

华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数
证券投资基金（LOF）
2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 27 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。本半年度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 2021 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 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	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 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真实、准确和完整发表意见	14
§ 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 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
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	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54

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	54
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	54
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12	投资组合报告附注	54
§ 8	基金份额持有人信息	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2	期末上市基金前十名持有人	56
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9	开放式基金份额变动	57
§ 10	重大事件揭示	57
10.1	基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4	基金投资策略的改变	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8	其他重大事件	60
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
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	63

§ 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	25,896,965.41 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

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	<p>本基金主要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。</p> <p>1、组合复制策略 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。</p> <p>2、替代性策略 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。</p> <p>3、债券投资策略 本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的同时有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变动走势，并利用债券定价技术，进行个券选择。</p> <p>4、资产支持证券投资策略 本基金将通过宏观经济、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同，控制信用风险和流动性风险的前提下，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>5、股指期货投资策略</p>

	<p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。</p> <p>6、融资及转融通投资策略</p> <p>本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通业务。本基金将根据市场情况和组合风险收益，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务的法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p> <p>7、其他金融工具投资策略</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品，基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标，在履行适当程序后制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。</p>
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、 021-38924558	95588
传真		021-38505777	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		XIAOYI HELEN HUANG	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人	北京市西城区太平桥大街 17 号、中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	2,282,056.84
本期利润	2,040,320.32
加权平均基金份额本期利润	0.0842
本期加权平均净值利润率	5.58%
本期基金份额净值增长率	5.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	10,601,661.27
期末可供分配基金份额利润	0.4094
期末基金资产净值	40,365,182.71
期末基金份额净值	1.5587
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	55.87%

注：1、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。

2、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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、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。

4、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）。

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

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	0.10%	0.78%	-0.60%	0.78%	0.70%	0.00%

过去三个月	7.68%	0.90%	6.29%	0.91%	1.39%	-0.01%
过去六个月	5.33%	1.21%	3.54%	1.22%	1.79%	-0.01%
过去一年	33.50%	1.23%	28.28%	1.25%	5.22%	-0.02%
过去三年	-%	-%	-%	-%	-%	-%
自基金合同生效起至今	55.87%	1.20%	42.00%	1.21%	13.87%	-0.01%

注：1、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）。

2、本基金业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数*95%+人民币银行活期存款利率(税后)*5%。

3、本基金成立于 2019 年 8 月 21 日。

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



注：按照基金合同规定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2020 年 2 月 21 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.3 其他指标

无

§ 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与美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.），持有股权占比分别为 51%和 49%。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（2021 年 6 月 30 日），本公司正在管理运作的证券投资基金包括：华宝宝康债券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合混合型证券投资基金、华宝先进成长混合型证券投资基金、华宝行业精选混合型证券投资基金、华宝海外中国成长混合型证券投资基金、华宝大盘精选混合型证券投资基金、华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝中证 100 指数证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)、华宝资源优选混合型证券投资基金、华宝现金添益交易型货币市场基金、华宝创新优选混合型证券投资基金、华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金(LOF)、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝浮动净值型发起式货币市场基金、华宝致远混合型证券投资基金（QDII）、华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）等共 108 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		
张放	本基金	2021 年 3	-	9 年	硕士。曾在海通期货股份有限公司、长江

	基金经 理	月 8 日			证券股份有限公司从事分析研究工作。2014 年加入华宝基金管理有限公司，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。
胡洁	本基金 基金经 理、指 数研发 投资部 总经理	2019 年 8 月 21 日	-	14 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、产品开发和量化投资部工作，现任指数研发投资部总经理。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。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。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。2015 年 5 月至 2021 年 1 月任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理。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 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。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)、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 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 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。
张放	本基金的基金经理助理，华宝 MSCI ESG 指数、华宝中证智能制造主题 ETF、华宝大数据 ETF 基金经理	2019 年 9 月 2 日	2021 年 3 月 8 日	9 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 年加入华宝基金管理有限公司，担任投资经理、基金经理助理等职务。2019 年 9 月至 2021 年 3 月任华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）基金经理助理。2019 年 10 月至 2020 年 11 月任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2019 年 12 月起任华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）基金经理助理。2020 年 6 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、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助理。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 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。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

2021 上半年，全球经济共振复苏是主基调，在疫苗接种加速推进、各国相继推出大规模刺激性财政和货币政策等诸多因素的带动下，上半年全球经济总体恢复势头良好。今年作为“十四五”的开局之年，随着“十四五”规划的正式编制和落地，政策方向逐步明朗，有望注入新的动力。

市场方面，在新能源、新材料等主题板块的带领下，市场环境整体向好。上半年的行情大致可以分为三段，春节前以“茅 20”为代表的白马股表现非常强势，春节后市场出现了短暂而强烈的风格切换，白马股集体出现回调，而以钢铁为代表的周期型价值股则表现强势。二季度，新能源、新材料等概念板块逐渐成为带领市场上涨的主要动力，市场风格再次向成长股切换。本报告期内，作为大盘蓝筹股代表的中证 100 指数和沪深 300 指数分别下跌了 2.85%和上涨了 0.24%；而作为成长股代表的中证 1000 指数和创业板指数分别上涨了 6.58%和 17.22%。在本报告期内，MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数累计上涨了 3.67%。

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

本报告期基金份额净值增长率为 5.33%，业绩比较基准收益率为 3.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济与市场方面，展望 2021 下半年，全球经济复苏的态势或将延续，但与此同时全球范

国内的疫情反复仍不容忽视。国内货币政策“稳中趋松”，消费与投资支撑经济的韧性仍在，科技创新和消费升级仍然是国内经济关注的焦点。证券市场方面，目前市场整体稳中向好，但波动在增加，板块之间的分化较为明显，未来结构性行情或将延续。

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。随着中国经济的发展，政策的改变以及资本市场的开放，ESG 投资在中国受到了更多的关注。今年两会上，“碳达峰、碳中和”被首次写入政府工作报告，绿色投资、低碳经济等也受到更高的关注。此外，该指数聚焦了中国核心资产，包括金融、消费、房地产、信息技术、工业等板块，组合风险分散，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。

（1）日常估值流程

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

（2）特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度，

对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况，量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金基金合同于 2019 年 8 月 21 日生效，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，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，本基金托管人在对华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金(LOF)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，华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）的管理人——华宝基金管理有限公司在华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

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华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）2021 半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 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,712,890.62	2,416,040.19
结算备付金		35,328.60	2,424.37
存出保证金		2,434.91	4,589.54
交易性金融资产	6.4.7.2	38,195,947.53	32,011,085.60
其中：股票投资		38,195,947.53	32,011,085.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		73,590.80	19,732.26
应收利息	6.4.7.5	281.22	262.49
应收股利		-	-
应收申购款		6,448.69	29,444.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		41,026,922.37	34,483,578.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		303,455.02	156,302.19
应付管理人报酬		16,509.35	13,732.70
应付托管费		3,301.86	2,746.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	202,456.35	257,658.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	136,017.08	175,806.58
负债合计		661,739.66	606,246.86
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	25,896,965.41	22,892,553.92
未分配利润	6.4.7.10	14,468,217.30	10,984,777.70
所有者权益合计		40,365,182.71	33,877,331.62
负债和所有者权益总计		41,026,922.37	34,483,578.48

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5587 元，基金份额总额 25,896,965.41 份。

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		2,283,308.59	4,351,868.25
1. 利息收入		4,738.83	14,311.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,738.83	14,311.25
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）		2,512,540.85	7,503,270.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,248,798.99	7,126,388.10
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	263,741.86	376,882.24
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-241,736.52	-3,266,480.38

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,765.43	100,767.04
减：二、费用		242,988.27	531,111.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	90,714.64	144,866.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	18,142.90	28,973.36
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	33,175.55	199,083.85
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	100,955.18	158,187.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,040,320.32	3,820,756.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,040,320.32	3,820,756.61

6.3 所有者权益（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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	22,892,553.92	10,984,777.70	33,877,331.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,040,320.32	2,040,320.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,004,411.49	1,443,119.28	4,447,530.77
其中：1. 基金申购款	9,857,710.44	5,048,760.36	14,906,470.80
2. 基金	-6,853,298.95	-3,605,641.08	-10,458,940.03

赎回款			
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	25,896,965.41	14,468,217.30	40,365,182.71
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	115,267,519.83	8,721,943.48	123,989,463.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,820,756.61	3,820,756.61
三、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）	-81,876,588.42	-6,945,033.13	-88,821,621.55
其中：1. 基金申购款	4,262,471.73	340,012.06	4,602,483.79
2. 基金赎回款	-86,139,060.15	-7,285,045.19	-93,424,105.34
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	33,390,931.41	5,597,666.96	38,988,598.37

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：

黄小慧

向辉

张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可[2019]113 号文《关于准予华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF) 注册的批复》准予注册, 由基金管理人华宝基金管理有限公司于 2019 年 7 月 19 日至 2019 年 8 月 16 日止期间向社会公开募集, 募集期结束经德勤华永会计师事务所 (特殊普通合伙) 验证并出具德师报 (验) 字 (19) 第 00225 号验资报告后, 向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2019 年 8 月 21 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金 (本金) 为人民币 316, 782, 770.10 元, 在募集期间产生的活期存款利息为人民币 73, 536.96 元, 以上实收基金 (本息) 合计为人民币 316, 856, 306.97 元, 折合 316, 856, 306.97 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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: $\text{MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数收益率} \times 95\% + \text{人民币银行活期存款利率 (税后)} \times 5\%$

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 2021 年 8 月 27 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

会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）和在财务报表附注所示依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年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相一致。

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

无

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自 2018 年 1 月 1 日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。

(3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011 年修订)》、《征收教育费附加的暂行规定(2011 年修订)》及相关地方教育附加的征收规定,凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人,都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。

(4) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自 2004 年 1 月 1 日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运

用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(5) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	2,712,890.62
定期存款	-
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	-
合计	2,712,890.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	30,788,983.29	38,195,947.53	7,406,964.24
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	30,788,983.29	38,195,947.53	7,406,964.24

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	264.22
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	15.90
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	1.10
合计	281.22

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	202,456.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	202,456.35

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	839.40
应付证券出借违约金	-
预提费用	34,712.18
应付指数使用费	100,465.50
合计	136,017.08

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,892,553.92	22,892,553.92
本期申购	9,857,710.44	9,857,710.44
本期赎回（以“-”号填列）	-6,853,298.95	-6,853,298.95
- 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	25,896,965.41	25,896,965.41

注：申购含红利再投以及转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,237,323.05	3,747,454.65	10,984,777.70

本期利润	2,282,056.84	-241,736.52	2,040,320.32
本期基金份额交易产生的变动数	1,082,281.38	360,837.90	1,443,119.28
其中：基金申购款	3,557,559.82	1,491,200.54	5,048,760.36
基金赎回款	-2,475,278.44	-1,130,362.64	-3,605,641.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,601,661.27	3,866,556.03	14,468,217.30

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	4,556.88
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	158.10
其他	23.85
合计	4,738.83

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,248,798.99
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	2,248,798.99

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	9,705,294.81
减：卖出股票成本总额	7,456,495.82
买卖股票差价收入	2,248,798.99

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	263,741.86
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	263,741.86

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-241,736.52
股票投资	-241,736.52
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	-241,736.52

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	7,765.43
合计	7,765.43

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	33,175.55
银行间市场交易费用	-
合计	33,175.55

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	994.00
指数使用费	65,249.00
合计	100,955.18

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙 （“Warburg Pincus Asset Management, L.P.”）	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司、基金销售机构
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司（“宝武财务”）	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1.2 债券交易

无

6.4.10.1.3 债券回购交易

无

6.4.10.1.4 权证交易

无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	90,714.64	144,866.68
其中：支付销售机构的客户维护 费	19,178.63	67,914.84

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 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	18,142.90	28,973.36

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 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

本基金本报告期末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均未发生转融通证券出借业务。

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

无

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	38.61	9,999,450.00	43.6800

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	2,712,890.62	4,556.88	2,739,620.25	13,730.82

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

本基金本报告期未发生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）7,4000.00 股，期末公允价值为人民币 382,580.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.95%。

除以上情况外，无其他需要说明的关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

6.4.12 期末(2021 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	可流通日	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
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	31.56	31.56	262	8,268.72	8,268.72	-

注：：1. 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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2. 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，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。

6.4.12.2 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
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	22,200	213,846.52	124,098.00	-
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	800	14,786.74	45,080.00	-

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，本基金无债券投资。（上年度末：同）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量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等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,712,890.62	-	-	-	2,712,890.62
结算备付金	35,328.60	-	-	-	35,328.60
存出保证金	2,434.91	-	-	-	2,434.91
交易性金融资产	-	-	-	38,195,947.53	38,195,947.53
应收利息	-	-	-	281.22	281.22
应收申购款	-	-	-	6,448.69	6,448.69
应收证券清算款	-	-	-	73,590.80	73,590.80
资产总计	2,750,654.13	-	-	38,276,268.24	41,026,922.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	303,455.02	303,455.02
应付管理人报酬	-	-	-	16,509.35	16,509.35
应付托管费	-	-	-	3,301.86	3,301.86
应付交易费用	-	-	-	202,456.35	202,456.35
其他负债	-	-	-	136,017.08	136,017.08
负债总计	-	-	-	661,739.66	661,739.66
利率敏感度缺口	2,750,654.13	-	-	37,614,528.58	40,365,182.71
上年度末 2020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	2,416,040.19	-	-	-	2,416,040.19
结算备付金	2,424.37	-	-	-	2,424.37
存出保证金	4,589.54	-	-	-	4,589.54
交易性金融资产	-	-	-	32,011,085.60	32,011,085.60
应收利息	-	-	-	262.49	262.49
应收申购款	3.00	-	-	29,441.03	29,444.03
应收证券清算款	-	-	-	19,732.26	19,732.26
资产总计	2,423,057.10	-	-	32,060,521.38	34,483,578.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	156,302.19	156,302.19
应付管理人报酬	-	-	-	13,732.70	13,732.70
应付托管费	-	-	-	2,746.51	2,746.51
应付交易费用	-	-	-	257,658.88	257,658.88
其他负债	-	-	-	175,806.58	175,806.58
负债总计	-	-	-	606,246.86	606,246.86
利率敏感度缺口	2,423,057.10	-	-	31,454,274.52	33,877,331.62

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	38,195,947.53	94.63	32,011,085.60	94.49
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	38,195,947.53	94.63	32,011,085.60	94.49

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	1,994,239.52	1,688,896.27
	2. 业绩比较基准下降 5%	-1,994,239.52	-1,688,896.27

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证券清算款、应收利息、应收申购款以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，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中属于第一层次的余额为人民币 38,018,500.81 元，第二层次的余额为人民币 177,446.72 元，无划分为第三层次的余额（于上年度末，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中属于第一层次的余额为人民币 31,994,666.24 元，第二层次的余额为人民币 16,419.36 元，无划分为第三层次的余额）。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

§ 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	38,195,947.53	93.10
	其中：股票	38,195,947.53	93.10
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	2,748,219.22	6.70
8	其他各项资产	82,755.62	0.20
9	合计	41,026,922.37	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	289,392.36	0.72
B	采矿业	686,258.40	1.70
C	制造业	20,691,961.22	51.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	515,776.80	1.28
E	建筑业	390,218.50	0.97
F	批发和零售业	579,432.80	1.44
G	交通运输、仓储和邮政业	927,356.40	2.30
H	住宿和餐饮业	28,475.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,253,517.90	3.11
J	金融业	9,584,872.56	23.75
K	房地产业	931,217.40	2.31
L	租赁和商务服务业	856,088.00	2.12
M	科学研究和技术服务业	554,963.56	1.37
N	水利、环境和公共设施管理业	13,889.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	27,157.00	0.07
Q	卫生和社会工作	608,496.50	1.51
R	文化、体育和娱乐业	210,443.00	0.52
S	综合	-	-
	合计	38,149,516.40	94.51

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	9,036.37	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,797.20	0.01
E	建筑业	8,268.72	0.02
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	6,835.20	0.02
J	金融业	19,493.64	0.05
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	46,431.13	0.12

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	300750	宁德时代	3,400	1,818,320.00	4.50
2	600519	贵州茅台	700	1,439,690.00	3.57
3	600036	招商银行	24,300	1,316,817.00	3.26
4	601318	中国平安	15,921	1,023,401.88	2.54
5	601888	中国中免	2,300	690,230.00	1.71
6	000858	五粮液	2,300	685,147.00	1.70
7	601012	隆基股份	6,200	550,808.00	1.36

8	300760	迈瑞医疗	1,100	528,055.00	1.31
9	002594	比亚迪	2,100	527,100.00	1.31
10	000001	平安银行	22,800	515,736.00	1.28
11	601166	兴业银行	24,400	501,420.00	1.24
12	002304	洋河股份	2,200	455,840.00	1.13
13	300274	阳光电源	3,400	391,204.00	0.97
14	601398	工商银行	74,000	382,580.00	0.95
15	603259	药明康德	2,284	357,651.56	0.89
16	600000	浦发银行	34,500	345,000.00	0.85
17	002142	宁波银行	8,800	342,936.00	0.85
18	601288	农业银行	109,500	331,785.00	0.82
19	603288	海天味业	2,542	327,790.90	0.81
20	600887	伊利股份	8,900	327,787.00	0.81
21	600030	中信证券	12,500	311,750.00	0.77
22	000333	美的集团	4,100	292,617.00	0.72
23	600900	长江电力	13,400	276,576.00	0.69
24	000002	万科 A	11,400	271,434.00	0.67
25	600276	恒瑞医药	3,772	256,382.84	0.64
26	000725	京东方 A	39,800	248,352.00	0.62
27	601601	中国太保	8,100	234,657.00	0.58
28	300014	亿纬锂能	2,222	230,932.46	0.57
29	601328	交通银行	46,200	226,380.00	0.56
30	600809	山西汾酒	500	224,000.00	0.55
31	300124	汇川技术	3,000	222,780.00	0.55
32	300015	爱尔眼科	3,125	221,812.50	0.55
33	600196	复星医药	3,000	216,390.00	0.54
34	000568	泸州老窖	900	212,346.00	0.53
35	300059	东方财富	6,072	199,100.88	0.49
36	600309	万华化学	1,800	195,876.00	0.49
37	002460	赣锋锂业	1,600	193,744.00	0.48
38	002714	牧原股份	3,138	190,853.16	0.47
39	002475	立讯精密	4,080	187,680.00	0.46
40	600016	民生银行	41,700	183,897.00	0.46
41	601818	光大银行	48,600	183,708.00	0.46
42	002352	顺丰控股	2,700	182,790.00	0.45
43	600436	片仔癀	400	179,320.00	0.44
44	002230	科大讯飞	2,600	175,708.00	0.44
45	600745	闻泰科技	1,800	174,420.00	0.43
46	601919	中远海控	5,700	174,078.00	0.43
47	300759	康龙化成	800	173,592.00	0.43
48	000538	云南白药	1,500	173,580.00	0.43
49	002241	歌尔股份	4,000	170,960.00	0.42

50	601688	华泰证券	10,800	170,640.00	0.42
51	600048	保利地产	14,100	169,764.00	0.42
52	300122	智飞生物	900	168,057.00	0.42
53	600999	招商证券	8,720	165,854.40	0.41
54	600763	通策医疗	400	164,400.00	0.41
55	600837	海通证券	14,200	163,300.00	0.40
56	603501	韦尔股份	500	161,000.00	0.40
57	601066	中信建投	5,100	160,293.00	0.40
58	600588	用友网络	4,810	159,980.60	0.40
59	603799	华友钴业	1,400	159,880.00	0.40
60	601658	邮储银行	31,300	157,126.00	0.39
61	601390	中国中铁	29,900	156,676.00	0.39
62	688185	康希诺	200	155,554.00	0.39
63	601088	中国神华	7,800	152,256.00	0.38
64	600406	国电南瑞	6,500	151,060.00	0.37
65	600031	三一重工	5,000	145,350.00	0.36
66	600570	恒生电子	1,550	144,537.50	0.36
67	300413	芒果超媒	2,100	144,060.00	0.36
68	601633	长城汽车	3,300	143,847.00	0.36
69	600438	通威股份	3,300	142,791.00	0.35
70	601229	上海银行	16,700	136,940.00	0.34
71	000625	长安汽车	5,200	136,656.00	0.34
72	600660	福耀玻璃	2,400	134,040.00	0.33
73	300454	深信服	500	129,740.00	0.32
74	601816	京沪高铁	24,100	127,489.00	0.32
75	601988	中国银行	41,300	127,204.00	0.32
76	000100	TCL 科技	16,500	126,225.00	0.31
77	002024	苏宁易购	22,200	124,098.00	0.31
78	601169	北京银行	24,900	121,263.00	0.30
79	002812	恩捷股份	500	117,050.00	0.29
80	300347	泰格医药	600	115,980.00	0.29
81	601668	中国建筑	24,730	114,994.50	0.28
82	300408	三环集团	2,700	114,534.00	0.28
83	601628	中国人寿	3,300	111,837.00	0.28
84	002821	凯莱英	300	111,780.00	0.28
85	603659	璞泰来	800	109,280.00	0.27
86	603993	洛阳钼业	20,800	107,328.00	0.27
87	601877	正泰电器	3,200	106,816.00	0.26
88	000776	广发证券	7,000	105,980.00	0.26
89	300529	健帆生物	1,210	104,495.60	0.26
90	002493	荣盛石化	6,000	103,620.00	0.26
91	600926	杭州银行	7,000	103,250.00	0.26

92	001979	招商蛇口	9,300	101,835.00	0.25
93	600104	上汽集团	4,600	101,062.00	0.25
94	600019	宝钢股份	13,100	100,084.00	0.25
95	002841	视源股份	800	99,432.00	0.25
96	600585	海螺水泥	2,400	98,520.00	0.24
97	002202	金风科技	8,100	98,496.00	0.24
98	600584	长电科技	2,600	97,968.00	0.24
99	002311	海大集团	1,200	97,920.00	0.24
100	600690	海尔智家	3,700	95,867.00	0.24
101	601377	兴业证券	9,800	94,668.00	0.23
102	601939	建设银行	14,100	93,765.00	0.23
103	600015	华夏银行	15,100	93,469.00	0.23
104	000063	中兴通讯	2,800	93,044.00	0.23
105	600600	青岛啤酒	800	92,520.00	0.23
106	600346	恒力石化	3,500	91,840.00	0.23
107	601901	方正证券	9,700	90,792.00	0.22
108	600029	南方航空	15,000	90,300.00	0.22
109	601799	星宇股份	400	90,288.00	0.22
110	300782	卓胜微	160	86,000.00	0.21
111	300433	蓝思科技	2,900	85,289.00	0.21
112	600893	航发动力	1,600	85,104.00	0.21
113	600115	中国东航	16,500	83,820.00	0.21
114	600703	三安光电	2,600	83,330.00	0.21
115	002371	北方华创	300	83,214.00	0.21
116	300595	欧普康视	800	82,840.00	0.21
117	601788	光大证券	4,600	82,294.00	0.20
118	600028	中国石化	18,700	81,532.00	0.20
119	002027	分众传媒	8,600	80,926.00	0.20
120	603882	金域医学	500	79,885.00	0.20
121	601916	浙商银行	19,700	78,209.00	0.19
122	000661	长春高新	200	77,400.00	0.19
123	000157	中联重科	8,300	76,692.00	0.19
124	601111	中国国航	9,800	76,244.00	0.19
125	603345	安井食品	300	76,206.00	0.19
126	601211	国泰君安	4,400	75,416.00	0.19
127	603737	三棵树	420	73,920.00	0.18
128	300285	国瓷材料	1,500	73,125.00	0.18
129	600176	中国巨石	4,686	72,679.86	0.18
130	000938	紫光股份	3,320	72,641.60	0.18
131	000069	华侨城 A	9,600	71,424.00	0.18
132	600332	白云山	2,100	71,085.00	0.18
133	600958	东方证券	7,000	69,930.00	0.17

134	601225	陕西煤业	5,900	69,915.00	0.17
135	002129	中环股份	1,800	69,480.00	0.17
136	000963	华东医药	1,500	69,015.00	0.17
137	603986	兆易创新	364	68,395.60	0.17
138	601360	三六零	5,600	68,376.00	0.17
139	601881	中国银河	6,300	67,914.00	0.17
140	603899	晨光文具	800	67,648.00	0.17
141	601857	中国石油	12,700	67,183.00	0.17
142	601138	工业富联	5,400	67,014.00	0.17
143	000895	双汇发展	2,100	66,780.00	0.17
144	601727	上海电气	15,700	66,568.00	0.16
145	002074	国轩高科	1,500	65,340.00	0.16
146	601100	恒立液压	736	63,237.12	0.16
147	600183	生益科技	2,700	63,207.00	0.16
148	002353	杰瑞股份	1,400	62,580.00	0.16
149	000338	潍柴动力	3,500	62,545.00	0.15
150	300146	汤臣倍健	1,900	62,510.00	0.15
151	000166	申万宏源	13,300	62,244.00	0.15
152	601009	南京银行	5,900	62,068.00	0.15
153	600919	江苏银行	8,700	61,770.00	0.15
154	002049	紫光国微	400	61,676.00	0.15
155	601995	中金公司	1,000	61,500.00	0.15
156	688009	中国通号	10,640	60,541.60	0.15
157	002555	三七互娱	2,500	60,050.00	0.15
158	300601	康泰生物	400	59,600.00	0.15
159	300999	金龙鱼	700	59,472.00	0.15
160	600132	重庆啤酒	300	59,385.00	0.15
161	000783	长江证券	8,100	59,292.00	0.15
162	600760	中航沈飞	980	59,094.00	0.15
163	600704	物产中大	7,400	58,238.00	0.14
164	601878	浙商证券	4,300	56,244.00	0.14
165	600109	国金证券	4,400	55,836.00	0.14
166	300142	沃森生物	900	55,530.00	0.14
167	601989	中国重工	13,400	55,208.00	0.14
168	601336	新华保险	1,200	55,092.00	0.14
169	600298	安琪酵母	1,000	54,380.00	0.13
170	601155	新城控股	1,300	54,080.00	0.13
171	300498	温氏股份	3,760	54,031.20	0.13
172	000027	深圳能源	5,840	53,552.80	0.13
173	002709	天赐材料	500	53,290.00	0.13
174	600674	川投能源	4,300	53,019.00	0.13
175	603806	福斯特	500	52,565.00	0.13

176	002603	以岭药业	1,800	52,488.00	0.13
177	002625	光启技术	2,500	52,025.00	0.13
178	600606	绿地控股	9,500	51,775.00	0.13
179	000799	酒鬼酒	200	51,120.00	0.13
180	002050	三花智控	2,110	50,597.80	0.13
181	300677	英科医疗	400	49,920.00	0.12
182	600741	华域汽车	1,900	49,913.00	0.12
183	601162	天风证券	10,200	49,572.00	0.12
184	002294	信立泰	1,500	49,350.00	0.12
185	601607	上海医药	2,300	48,599.00	0.12
186	603456	九洲药业	1,000	48,580.00	0.12
187	000596	古井贡酒	200	47,900.00	0.12
188	002179	中航光电	600	47,412.00	0.12
189	603707	健友股份	1,120	46,760.00	0.12
190	300628	亿联网络	550	46,090.00	0.11
191	600460	士兰微	800	45,080.00	0.11
192	000513	丽珠集团	900	45,018.00	0.11
193	600522	中天科技	4,500	45,000.00	0.11
194	002601	龙佰集团	1,300	44,954.00	0.11
195	002001	新和成	1,560	44,740.80	0.11
196	601108	财通证券	4,200	44,058.00	0.11
197	603939	益丰药房	780	43,750.20	0.11
198	002673	西部证券	5,300	43,725.00	0.11
199	601985	中国核电	8,600	43,516.00	0.11
200	600111	北方稀土	2,100	43,470.00	0.11
201	600998	九州通	2,800	43,036.00	0.11
202	600150	中国船舶	2,600	42,926.00	0.11
203	300482	万孚生物	660	42,695.40	0.11
204	000768	中航西飞	1,600	42,048.00	0.10
205	600010	包钢股份	26,800	41,540.00	0.10
206	601319	中国人保	7,000	41,510.00	0.10
207	601077	渝农商行	10,400	41,496.00	0.10
208	000739	普洛药业	1,400	41,160.00	0.10
209	002736	国信证券	3,800	40,850.00	0.10
210	601600	中国铝业	7,700	40,810.00	0.10
211	600547	山东黄金	2,120	40,746.40	0.10
212	300316	晶盛机电	800	40,400.00	0.10
213	002007	华兰生物	1,100	40,348.00	0.10
214	601021	春秋航空	700	39,830.00	0.10
215	600380	健康元	2,900	39,817.00	0.10
216	002568	百润股份	420	39,811.80	0.10
217	603833	欧派家居	280	39,748.80	0.10

218	000876	新希望	2,700	39,609.00	0.10
219	600886	国投电力	4,100	39,401.00	0.10
220	600426	华鲁恒升	1,270	39,306.50	0.10
221	002372	伟星新材	1,900	39,273.00	0.10
222	002340	格林美	4,200	39,270.00	0.10
223	000786	北新建材	1,000	39,250.00	0.10
224	603160	汇顶科技	300	38,889.00	0.10
225	002791	坚朗五金	200	38,810.00	0.10
226	002414	高德红外	1,402	38,667.16	0.10
227	002600	领益智造	4,200	38,598.00	0.10
228	300144	宋城演艺	2,280	38,304.00	0.09
229	002236	大华股份	1,800	37,980.00	0.09
230	000860	顺鑫农业	900	37,962.00	0.09
231	603369	今世缘	700	37,912.00	0.09
232	300661	圣邦股份	150	37,909.50	0.09
233	600779	水井坊	300	37,905.00	0.09
234	002010	传化智联	4,900	37,779.00	0.09
235	600739	辽宁成大	1,800	37,458.00	0.09
236	000999	华润三九	1,400	37,450.00	0.09
237	002508	老板电器	800	37,200.00	0.09
238	601231	环旭电子	2,200	36,982.00	0.09
239	600521	华海药业	1,750	36,540.00	0.09
240	000656	金科股份	6,300	36,477.00	0.09
241	300450	先导智能	600	36,084.00	0.09
242	000547	航天发展	1,900	35,853.00	0.09
243	603185	上机数控	200	35,790.00	0.09
244	601966	玲珑轮胎	800	34,992.00	0.09
245	002797	第一创业	4,900	34,986.00	0.09
246	601669	中国电建	9,000	34,830.00	0.09
247	600848	上海临港	1,920	34,368.00	0.09
248	601099	太平洋	10,000	33,900.00	0.08
249	300033	同花顺	300	33,834.00	0.08
250	603517	绝味食品	400	33,716.00	0.08
251	600415	小商品城	6,500	33,475.00	0.08
252	300383	光环新网	2,300	33,097.00	0.08
253	601992	金隅集团	12,300	33,087.00	0.08
254	600845	宝信软件	650	33,085.00	0.08
255	600352	浙江龙盛	2,400	32,976.00	0.08
256	600066	宇通客车	2,600	32,474.00	0.08
257	600061	国投资本	3,800	32,262.00	0.08
258	300003	乐普医疗	1,000	32,120.00	0.08
259	002032	苏泊尔	500	31,895.00	0.08

260	300496	中科创达	200	31,412.00	0.08
261	601233	桐昆股份	1,300	31,317.00	0.08
262	600143	金发科技	1,500	31,290.00	0.08
262	601618	中国中冶	10,500	31,290.00	0.08
263	300253	卫宁健康	1,910	31,075.70	0.08
264	603816	顾家家居	400	30,912.00	0.08
265	300223	北京君正	300	30,276.00	0.08
266	002252	上海莱士	4,000	29,960.00	0.07
267	002926	华西证券	3,100	29,853.00	0.07
268	603218	日月股份	1,100	29,788.00	0.07
269	600511	国药股份	900	29,754.00	0.07
270	002459	晶澳科技	600	29,400.00	0.07
271	300207	欣旺达	900	29,304.00	0.07
272	000425	徐工机械	4,600	29,302.00	0.07
273	601456	国联证券	1,900	29,260.00	0.07
274	002242	九阳股份	900	29,241.00	0.07
275	002925	盈趣科技	750	29,182.50	0.07
276	002916	深南电路	260	28,893.80	0.07
277	000423	东阿阿胶	800	28,728.00	0.07
278	600754	锦江酒店	500	28,475.00	0.07
279	600079	人福医药	1,000	28,270.00	0.07
279	600089	特变电工	2,200	28,270.00	0.07
280	002602	世纪华通	4,400	28,248.00	0.07
281	000987	越秀金控	2,200	27,852.00	0.07
282	600383	金地集团	2,700	27,648.00	0.07
283	002624	完美世界	1,150	27,496.50	0.07
284	603658	安图生物	360	27,277.20	0.07
285	002153	石基信息	1,160	27,271.60	0.07
286	002607	中公教育	1,300	27,157.00	0.07
287	603589	口子窖	400	27,076.00	0.07
288	600362	江西铜业	1,200	26,856.00	0.07
289	601838	成都银行	2,100	26,544.00	0.07
290	601933	永辉超市	5,600	26,488.00	0.07
291	002044	美年健康	2,900	26,419.00	0.07
292	601598	中国外运	5,200	26,260.00	0.07
293	002705	新宝股份	1,000	26,250.00	0.07
294	600018	上港集团	5,500	26,235.00	0.06
295	002080	中材科技	1,000	26,170.00	0.06
296	600161	天坛生物	760	26,030.00	0.06
297	002557	洽洽食品	600	25,860.00	0.06
298	002151	北斗星通	600	25,842.00	0.06
299	600699	均胜电子	1,000	25,520.00	0.06

300	000825	太钢不锈	3,400	25,466.00	0.06
301	000703	恒逸石化	2,130	25,453.50	0.06
302	601216	君正集团	5,000	25,450.00	0.06
303	601117	中国化学	2,900	25,404.00	0.06
304	600219	南山铝业	7,000	25,200.00	0.06
305	600885	宏发股份	400	25,080.00	0.06
306	600489	中金黄金	2,900	24,998.00	0.06
307	688008	澜起科技	400	24,952.00	0.06
308	000066	中国长城	1,700	24,820.00	0.06
309	002185	华天科技	1,600	24,624.00	0.06
309	600862	中航高科	800	24,624.00	0.06
310	603233	大参林	480	24,532.80	0.06
311	603883	老百姓	460	24,232.80	0.06
312	600498	烽火通信	1,300	24,219.00	0.06
313	600009	上海机场	500	24,065.00	0.06
314	600315	上海家化	400	24,056.00	0.06
315	002399	海普瑞	1,500	23,895.00	0.06
316	000932	华菱钢铁	3,600	23,760.00	0.06
317	300676	华大基因	200	23,720.00	0.06
318	000977	浪潮信息	840	23,629.20	0.06
319	688002	睿创微纳	236	23,559.88	0.06
320	600583	海油工程	5,200	23,400.00	0.06
321	002373	千方科技	1,400	23,380.00	0.06
322	300724	捷佳伟创	200	23,202.00	0.06
323	002013	中航机电	2,300	23,161.00	0.06
324	601990	南京证券	2,200	23,144.00	0.06
325	600188	兖州煤业	1,500	23,040.00	0.06
326	002223	鱼跃医疗	600	22,878.00	0.06
327	300699	光威复材	300	22,785.00	0.06
328	600536	中国软件	400	22,772.00	0.06
329	002120	韵达股份	1,680	22,730.40	0.06
330	601689	拓普集团	600	22,458.00	0.06
331	600486	扬农化工	200	22,354.00	0.06
332	002690	美亚光电	400	22,304.00	0.06
333	601872	招商轮船	4,800	22,176.00	0.05
334	002511	中顺洁柔	800	22,040.00	0.05
335	600655	豫园股份	1,900	22,021.00	0.05
336	002422	科伦药业	1,100	21,945.00	0.05
337	300558	贝达药业	200	21,648.00	0.05
338	002157	正邦科技	1,800	21,510.00	0.05
339	601699	潞安环能	1,800	21,258.00	0.05
340	600872	中炬高新	500	21,010.00	0.05

341	002384	东山精密	1,000	20,840.00	0.05
342	001914	招商积余	1,200	20,616.00	0.05
343	000728	国元证券	2,560	20,403.20	0.05
344	600705	中航产融	5,200	20,124.00	0.05
345	002078	太阳纸业	1,500	20,025.00	0.05
346	300037	新宙邦	200	20,020.00	0.05
347	000050	深天马 A	1,400	19,852.00	0.05
348	601128	常熟银行	3,200	19,840.00	0.05
349	000983	山西焦煤	2,380	19,777.80	0.05
350	603638	艾迪精密	460	19,720.20	0.05
351	603605	珀莱雅	100	19,671.00	0.05
352	000800	一汽解放	1,800	19,476.00	0.05
353	002180	纳思达	600	19,320.00	0.05
354	300357	我武生物	300	19,236.00	0.05
355	002156	通富微电	800	19,232.00	0.05
356	601555	东吴证券	2,300	19,182.00	0.05
357	002405	四维图新	1,300	19,110.00	0.05
358	600233	圆通速递	1,900	19,019.00	0.05
359	600369	西南证券	3,900	18,993.00	0.05
360	000723	美锦能源	2,500	18,900.00	0.05
361	002507	涪陵榨菜	500	18,830.00	0.05
362	603338	浙江鼎力	320	18,780.80	0.05
363	300136	信维通信	600	18,528.00	0.05
364	300251	光线传媒	1,700	18,377.00	0.05
365	002152	广电运通	1,400	18,242.00	0.05
366	600372	中航电子	1,100	18,205.00	0.05
367	600011	华能国际	4,300	18,146.00	0.04
368	603712	七一二	500	18,050.00	0.04
369	600642	申能股份	2,900	17,806.00	0.04
370	600177	雅戈尔	2,700	17,793.00	0.04
371	600875	东方电气	1,600	17,552.00	0.04
372	601198	东兴证券	1,600	17,488.00	0.04
373	000021	深科技	900	17,226.00	0.04
374	002385	大北农	2,500	17,000.00	0.04
375	002030	达安基因	800	16,992.00	0.04
376	000630	铜陵有色	6,200	16,864.00	0.04
377	002299	圣农发展	700	16,716.00	0.04
378	002939	长城证券	1,500	16,695.00	0.04
379	600516	方大炭素	2,240	16,665.60	0.04
380	600549	厦门钨业	800	16,664.00	0.04
381	600895	张江高科	900	16,443.00	0.04
382	002429	兆驰股份	2,700	16,389.00	0.04

383	603866	桃李面包	520	16,224.00	0.04
384	600038	中直股份	300	15,822.00	0.04
385	603858	步长制药	700	15,743.00	0.04
386	002563	森马服饰	1,300	15,535.00	0.04
387	002463	沪电股份	1,000	15,470.00	0.04
388	300308	中际旭创	400	15,408.00	0.04
389	000975	银泰黄金	1,620	15,406.20	0.04
390	000709	河钢股份	6,200	15,252.00	0.04
391	600988	赤峰黄金	1,000	14,990.00	0.04
392	600598	北大荒	1,000	14,960.00	0.04
393	002146	荣盛发展	2,600	14,664.00	0.04
394	000581	威孚高科	700	14,581.00	0.04
394	000738	航发控制	700	14,581.00	0.04
395	600859	王府井	500	14,440.00	0.04
396	600170	上海建工	5,200	14,352.00	0.04
397	600867	通化东宝	1,200	14,328.00	0.04
398	002065	东华软件	1,800	14,274.00	0.04
399	002500	山西证券	2,120	14,225.20	0.04
400	002456	欧菲光	1,600	14,208.00	0.04
401	002075	沙钢股份	1,300	14,183.00	0.04
402	600160	巨化股份	1,600	14,144.00	0.04
403	002958	青农商行	3,300	14,124.00	0.03
404	300773	拉卡拉	500	14,115.00	0.03
405	000988	华工科技	600	14,112.00	0.03
406	600801	华新水泥	800	14,056.00	0.03
407	300070	碧水源	1,900	13,889.00	0.03
408	002212	天融信	700	13,839.00	0.03
409	600153	建发股份	1,700	13,770.00	0.03
410	600027	华电国际	4,000	13,760.00	0.03
411	002127	南极电商	1,400	13,678.00	0.03
412	000750	国海证券	3,200	13,568.00	0.03
413	600688	上海石化	3,600	13,536.00	0.03
414	600256	广汇能源	4,000	13,320.00	0.03
415	002558	巨人网络	1,000	13,300.00	0.03
416	002465	海格通信	1,400	13,244.00	0.03
417	000961	中南建设	2,200	13,024.00	0.03
418	000998	隆平高科	800	12,832.00	0.03
419	603267	鸿远电子	100	12,792.00	0.03
420	002081	金螳螂	1,600	12,672.00	0.03
421	300463	迈克生物	300	12,627.00	0.03
422	603027	千禾味业	480	12,619.20	0.03
423	000671	阳光城	2,400	12,480.00	0.03

424	600026	中远海能	2,000	12,320.00	0.03
425	000729	燕京啤酒	1,700	12,308.00	0.03
426	000402	金融街	1,800	12,150.00	0.03
427	002019	亿帆医药	700	12,075.00	0.03
428	600879	航天电子	1,600	12,032.00	0.03
429	600340	华夏幸福	2,260	11,842.40	0.03
430	002506	协鑫集成	3,400	11,832.00	0.03
431	000686	东北证券	1,400	11,830.00	0.03
432	300296	利亚德	1,500	11,730.00	0.03
433	600909	华安证券	2,100	11,697.00	0.03
434	000629	攀钢钒钛	5,100	11,679.00	0.03
435	300088	长信科技	1,400	11,564.00	0.03
436	300418	昆仑万维	700	11,466.00	0.03
437	000540	中天金融	4,100	11,193.00	0.03
438	002683	宏大爆破	400	11,108.00	0.03
439	000623	吉林敖东	700	10,843.00	0.03
440	300212	易华录	400	10,764.00	0.03
441	000627	天茂集团	2,900	10,498.00	0.03
442	600529	山东药玻	300	10,185.00	0.03
443	000401	冀东水泥	800	9,880.00	0.02
444	601098	中南传媒	1,100	9,702.00	0.02
445	002131	利欧股份	4,000	9,360.00	0.02
446	002572	索菲亚	300	7,260.00	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

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	601528	瑞丰银行	1,252	19,493.64	0.05
2	001208	华菱线缆	1,169	9,036.37	0.02
3	605287	德才股份	262	8,268.72	0.02
4	603171	税友股份	356	6,835.20	0.02
5	605011	杭州热电	315	2,797.20	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	398,834.00	1.18
2	601318	中国平安	378,109.00	1.12
3	000333	美的集团	343,768.00	1.01
4	300750	宁德时代	341,691.86	1.01

5	300274	阳光电源	325,762.00	0.96
6	601888	中国中免	239,307.00	0.71
7	000858	五粮液	231,395.00	0.68
8	300760	迈瑞医疗	220,202.00	0.65
9	600519	贵州茅台	215,707.00	0.64
10	601166	兴业银行	193,544.00	0.57
11	603288	海天味业	175,497.00	0.52
12	000001	平安银行	156,027.80	0.46
13	300759	康龙化成	148,991.00	0.44
14	601398	工商银行	136,648.00	0.40
15	601012	隆基股份	124,859.00	0.37
16	601658	邮储银行	120,219.00	0.35
17	000002	万科 A	117,420.00	0.35
18	603259	药明康德	116,609.00	0.34
19	601390	中国中铁	115,938.00	0.34
20	002304	洋河股份	114,992.00	0.34

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	002415	海康威视	553,354.00	1.63
2	600036	招商银行	282,791.00	0.83
3	601166	兴业银行	271,956.00	0.80
4	300750	宁德时代	244,690.00	0.72
5	601318	中国平安	239,881.00	0.71
6	600519	贵州茅台	209,289.00	0.62
7	601888	中国中免	200,281.00	0.59
8	603259	药明康德	183,559.00	0.54
9	002271	东方雨虹	179,930.50	0.53
10	000858	五粮液	153,836.00	0.45
11	000002	万科 A	152,416.00	0.45
12	600050	中国联通	148,577.00	0.44
13	000001	平安银行	108,246.00	0.32
14	600019	宝钢股份	96,118.00	0.28
15	300760	迈瑞医疗	95,437.00	0.28
16	601012	隆基股份	91,392.00	0.27
17	300782	卓胜微	83,834.00	0.25
18	600887	伊利股份	75,007.00	0.22
19	002304	洋河股份	74,922.00	0.22
20	600000	浦发银行	73,889.00	0.22

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	13,883,094.27
卖出股票收入（成交）总额	9,705,294.81

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.11.3 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

ESG 基金截至 2021 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的招商银行（600036）的发行人招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 21 日公告，因公司存在以下违规行为：一、为同业投资提供第三方

信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息；于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 7170 万元的处罚。

ESG 基金截至 2021 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的平安银行（000001）的发行人平安银行股份有限公司于 2020 年 10 月 27 日公告，因公司存在以下违规行为：贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等；于 2020 年 10 月 16 日收到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局合计罚款人民币 100 万元的处罚。

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八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

基金投资的前十名股票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	2,434.91
2	应收证券清算款	73,590.80
3	应收股利	-
4	应收利息	281.22
5	应收申购款	6,448.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	82,755.62

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
6,423	4,031.91	12,628,669.07	48.77	13,268,296.34	51.23

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国国际金融股份有 限公司	1,326,090.00	56.20
2	孙健	198,412.00	8.41

3	黄钰婷	135,300.00	5.73
4	欧阳燕星	120,000.00	5.09
5	应旭虹	100,000.00	4.24
6	王语	87,000.00	3.69
7	冯洪河	63,000.00	2.67
8	梁准	50,000.00	2.12
9	杨哲尧	30,000.00	1.27
10	粟盈明	29,983.00	1.27

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,001,261.43	3.8663

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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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	22,892,553.92
本报告期基金总申购份额	9,857,710.44
减：本报告期基金总赎回份额	6,853,298.95
本报告期基金拆分变动份额 (份额 减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	25,896,965.41

§ 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

中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	2	5,740,947.91	24.78%	5,341.84	24.95%	-
华创证券	1	3,791,761.18	16.36%	3,455.53	16.14%	-
中信证券	2	3,437,407.73	14.83%	3,132.54	14.63%	-
中泰证券	2	3,006,754.78	12.98%	2,794.87	13.05%	-
华西证券	2	2,998,107.05	12.94%	2,781.90	12.99%	-
东方财富	2	1,684,814.77	7.27%	1,569.45	7.33%	-

申万宏源	1	1,347,080.82	5.81%	1,254.49	5.86%	-
广发证券	2	882,737.38	3.81%	819.93	3.83%	-
野村东方 国际证券	2	282,221.03	1.22%	262.77	1.23%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	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:广发证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

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

注：本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金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	2021-1-9
2	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF) 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2021-1-22
3	关于警惕冒用华宝基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	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	2021-2-19
4	华宝基金管理有限公司华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告	基金管理人网站, 证券时报	2021-3-8
5	华宝基金管理有限公司关于提示投资者完善身份信息的公告	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	2021-3-9
6	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	基金管理人网站	2021-3-10

	书（更新）		
7	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-3-10
8	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）2020 年年度报告	基金管理人网站	2021-3-31
9	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	基金管理人网站	2021-3-31
10	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	2021-3-31
11	华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-3-31
12	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增中金财富为代销机构的公告	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	2021-3-31
13	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增招商银行为代销机构的公告	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	2021-3-31
14	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》修改基金合同部分条款的公告	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	2021-3-31
15	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 1 季度报告	基金管理人网站	2021-4-22
16	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增阳光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	2021-5-14
17	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增华鑫证券为代销机构的公告	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	2021-5-28
18	华宝基金管理有限公司关于深圳分公司负责人变更的公告	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	2021-6-22
19	华宝基金关于旗下部分开放式基金参加交通银行申购及定投手续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	2021-6-30

§ 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	20210104~20210630	9,999,450.00	0.00	0.00	9,999,450.00	38.61
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。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

根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》的要求，2021 年 3 月 31 日，基金管理人发布关于修订旗下部分基金基金合同的公告，对基金管理人旗下 34 只指数基金基金合同部分条款进行相应更新，具体内容可详见相关公告，请投资者予以关注。

§ 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住所备投资者查阅。

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

2021 年 8 月 27 日