券	7,200	99,144.00	0.31
60	001979	招商蛇口	7,600	99,028.00	0.31
61	600085	同仁堂	1,700	97,852.00	0.31
62	002027	分众传媒	14,200	96,702.00	0.30
63	601169	北京银行	20,800	96,304.00	0.30
64	002371	北方华创	300	95,295.00	0.30
65	000538	云南白药	1,780	93,414.40	0.29
66	603659	璞泰来	2,430	92,874.60	0.29
67	603993	洛阳钼业	17,400	92,742.00	0.29
68	600406	国电南瑞	3,984	92,030.40	0.29
69	002304	洋河股份	700	91,945.00	0.29
70	000100	TCL 科技	23,100	91,014.00	0.29
71	000938	紫光股份	2,820	89,817.00	0.28
72	601601	中国太保	3,400	88,332.00	0.28
73	601360	三六零	7,000	87,780.00	0.28
74	601225	陕西煤业	4,800	87,312.00	0.27
75	002812	恩捷股份	900	86,715.00	0.27
76	600588	用友网络	4,210	86,305.00	0.27
77	000776	广发证券	5,800	85,318.00	0.27
78	601995	中金公司	2,400	85,248.00	0.27
79	601816	京沪高铁	16,100	84,686.00	0.27
80	300015	爱尔眼科	4,545	84,309.75	0.27
81	300124	汇川技术	1,300	83,473.00	0.26
82	000895	双汇发展	3,400	83,266.00	0.26
83	688036	传音控股	555	81,585.00	0.26
84	600570	恒生电子	1,839	81,449.31	0.26
85	601865	福莱特	2,100	80,871.00	0.25
86	688396	华润微	1,542	80,816.22	0.25
87	600196	复星医药	2,600	80,340.00	0.25
88	601111	中国国航	9,500	78,280.00	0.25
89	601766	中国中车	11,900	77,350.00	0.24
90	002555	三七互娱	2,200	76,736.00	0.24
91	601390	中国中铁	10,100	76,558.00	0.24
92	600438	通威股份	2,200	75,482.00	0.24
93	600050	中国联通	15,600	74,880.00	0.24
94	603501	韦尔股份	740	72,549.60	0.23
95	600600	青岛啤酒	700	72,541.00	0.23
96	600150	中国船舶	2,200	72,402.00	0.23
97	002493	荣盛石化	6,200	72,168.00	0.23
98	000301	东方盛虹	6,100	72,102.00	0.23
99	300999	金龙鱼	1,800	71,982.00	0.23

100	600958	东方证券	7,328	71,081.60	0.22
101	601727	上海电气	15,500	70,835.00	0.22
102	601916	浙商银行	26,650	70,356.00	0.22
103	600015	华夏银行	13,000	70,330.00	0.22
104	603799	华友钴业	1,530	70,242.30	0.22
105	600031	三一重工	4,200	69,846.00	0.22
106	000977	浪潮信息	1,440	69,840.00	0.22
107	002602	世纪华通	9,200	69,828.00	0.22
108	603806	福斯特	1,860	69,173.40	0.22
109	002459	晶澳科技	1,652	68,888.40	0.22
110	000661	长春高新	500	68,150.00	0.21
110	600926	杭州银行	5,800	68,150.00	0.21
111	603882	金域医学	900	67,950.00	0.21
112	600029	南方航空	11,000	66,330.00	0.21
113	601985	中国核电	9,300	65,565.00	0.21
114	000166	申万宏源	13,800	63,756.00	0.20
115	300014	亿纬锂能	1,022	61,831.00	0.19
116	600346	恒力石化	4,300	61,619.00	0.19
117	300413	芒果超媒	1,800	61,578.00	0.19
118	600019	宝钢股份	10,900	61,258.00	0.19
119	601009	南京银行	7,600	60,800.00	0.19
120	600803	新奥股份	3,200	60,736.00	0.19
121	601633	长城汽车	2,400	60,408.00	0.19
122	601229	上海银行	10,500	60,375.00	0.19
123	002241	歌尔股份	3,400	60,350.00	0.19
124	300498	温氏股份	3,260	59,821.00	0.19
125	300308	中际旭创	400	58,980.00	0.19
126	601939	建设银行	9,400	58,844.00	0.19
127	600745	闻泰科技	1,200	58,680.00	0.18
128	601877	正泰电器	2,100	58,065.00	0.18
129	000963	华东医药	1,300	56,381.00	0.18
130	300408	三环集团	1,900	55,765.00	0.18
131	600132	重庆啤酒	600	55,296.00	0.17
132	600176	中国巨石	3,886	55,025.76	0.17
133	600893	航发动力	1,300	54,938.00	0.17
134	603486	科沃斯	700	54,439.00	0.17
135	600026	中远海能	4,300	54,352.00	0.17
136	601319	中国人保	9,300	54,312.00	0.17
137	601006	大秦铁路	7,300	54,239.00	0.17
138	600522	中天科技	3,400	54,094.00	0.17
139	600660	福耀玻璃	1,500	53,775.00	0.17
140	300122	智飞生物	1,200	53,040.00	0.17
141	601901	方正证券	8,100	52,974.00	0.17

142	300033	同花顺	300	52,584.00	0.17
143	000625	长安汽车	4,044	52,288.92	0.16
144	601377	兴业证券	8,480	51,897.60	0.16
145	601825	沪农商行	9,500	51,775.00	0.16
146	601211	国泰君安	3,700	51,763.00	0.16
147	000792	盐湖股份	2,700	51,759.00	0.16
148	000651	格力电器	1,400	51,114.00	0.16
149	300146	汤臣倍健	2,100	50,358.00	0.16
150	601238	广汽集团	4,800	50,016.00	0.16
151	300037	新宙邦	960	49,814.40	0.16
152	000596	古井贡酒	200	49,476.00	0.16
153	603444	吉比特	100	49,111.00	0.15
154	601669	中国电建	8,500	48,790.00	0.15
155	002600	领益智造	6,900	47,679.00	0.15
156	000157	中联重科	7,000	47,250.00	0.15
157	300763	锦浪科技	450	46,845.00	0.15
158	600886	国投电力	3,700	46,805.00	0.15
159	002920	德赛西威	300	46,743.00	0.15
160	688390	固德威	280	46,720.80	0.15
161	000513	丽珠集团	1,200	46,692.00	0.15
162	688777	中控技术	725	45,515.50	0.14
163	600989	宝丰能源	3,600	45,396.00	0.14
164	300454	深信服	400	45,300.00	0.14
165	300724	捷佳伟创	400	44,940.00	0.14
166	300896	爱美客	100	44,495.00	0.14
167	603345	安井食品	300	44,040.00	0.14
168	600845	宝信软件	858	43,594.98	0.14
169	600111	北方稀土	1,800	43,164.00	0.14
170	600703	三安光电	2,500	43,100.00	0.14
171	002080	中材科技	2,100	43,092.00	0.14
172	002049	紫光国微	460	42,895.00	0.14
173	000408	藏格矿业	1,900	42,883.00	0.14
174	600547	山东黄金	1,820	42,733.60	0.13
175	300316	晶盛机电	600	42,540.00	0.13
176	000999	华润三九	700	42,462.00	0.13
177	600011	华能国际	4,500	41,670.00	0.13
178	601108	财通证券	5,750	41,630.00	0.13
179	002603	以岭药业	1,620	41,617.80	0.13
180	600705	中航产融	10,800	41,364.00	0.13
181	601100	恒立液压	636	40,913.88	0.13
182	688009	中国通号	7,031	40,779.80	0.13
183	601689	拓普集团	500	40,350.00	0.13
184	603899	晨光股份	900	40,176.00	0.13

185	600010	包钢股份	22,400	40,096.00	0.13
186	600115	中国东航	8,400	39,984.00	0.13
187	002463	沪电股份	1,900	39,786.00	0.13
188	002624	完美世界	2,350	39,691.50	0.13
189	002625	光启技术	2,600	39,676.00	0.12
190	688063	派能科技	200	39,650.00	0.12
191	000425	徐工机械	5,800	39,266.00	0.12
192	601077	渝农商行	10,900	39,131.00	0.12
193	603986	兆易创新	364	38,675.00	0.12
194	300496	中科创达	400	38,540.00	0.12
195	300759	康龙化成	1,000	38,280.00	0.12
196	601577	长沙银行	4,900	38,024.00	0.12
197	688256	寒武纪	200	37,600.00	0.12
198	300207	欣旺达	2,300	37,536.00	0.12
199	002311	海大集团	800	37,472.00	0.12
200	688561	奇安信	722	37,406.82	0.12
201	688012	中微公司	238	37,235.10	0.12
202	601868	中国能建	15,900	37,206.00	0.12
203	601881	中国银河	3,200	37,152.00	0.12
204	601615	明阳智能	2,200	37,136.00	0.12
205	601799	星宇股份	300	37,080.00	0.12
206	002709	天赐材料	900	37,071.00	0.12
207	601336	新华保险	1,000	36,770.00	0.12
208	600188	兖矿能源	1,200	35,904.00	0.11
209	601600	中国铝业	6,500	35,685.00	0.11
210	000069	华侨城 A	8,100	35,640.00	0.11
211	600998	九州通	3,427	35,572.26	0.11
212	300957	贝泰妮	400	35,552.00	0.11
213	000728	国元证券	5,360	34,947.20	0.11
214	601618	中国中冶	8,800	34,936.00	0.11
215	600219	南山铝业	11,500	34,730.00	0.11
216	002340	格林美	5,000	34,550.00	0.11
217	688008	澜起科技	600	34,452.00	0.11
218	600039	四川路桥	3,500	34,335.00	0.11
219	603885	吉祥航空	2,200	33,946.00	0.11
220	600795	国电电力	8,800	33,704.00	0.11
221	002405	四维图新	2,900	33,582.00	0.11
222	600221	海航控股	21,000	33,180.00	0.10
223	600674	川投能源	2,200	33,110.00	0.10
224	600655	豫园股份	4,800	32,928.00	0.10
225	600426	华鲁恒升	1,070	32,774.10	0.10
226	600298	安琪酵母	900	32,589.00	0.10
227	300347	泰格医药	500	32,270.00	0.10

228	600109	国金证券	3,700	32,079.00	0.10
229	600332	白云山	1,000	31,880.00	0.10
230	600383	金地集团	4,400	31,724.00	0.10
231	601155	新城控股	2,200	31,702.00	0.10
232	603369	今世缘	600	31,680.00	0.10
233	002236	大华股份	1,600	31,600.00	0.10
234	600583	海油工程	5,400	31,590.00	0.10
235	002153	石基信息	2,241	31,374.00	0.10
236	601168	西部矿业	2,900	30,479.00	0.10
237	002508	老板电器	1,200	30,348.00	0.10
238	688180	君实生物	786	30,292.44	0.10
239	601788	光大证券	1,900	30,191.00	0.10
240	000009	中国宝安	2,500	30,175.00	0.10
241	600536	中国软件	640	30,003.20	0.09
242	002797	第一创业	5,200	29,744.00	0.09
243	688126	沪硅产业	1,421	29,698.90	0.09
244	603156	养元饮品	1,200	29,640.00	0.09
245	600872	中炬高新	800	29,432.00	0.09
246	603737	三棵树	448	29,308.16	0.09
247	002056	横店东磁	1,600	29,136.00	0.09
248	000733	振华科技	300	28,755.00	0.09
249	601021	春秋航空	500	28,735.00	0.09
250	002240	盛新锂能	900	28,683.00	0.09
251	300118	东方日升	1,100	28,193.00	0.09
252	600584	长电科技	900	28,053.00	0.09
253	600023	浙能电力	5,500	27,885.00	0.09
254	600848	上海临港	2,320	27,724.00	0.09
255	600741	华域汽车	1,500	27,690.00	0.09
256	603392	万泰生物	409	27,308.93	0.09
257	600009	上海机场	600	27,252.00	0.09
258	002050	三花智控	900	27,234.00	0.09
259	002736	国信证券	3,100	27,063.00	0.09
260	002044	美年健康	3,800	27,018.00	0.09
261	600079	人福医药	1,000	26,940.00	0.08
262	601231	环旭电子	1,800	26,928.00	0.08
263	605117	德业股份	180	26,919.00	0.08
264	603833	欧派家居	280	26,824.00	0.08
265	600027	华电国际	4,000	26,760.00	0.08
266	300782	卓胜微	276	26,669.88	0.08
267	002202	金风科技	2,500	26,550.00	0.08
268	002739	万达电影	2,100	26,334.00	0.08
269	002507	涪陵榨菜	1,430	26,183.30	0.08
270	600875	东方电气	1,400	26,110.00	0.08

271	002821	凯莱英	220	25,929.20	0.08
272	000987	越秀资本	4,080	25,908.00	0.08
273	600732	爱旭股份	840	25,830.00	0.08
274	000591	太阳能	3,800	25,764.00	0.08
275	601127	赛力斯	700	25,739.00	0.08
276	000876	新希望	2,200	25,696.00	0.08
277	000983	山西焦煤	2,780	25,298.00	0.08
278	600704	物产中大	5,100	25,194.00	0.08
279	300073	当升科技	500	25,165.00	0.08
280	600481	双良节能	1,800	25,164.00	0.08
281	002353	杰瑞股份	1,000	25,130.00	0.08
282	002074	国轩高科	900	24,858.00	0.08
283	601117	中国化学	3,000	24,840.00	0.08
284	600489	中金黄金	2,400	24,792.00	0.08
285	600702	舍得酒业	200	24,790.00	0.08
286	002252	上海莱士	3,300	24,783.00	0.08
287	600233	圆通速递	1,700	24,752.00	0.08
288	002372	伟星新材	1,200	24,648.00	0.08
289	603456	九洲药业	900	24,642.00	0.08
290	601699	潞安环能	1,500	24,480.00	0.08
291	002938	鹏鼎控股	1,000	24,290.00	0.08
292	300418	昆仑万维	600	24,168.00	0.08
293	600380	健康元	1,900	24,149.00	0.08
294	600183	生益科技	1,700	24,140.00	0.08
295	002648	卫星化学	1,606	24,025.76	0.08
296	688002	睿创微纳	536	24,012.80	0.08
297	002180	纳思达	700	23,975.00	0.08
298	300832	新产业	400	23,600.00	0.07
299	002966	苏州银行	3,600	23,580.00	0.07
300	600918	中泰证券	3,400	23,494.00	0.07
301	601016	节能风电	6,400	23,488.00	0.07
302	600511	国药股份	600	23,310.00	0.07
303	002001	新和成	1,512	23,284.80	0.07
304	601872	招商轮船	4,000	23,160.00	0.07
305	600415	小商品城	2,700	23,031.00	0.07
306	600061	国投资本	3,200	22,784.00	0.07
307	603688	石英股份	200	22,768.00	0.07
308	600515	海南机场	5,600	22,736.00	0.07
309	600688	上海石化	7,200	22,392.00	0.07
310	002268	电科网安	800	22,296.00	0.07
311	000066	中国长城	1,600	22,128.00	0.07
312	601838	成都银行	1,800	21,978.00	0.07
313	600256	广汇能源	3,200	21,952.00	0.07

314	600161	天坛生物	800	21,720.00	0.07
315	000807	云铝股份	1,700	21,641.00	0.07
316	603290	斯达半导	100	21,520.00	0.07
317	300628	亿联网络	610	21,392.70	0.07
318	601216	君正集团	5,200	21,320.00	0.07
319	600460	士兰微	700	21,189.00	0.07
320	300142	沃森生物	800	21,160.00	0.07
321	300595	欧普康视	700	21,133.00	0.07
322	601555	东吴证券	3,040	21,097.60	0.07
323	002422	科伦药业	700	20,776.00	0.07
324	002384	东山精密	800	20,720.00	0.07
325	002064	华峰化学	3,000	20,580.00	0.06
326	300003	乐普医疗	900	20,349.00	0.06
327	002007	华兰生物	900	20,169.00	0.06
328	002841	视源股份	300	20,052.00	0.06
329	000932	华菱钢铁	4,200	20,034.00	0.06
330	002568	百润股份	548	19,919.80	0.06
331	002601	龙佰集团	1,200	19,800.00	0.06
332	002531	天顺风能	1,300	19,799.00	0.06
333	000786	北新建材	800	19,608.00	0.06
334	002916	深南电路	260	19,596.20	0.06
335	002497	雅化集团	1,100	19,558.00	0.06
336	600056	中国医药	1,500	19,470.00	0.06
337	600763	通策医疗	200	19,372.00	0.06
338	603198	迎驾贡酒	300	19,140.00	0.06
339	000988	华工科技	500	19,005.00	0.06
340	603218	日月股份	1,000	18,990.00	0.06
341	600362	江西铜业	1,000	18,980.00	0.06
342	603939	益丰药房	512	18,944.00	0.06
343	300529	健帆生物	810	18,775.80	0.06
344	601878	浙商证券	1,900	18,772.00	0.06
345	002028	思源电气	400	18,688.00	0.06
346	300919	中伟股份	300	18,075.00	0.06
347	000799	酒鬼酒	200	18,030.00	0.06
348	002223	鱼跃医疗	500	17,995.00	0.06
349	002558	巨人网络	1,000	17,930.00	0.06
350	600160	巨化股份	1,300	17,914.00	0.06
351	603185	弘元绿能	240	17,892.00	0.06
352	601992	金隅集团	8,200	17,876.00	0.06
353	600018	上港集团	3,400	17,850.00	0.06
354	601958	金钼股份	1,600	17,840.00	0.06
355	688363	华熙生物	200	17,832.00	0.06
356	300223	北京君正	200	17,662.00	0.06

357	300769	德方纳米	160	17,636.80	0.06
358	600487	亨通光电	1,200	17,592.00	0.06
359	600486	扬农化工	200	17,484.00	0.06
360	000729	燕京啤酒	1,400	17,458.00	0.05
361	600004	白云机场	1,200	17,208.00	0.05
362	002430	杭氧股份	500	17,180.00	0.05
363	603127	昭衍新药	420	17,178.00	0.05
364	600549	厦门钨业	900	17,127.00	0.05
365	601058	赛轮轮胎	1,500	17,085.00	0.05
366	002030	达安基因	1,700	16,949.00	0.05
367	600754	锦江酒店	400	16,936.00	0.05
368	688099	晶晨股份	200	16,864.00	0.05
369	600642	申能股份	2,400	16,776.00	0.05
370	600884	杉杉股份	1,100	16,654.00	0.05
371	000629	钒钛股份	4,200	16,422.00	0.05
372	688122	西部超导	294	16,384.62	0.05
373	600153	建发股份	1,500	16,365.00	0.05
374	002738	中矿资源	320	16,300.80	0.05
375	000519	中兵红箭	900	16,281.00	0.05
376	002756	永兴材料	260	16,278.60	0.05
377	300751	迈为股份	96	16,260.48	0.05
378	002939	长城证券	2,000	16,260.00	0.05
379	600801	华新水泥	1,300	16,055.00	0.05
380	000423	东阿阿胶	300	16,035.00	0.05
381	000021	深科技	800	15,992.00	0.05
382	002414	高德红外	2,058	15,990.66	0.05
383	600606	绿地控股	5,800	15,950.00	0.05
384	601233	桐昆股份	1,200	15,900.00	0.05
385	300144	宋城演艺	1,280	15,872.00	0.05
386	603596	伯特利	200	15,852.00	0.05
387	000723	美锦能源	2,100	15,834.00	0.05
388	002156	通富微电	700	15,820.00	0.05
389	000783	长江证券	2,700	15,660.00	0.05
390	002294	信立泰	500	15,595.00	0.05
391	601966	玲珑轮胎	700	15,554.00	0.05
392	603658	安图生物	300	15,519.00	0.05
393	603613	国联股份	420	15,510.60	0.05
394	600157	永泰能源	10,900	15,478.00	0.05
395	000975	银泰黄金	1,320	15,444.00	0.05
396	000027	深圳能源	2,340	15,420.60	0.05
397	603568	伟明环保	880	15,408.80	0.05
398	600096	云天化	900	15,363.00	0.05
399	603233	大参林	547	15,321.47	0.05

400	600021	上海电力	1,400	15,078.00	0.05
401	000630	铜陵有色	5,200	15,028.00	0.05
402	002032	苏泊尔	300	15,000.00	0.05
403	002078	太阳纸业	1,400	14,966.00	0.05
404	600352	浙江龙盛	1,600	14,960.00	0.05
405	601696	中银证券	1,400	14,924.00	0.05
406	603816	顾家家居	390	14,878.50	0.05
407	300699	光威复材	480	14,808.00	0.05
408	603589	口子窖	300	14,805.00	0.05
409	000831	中国稀土	500	14,800.00	0.05
410	300363	博腾股份	500	14,795.00	0.05
411	300395	菲利华	300	14,760.00	0.05
412	300601	康泰生物	580	14,726.20	0.05
413	601990	南京证券	1,800	14,724.00	0.05
414	002185	华天科技	1,600	14,720.00	0.05
415	603606	东方电缆	300	14,709.00	0.05
416	000738	航发控制	600	14,640.00	0.05
417	002409	雅克科技	200	14,576.00	0.05
418	002128	电投能源	1,100	14,542.00	0.05
419	600566	济川药业	500	14,520.00	0.05
420	688187	时代电气	346	14,483.56	0.05
421	600546	山煤国际	1,000	14,470.00	0.05
422	688521	芯原股份	200	14,384.00	0.05
423	601880	辽港股份	9,200	14,352.00	0.05
424	000933	神火股份	1,100	14,300.00	0.05
425	300604	长川科技	300	14,247.00	0.04
426	600348	华阳股份	1,800	14,238.00	0.04
427	002607	中公教育	3,000	14,100.00	0.04
428	601933	永辉超市	4,500	14,085.00	0.04
429	002152	广电运通	1,200	14,064.00	0.04
430	002673	西部证券	2,200	13,970.00	0.04
431	300390	天华新能	390	13,962.00	0.04
432	600985	淮北矿业	1,200	13,824.00	0.04
433	600521	华海药业	750	13,807.50	0.04
434	002532	天山铝业	2,300	13,777.00	0.04
435	600563	法拉电子	100	13,730.00	0.04
436	601991	大唐发电	4,100	13,571.00	0.04
437	000825	太钢不锈	3,500	13,545.00	0.04
438	300661	圣邦股份	162	13,305.06	0.04
439	002244	滨江集团	1,500	13,230.00	0.04
440	002850	科达利	100	13,225.00	0.04
441	002385	大北农	2,000	13,200.00	0.04
442	002120	韵达股份	1,380	13,192.80	0.04

443	000683	远兴能源	1,800	12,942.00	0.04
443	002791	坚朗五金	200	12,942.00	0.04
444	601198	东兴证券	1,600	12,832.00	0.04
445	000800	一汽解放	1,500	12,555.00	0.04
446	600873	梅花生物	1,400	12,502.00	0.04
447	000960	锡业股份	800	12,440.00	0.04
448	000703	恒逸石化	1,830	12,407.40	0.04
449	600699	均胜电子	700	12,348.00	0.04
450	603338	浙江鼎力	220	12,322.20	0.04
451	002831	裕同科技	500	12,195.00	0.04
452	300373	扬杰科技	300	12,171.00	0.04
453	601866	中远海发	4,900	12,103.00	0.04
454	603712	七一二	400	12,084.00	0.04
455	600369	西南证券	3,300	12,045.00	0.04
456	002518	科士达	300	12,003.00	0.04
457	300676	华大基因	200	11,998.00	0.04
458	600598	北大荒	900	11,997.00	0.04
459	600038	中直股份	300	11,946.00	0.04
460	600170	上海建工	4,400	11,836.00	0.04
461	600779	水井坊	200	11,798.00	0.04
462	688779	长远锂科	1,029	11,596.83	0.04
463	600392	盛和资源	900	11,583.00	0.04
464	000709	河钢股份	5,100	11,526.00	0.04
465	002299	圣农发展	600	11,490.00	0.04
466	002145	中核钛白	1,950	11,485.50	0.04
467	000893	亚钾国际	500	11,470.00	0.04
468	600516	方大炭素	1,840	11,408.00	0.04
469	002465	海格通信	1,100	11,374.00	0.04
470	600499	科达制造	1,000	11,360.00	0.04
471	300251	光线传媒	1,400	11,326.00	0.04
472	002065	东华软件	1,600	11,296.00	0.04
473	601636	旗滨集团	1,300	11,206.00	0.04
474	603517	绝味食品	300	11,145.00	0.04
475	002407	多氟多	560	11,121.60	0.04
476	600141	兴发集团	500	11,110.00	0.03
477	605358	立昂微	300	11,019.00	0.03
478	000050	深天马 A	1,200	11,016.00	0.03
479	688005	容百科技	203	10,966.06	0.03
480	601456	国联证券	1,200	10,920.00	0.03
481	000937	冀中能源	1,700	10,846.00	0.03
482	600673	东阳光	1,500	10,815.00	0.03
483	002926	华西证券	1,300	10,803.00	0.03
484	600988	赤峰黄金	800	10,768.00	0.03

485	002266	浙富控股	2,600	10,738.00	0.03
486	000739	普洛药业	600	10,644.00	0.03
487	603077	和邦生物	4,300	10,449.00	0.03
488	603707	健友股份	773	10,435.50	0.03
489	002541	鸿路钢构	360	10,371.60	0.03
490	300568	星源材质	600	10,314.00	0.03
491	603858	步长制药	500	10,295.00	0.03
492	300357	我武生物	300	10,089.00	0.03
493	000155	川能动力	700	10,080.00	0.03
494	688385	复旦微电	200	10,020.00	0.03
495	300212	易华录	300	9,969.00	0.03
496	300438	鹏辉能源	200	9,608.00	0.03
497	300558	贝达药业	200	9,606.00	0.03
498	002500	山西证券	1,720	9,597.60	0.03
499	000401	冀东水泥	1,300	9,581.00	0.03
500	002138	顺络电子	400	9,564.00	0.03
501	002176	江特电机	800	9,536.00	0.03
502	000830	鲁西化工	900	9,504.00	0.03
503	600258	首旅酒店	500	9,475.00	0.03
504	002487	大金重工	300	9,252.00	0.03
505	000998	隆平高科	600	9,210.00	0.03
506	002408	齐翔腾达	1,400	8,918.00	0.03
507	601666	平煤股份	1,100	8,294.00	0.03
508	603866	桃李面包	802	8,116.24	0.03
509	600338	西藏珠峰	400	7,304.00	0.02
510	600885	宏发股份	220	7,007.00	0.02
511	002192	融捷股份	100	6,683.00	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

本基金本报告期末未持有积极部分的股票投资。

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	002594	比亚迪	1,041,421.00	2.30
2	300750	宁德时代	850,550.00	1.88
3	600519	贵州茅台	841,116.00	1.86
4	601318	中国平安	475,703.00	1.05
5	600900	长江电力	385,758.00	0.85
6	600036	招商银行	346,080.00	0.76
7	601288	农业银行	318,152.00	0.70
8	600436	片仔癀	302,889.00	0.67

9	600030	中信证券	270,841.00	0.60
10	601398	工商银行	260,020.00	0.57
11	600276	恒瑞医药	254,423.00	0.56
12	601888	中国中免	252,046.00	0.56
13	601166	兴业银行	242,773.00	0.54
14	603259	药明康德	242,277.00	0.54
15	000858	五粮液	240,932.00	0.53
16	600000	浦发银行	235,964.00	0.52
17	000001	平安银行	206,370.00	0.46
18	002352	顺丰控股	203,243.00	0.45
19	601328	交通银行	195,102.00	0.43
20	601088	中国神华	165,491.00	0.37

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	600519	贵州茅台	1,382,363.00	3.05
2	300750	宁德时代	1,369,310.00	3.03
3	600036	招商银行	908,310.00	2.01
4	002594	比亚迪	800,099.00	1.77
5	600900	长江电力	583,422.00	1.29
6	601318	中国平安	528,615.00	1.17
7	300760	迈瑞医疗	519,362.00	1.15
8	601888	中国中免	437,126.00	0.97
9	601398	工商银行	426,170.00	0.94
10	603259	药明康德	415,796.00	0.92
11	000858	五粮液	413,723.00	0.91
12	601166	兴业银行	401,107.00	0.89
13	600276	恒瑞医药	398,230.00	0.88
14	002475	立讯精密	377,576.40	0.83
15	601288	农业银行	371,010.00	0.82
16	002352	顺丰控股	356,458.00	0.79
17	000001	平安银行	344,447.00	0.76
18	601012	隆基绿能	339,261.00	0.75
19	600030	中信证券	319,848.00	0.71
20	601328	交通银行	310,564.00	0.69

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	23,961,407.71
卖出股票收入（成交）总额	36,471,557.69

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

华宝 MSCI ESG 指数截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，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。

华宝 MSCI ESG 指数截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司因信贷业务违规，违反审慎经营规则，内部管理与控制制度不健全或执行监督不力，内控管理未形成有效风险控制；于 2022 年 09 月 09 日收到银保监会罚款的处罚措施。

华宝 MSCI ESG 指数截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司因存款业务违规，违规办理同业业务，内部管理与控制制度不健全或执行监督不力，触犯法律法规；于 2022 年 09 月 28 日收到银保监会罚款的处罚措施。

华宝 MSCI ESG 指数截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国农业银行股份有限公司因存款业务违规,内部管理与控制制度不健全或执行监督不力,内控管理未形成有效风险控制于 2022 年 09 月 30 日收到银保监会罚款的处罚措施。

华宝 MSCI ESG 指数截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,招商银行股份有限公司因:一是多期债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销,个别债务融资工具挤占了其他投资人的正常投标,违背了公平公正原则,并影响了发行利率。二是低价包销多期债务融资工具,影响了市场正常秩序。三是债务融资工具承销协议的签订不规范。四是多期债务融资工具的簿记建档利率区间未在充分询价基础上形成,发行工作程序执行不到位、工作开展不规范;于 2023 年 01 月 18 日收到中国银行间市场交易商协会警告,责令改正的处罚措施。

华宝 MSCI ESG 指数截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国工商银行股份有限公司因主承销的多期债务融资工具发行定价严重偏离市场合理水平,干扰了市场秩序,涉嫌违反银行间债券市场自律管理相关规定;于 2023 年 04 月 04 日收到中国银行间市场交易商协会立案调查的处罚措施。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,013.97
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,755.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,769.27

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

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

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	4,034	6,280.75	16,116,812.53	63.61	9,219,734.15	36.39
华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数 (LOF) C	207	3,061.37	-	-	633,703.00	100.00
合计	4,241	6,123.61	16,116,812.53	62.06	9,853,437.15	37.94

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	广发证券股份有限公司	611,292.00	36.50
2	郑宏	363,149.00	21.69
3	黄铄婷	169,755.00	10.14
4	钱中明	59,037.00	3.53
5	蒙以贤	57,349.00	3.42
6	郑崇	45,911.00	2.74
7	罗兰琦	42,319.00	2.53
8	杨哲尧	30,000.00	1.79
9	粟盈明	29,983.00	1.79
10	余楠	29,200.00	1.74

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	1,552.60	0.0061
	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 指数（LOF）C	0.00	0.0000
	合计	1,552.60	0.0060

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、基金投资和相关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	32,842,313.78	3,672,034.26
本报告期基金总申购份额	4,445,641.49	16,915,722.41
减：本报告期基金总赎回份额	11,951,408.59	19,954,053.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	25,336,546.68	633,703.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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：自 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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无

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	41,113,837.98	68.26	38,136.00	68.26	-
东方财富	2	8,155,034.15	13.54	7,595.34	13.60	-
南京证券	1	5,604,182.57	9.30	5,163.20	9.24	-

海通证券	1	3,222,273.83	5.35	3,001.14	5.37	-
安信证券	1	2,137,628.47	3.55	1,969.38	3.53	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
星展证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
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，能为本基金提供全面的信息服；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. 本期交易单元未发生变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF) 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2023-01-19

2	华宝基金管理有限公司关于华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF) A 类基金份额 (场外份额) 在直销渠道开展赎回费率优惠活动的公告	基金管理人网站, 证券时报	2023-03-04
3	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	基金管理人网站	2023-03-31
4	关于华宝现金宝货币基金 E 类份额转换、赎回转申购、定期转换、定期赎回转申购业务费率优惠公告	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	2023-04-18
5	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-19
6	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-22
7	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF) 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2023-04-23
8	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司 (银银平台) 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	2023-04-26
9	华宝基金关于旗下部分基金新增麦高证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-08
10	华宝基金关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售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	2023-05-10
11	华宝基金关于旗下部分基金新增西部证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-06-16
12	华宝基金关于旗下部分基金新增德邦证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-06-29

§ 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	20230101~20230630	9,999,450.00	0.00	0.00	9,999,450.00	38.50
	2	20230529~20230606	0.00	12,650,411.54	12,650,411.54	0.00	0.00
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 中国证监会批准基金设立的文件；
- 华宝 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

2023 年 8 月 31 日