

华宝中证银行交易型开放式指数证券投资  
基金  
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华宝中证银行 ETF
场内简称	银行 ETF
基金主代码	512800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017 年 7 月 18 日
报告期末基金份额总额	6,048,439,953.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
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	中证银行指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪中证银行指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	81,053,221.33
2. 本期利润	371,800,247.41
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0605
4. 期末基金资产净值	6,807,198,617.35
5. 期末基金份额净值	1.1254

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。

### 3.2 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

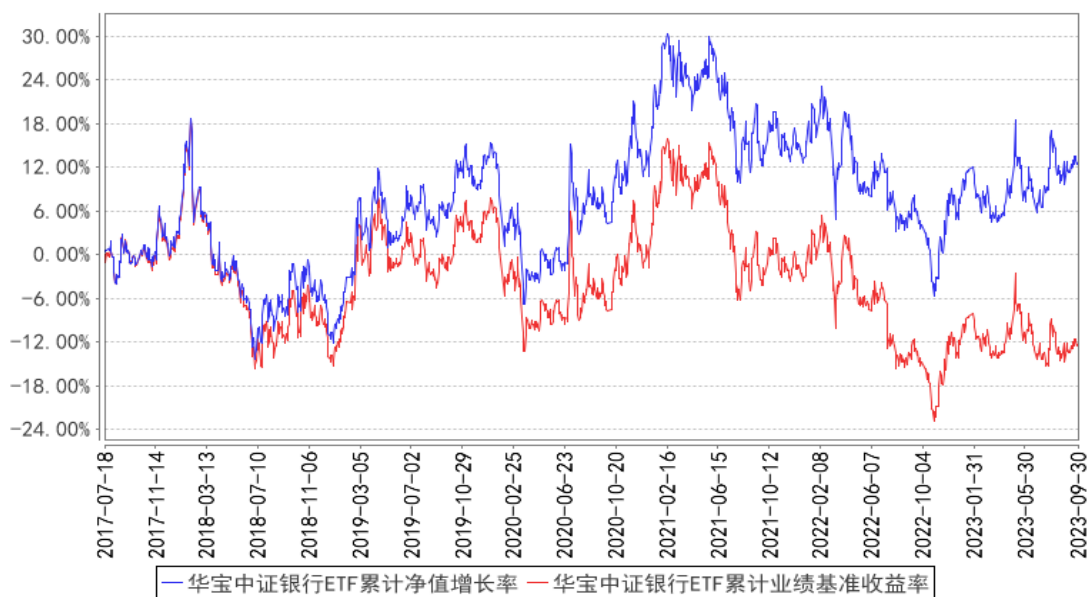
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.02%	0.96%	1.44%	0.98%	3.58%	-0.02%
过去六个月	7.30%	1.06%	1.80%	1.09%	5.50%	-0.03%
过去一年	8.08%	1.07%	2.81%	1.08%	5.27%	-0.01%
过去三年	7.98%	1.16%	-4.96%	1.18%	12.94%	-0.02%
过去五年	13.91%	1.20%	-7.79%	1.22%	21.70%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	12.54%	1.19%	-12.35%	1.20%	24.89%	-0.01%

注：（1）基金业绩基准：中证银行指数；

（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

华宝中证银行ETF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 2018 年 01 月 18 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2017-07-18	-	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

				<p>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 月至 2023 年 10 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，2019 年 8 月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2019 年 12 月起任华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2021 年 1 月至 2021 年 5 月任华宝中证医疗指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 5 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2021 年 6 月起任华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 8 月起任华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 9 月起任华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，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。</p>
--	--	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

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

#### 4.1.1 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、《华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在

控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 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

本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易共有 3 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年三季度，中国经济微观结构进一步改善，各类经济数据底部企稳。同时各项政策在三季度密集出台，从消费 20 条出台、到促进民营经济的措施、再到房地产市场的进一步放松、以及活跃资本市场的多项举措，表明“政策底”已显，接下来的国内复苏是值得期待的。货币与信用层面，继续精准有力实施稳健的货币政策，在三季度根据节奏适时降息降准，调整存量房贷利率，保持市场活力。全球来看，中美利差持续倒挂，全球进入去库存周期，但仍保持较强韧性。展望 2023 年四季度，各项领先指标已表明居民信心持续恢复，政策出台后的效果值得进一步观察。同时，全球基本面对市场的影响持续加强，后续或更多关注全球经济走向。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 年三季度，证券、采掘、保险、钢铁等行业表现较好，电气设备、传媒、计算机等行业表现较弱。指数方面，市场上大部分基准指数呈现下跌态势，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 4.34% 和 3.98%，而作为成长股代表的中证 500 指数和中证 1000 指数分别下跌了 5.13% 和 7.92%。在本报告期中，中证银行指数累计上涨了 1.44%。

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。

#### 4.5 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 5.02%，业绩比较基准收益率为 1.44%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,741,777,631.64	98.91
	其中：股票	6,741,777,631.64	98.91
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	72,463,007.32	1.06
8	其他资产	2,002,468.83	0.03
9	合计	6,816,243,107.79	100.00

注：1、此处股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值，两者在金额上可能不相等。

2、通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 28,851,058.00 元，占基金资产净值的比例为 0.42%。

3、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）。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	6,736,395,925.17	98.96
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	6,736,395,925.17	98.96

### 5.2.2 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	4,861,554.80	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,563.97	0.00
E	建筑业	11,369.83	0.00
F	批发和零售业	95,541.72	0.00
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	276,445.42	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,809.24	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	45,609.98	0.00



0	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作	21,185.46	0.00
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
	合计	5,378,080.42	0.08

### 5.2.3 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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	600036	招商银行	31,093,958	1,025,167,795.26	15.06
2	601166	兴业银行	42,447,194	691,464,790.26	10.16
3	601398	工商银行	102,180,839	478,206,326.52	7.03
4	601328	交通银行	80,117,775	461,478,384.00	6.78
5	601288	农业银行	93,077,262	335,078,143.20	4.92
6	000001	平安银行	28,327,146	317,264,035.20	4.66
7	002142	宁波银行	11,573,509	310,980,186.83	4.57
8	600016	民生银行	72,356,327	277,848,295.68	4.08
9	600919	江苏银行	36,334,683	260,883,023.94	3.83
10	600000	浦发银行	34,260,350	243,248,485.00	3.57

#### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	688347	华虹公司	57,825	2,537,361.00	0.04
2	301559	中集环科	13,144	318,347.68	0.00
3	688249	晶合集成	7,405	122,700.85	0.00
4	688657	浩辰软件	1,008	104,227.20	0.00
5	688443	智翔金泰	3,033	88,169.31	0.00

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本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

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 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，触犯法律法规；于 2022 年 09 月 30 日收到银保监会罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，上海浦东发展银行

股份有限公司因：“一是对衢州国资相关债务融资工具募集资金使用情况监测和督导不到位。二是尽职调查报告形式不完整，未充分反映尽职调查的过程和结果。”；于 2022 年 10 月 24 日收到中国银行间市场交易商协会责令改正，监管(约见)谈话的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，江苏银行股份有限公司因基金销售业务存在以下问题：一、零售业务部和网络金融部均负责基金销售业务，但未对基金销售产品实行集中统一准入管理，违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(证监会令第 175 号)第二十七条的规定。二、部分基金销售业务人员未取得基金从业资格，违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(证监会令第 175 号)第三十条的规定。三、向普通投资者主动推介风险等级高于其风险承受能力的产品或服务的情况，违反了《证券期货投资者适当性管理办法》(证监会令第 177 号)第二十二条的规定。于 2022 年 12 月 05 日收到江苏证监局责令改正的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，交通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，对市场正常秩序造成了一定不良影响。二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。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，交通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，对市场正常秩序造成了一定不良影响。二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。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，平安银行股份有限公司因作为相关债务融资工具联席主承销商，未按发行文件约定，取利率区间上限开展余额包销，相关行为挤占了其他市场投资人的份额，损害了其他投资人权益，并影响了发行利率，对市场正常秩序造成了一定不良影响；于 2023 年 01 月 18 日收到中国银行间市场交易商协会责令改正，通报批评的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 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：“一是低价包销多期债务融资工具，影响了市场正常秩序。二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。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 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。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，江苏银行股份有限公司因：“一是个别债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销，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。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，江苏银行股份有限公司因违反国库管理规定，违反人民币管理规定，违反账户管理规定，未按规定履行客户身份识别义务，未按规定保存客户身份资料和交易记录，未按规定报送大额交易或者可疑交易报告；于 2023 年 02 月 10 日收到中国人民银行警告，罚款，没收违法所得的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司因信贷业务违规，票据业务违规，存款业务违规，违规销售或推介，违规授信，贷后资金流向、用途及项目进度等管理、监督、执行不到位，违规收费，内部管理与控制制度不健全或执行监督不力，未经任职资格审查或核准任命董事、高级管理人员、首席代表，编制或者提供虚假资料；于 2023 年 02 月 16 日收到银保监会罚款，没收违法所得的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 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。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 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违规经营；于 2023 年 05 月 08 日收到福建证监局责令改正的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司

有限公司因承销业务涉嫌违规；于 2023 年 05 月 09 日收到中国银行间市场交易商协会立案调查的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,平安银行股份有限公司因违反国库管理规定,违反征信管理规定,违反支付结算管理规定,违反账户管理规定,未按规定履行客户身份识别义务,未按规定报送大额交易或者可疑交易报告；于 2023 年 07 月 07 日收到中国人民银行警告,罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国民生银行股份有限公司因信贷业务违规,存款业务违规,违规销售或推介,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,提供服务质价不符；于 2023 年 08 月 02 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,江苏银行股份有限公司因编制或者提供虚假资料,未按规定报送有关报告、报表、文件和资料,保险业务违规；于 2023 年 08 月 10 日收到国家金融监督管理总局江苏监管局警告,罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 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信贷业务违规,票据业务违规,存款业务违规,违反审慎经营规则,违规授信,贷后资金流向、用途及项目进度等管理、监督、执行不到位,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 2023 年 08 月 15 日收到国家金融监督管理总局罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国民生银行股份有限公司因：“一是推荐撮合资产管理计划投资业务,客观上协助了相关企业债券的非市场化发行和规避交易监管。二是个别债项按照发行人预期或要求的利率执行包销,发行定价市场化程度不足。三是部分债项发行工作程序执行不规范。四是作为相关债项发行文件约定的持有人会议召集人,未及时召集持有人会议。”；于 2023 年 08 月 16 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。

华宝中证银行 ETF 截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,宁波银行股份有限公司因违规经营,涉嫌违反法律法规,未依法履行职责,违反结汇、售汇及付汇管理规定；于 2023 年 09 月 08 日收到国家外汇管理局宁波市分局警告,罚款,没收违法所得的处罚措施。

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

开谴责、处罚的情况。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	407,717.41
2	应收证券清算款	1,579,045.27
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	15,706.15
7	其他	-
8	合计	2,002,468.83

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002142	宁波银行	51,053.00	0.00	转融通流通受限

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688347	华虹公司	2,537,361.00	0.04	新股锁定
2	301559	中集环科	318,347.68	0.00	新股流通受限
3	688249	晶合集成	122,700.85	0.00	新股锁定
4	688657	浩辰软件	104,227.20	0.00	新股流通受限
5	688443	智翔金泰	88,169.31	0.00	新股锁定

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	7,227,739,953.00
报告期期间基金总申购份额	1,202,400,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	2,381,700,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	6,048,439,953.00

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
 华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同；  
 华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；  
 华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金托管协议；  
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；  
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；  
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 9.2 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。

### 9.3 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 10 月 25 日