

华宝中证银行交易型开放式指数证券投资
基金
2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 4 月 19 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 2024 年 04 月 17 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 2024 年 01 月 01 日起至 03 月 31 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	5,207,239,953.00 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（2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-56,703,423.10
2. 本期利润	635,260,872.31
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1152
4. 期末基金资产净值	6,046,098,217.63
5. 期末基金份额净值	1.1611

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

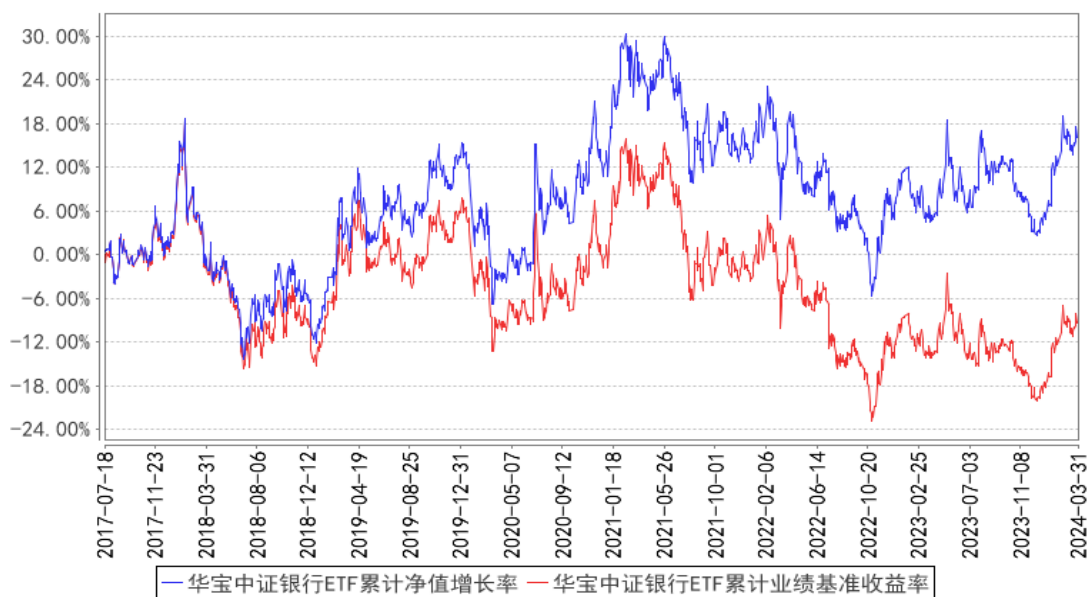
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.54%	0.91%	10.81%	0.91%	-0.27%	0.00%
过去六个月	3.17%	0.79%	3.51%	0.80%	-0.34%	-0.01%
过去一年	10.71%	0.93%	5.37%	0.95%	5.34%	-0.02%
过去三年	-7.97%	1.07%	-19.09%	1.09%	11.12%	-0.02%
过去五年	11.68%	1.14%	-9.60%	1.16%	21.28%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	16.11%	1.16%	-9.27%	1.18%	25.38%	-0.02%

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	-	18 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，2023 年 12 月起任华宝标普中国 A 股红利机会交易型开放式指数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。

4.1.1 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年一季度，中国经济内生动力仍强：1-3 月 PMI 在春节效应与季调后呈现出良好的回升态势，重新站上 50 的荣枯线。出行与出口成为 2024 年一季度的新亮点，在国内居民消费回暖、美国需求韧性十足以及全球库存周期见底的多重影响下，展望二季度，以上经济增长动力或具备持续动力。政策层面，地产相关刺激政策将在 2024 年持续，科创相关产业支持作为长期政策，仍需关注其边际变化；国内货币与信用维持宽松，虽然美联储货币政策拐头迹象较难在上半年看到，但其并不影响国内流动性仍处于历史高位水平。市场方面，A 股整体振幅加大，呈现结构性行情，不同市值风格板块表现差异明显。2024 年一季度，银行、采掘、家用电器、有色金属、公用事业等行业表现较好，医药生物、计算机、电子等行业表现较弱。指数方面，市场呈现明显分化，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上涨了 3.40%和 3.10%，而作为中小盘代表的中证 500 指数和中证 1000 指数分别下跌了 2.64%和 7.58%。在本报告期中，中证银行指数累计上涨了 10.81%。

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 10.54%，业绩比较基准收益率为 10.81%。

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	5,992,665,272.27	99.00
	其中：股票	5,992,665,272.27	99.00
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	59,903,986.68	0.99
8	其他资产	777,684.19	0.01
9	合计	6,053,346,943.14	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 63,233,564.00 元，占基金资产净值的比例为 1.05%。

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	5,991,954,654.02	99.10
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	5,991,954,654.02	99.10

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	668,448.17	0.01
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	11,556.45	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,460.82	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,097.60	0.00
M	科学研究和技术服务业	15,750.21	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	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	711,313.25	0.01

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	28,872,074	929,680,782.80	15.38
2	601166	兴业银行	35,162,394	554,862,577.32	9.18
3	601398	工商银行	84,572,139	446,540,893.92	7.39
4	601328	交通银行	66,274,135	420,178,015.90	6.95
5	600919	江苏银行	44,214,709	349,296,201.10	5.78
6	601288	农业银行	76,950,562	325,500,877.26	5.38
7	000001	平安银行	23,482,546	247,036,383.92	4.09
8	600016	民生银行	59,831,007	242,315,578.35	4.01
9	601988	中国银行	50,733,396	223,226,942.40	3.69
10	600000	浦发银行	28,390,106	202,421,455.78	3.35

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	301589	诺瓦星云	691	240,108.68	0.00
2	301587	中瑞股份	3,056	66,406.88	0.00
3	301526	国际复材	9,723	39,475.38	0.00
4	001389	广合科技	2,219	38,677.17	0.00
5	301559	中集环科	1,315	21,250.40	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 2024 年 03 月 31 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 2024 年 03 月 31 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 2024 年 03 月 31 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 2024 年 03 月 31 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 2024 年 03 月 31 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作为债务融资工具主承销商, 存在以下违反银行间债券市场相关自律管理规则的行为: 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 2024 年 03 月 31 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: 一、农户贷款发放后流入房地产企业; 二、农村个人生产经营贷款贷后管理不到位; 三、农户小额贷款发放后转为定期存款; 四、违规向房地产开发企业提供融资; 五、违规发放流动资金贷款; 六、装修贷款发放不审慎; 七、商业用房贷款发放不审慎; 八、违规向关系人发放信用贷款; 九、贷款风险分类不准确导致不良率失实; 十、违规发放固定资产贷款; 十一、对不具备法人资格的分支公司客户单独办理授信; 十二、集团客户统一授信管理不到位; 十三、贷款回流用于归还本行贷款; 十四、贷款回流用于缴纳银承保证金; 十五、贷款回流用于转存定期存款; 十六、贴现资金回流出票人; 十七、信贷资金流入证券账户; 十八、贷后管理不尽责导致信贷资金实质被关联企业占用; 十九、扶贫小额信贷户贷企用; 于 2023 年 08 月 18 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 2024 年 03 月 31 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、规避委托贷款监管, 违规利用委托债权投资业务向企业融资; 二、违规贷款未整改收回情况下继续违规发放贷款; 三、对政府平台公司融资行为监控不力, 导致政府债务增加; 四、股权质押管理问题未整改; 五、审计人员配备不足问题未整改; 六、对相关案件未按照有关规定处置; 七、未按监管要求将福费廷业务纳入表内核算; 八、代销池业务模式整改不到位; 九、

违规开展综合财富管理代销业务整改不到位；十、个别贷款风险分类结果仍存在偏离，整改不到位；十一、发放违反国家宏观调控政策贷款仍未整改收回；十二、部分正常资产转让问题整改不到位；十三、部分不良资产转让问题整改不到位或未整改；十四、对部分违规问题未进行责任追究或追究不到位；于 2023 年 08 月 18 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 2024 年 03 月 31 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：1. 办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；2. 违反规定办理资本项目资金收付；3. 违反规定办理结汇、售汇业务；4. 未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料；于 2023 年 11 月 17 日收到国家外汇管理局北京市分局警告，罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查行为、违反规定办理结汇、售汇业务行为、违反规定办理资本项目资金收付行为；于 2023 年 11 月 27 日收到国家外汇管理局深圳市分局警告, 罚款, 没收违法所得的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截止 2024 年 03 月 31 日持仓前十名证券的发行主体中,中国银行股份有限公司因：1. 违反账户管理规定；2. 违反清算管理规定；3. 违反商户管理规定；4. 违反备付金管理规定；5. 违反人民币反假有关规定；6. 违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；7. 未按规定履行客户身份识别义务；8. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；9. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；10. 与身份不明的客户进行交易；11. 违反金融营销宣传管理规定；12. 违反个人金融信息保护规定；于 2023 年 12 月 01 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 2024 年 03 月 31 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：一、流动资金贷款被用于固定资产投资；二、贷款受托支付问题整改不到位；三、贷款风险分类不准确；四、个别精准扶贫贷款被挪用；五、不良资产转让流程问题整改不到位；六、小微企业划型不准确；七、贷款资金转存银承汇票保证金问题整改不到位；八、个人贷款违规流入房地产市场问题整改不到位；九、审计人员配备不足问题未整改；十、非现场数据报送不准确，整改不到位；十一、人员内部问责不到位；十二、向关系人发放信用贷款；十三、个人贷款管理不到位，部分贷款资金被挪用；于 2023 年 12 月 01 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 2024 年 03 月 31 日持仓前十名证券的发行主体中,中国银行股份有限公司因：一、部分重要信息系统识别不全面，灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求；二、重

要信息系统投产及变更未向监管部门报告，且投产及变更长期不规范引发重要信息系统较大及以上突发事件；三、信息系统运行风险识别不到位、处置不及时，引发重要信息系统重大突发事件；四、监管意见整改落实不到位，引发重要信息系统重大突发事件；五、信息科技外包管理不审慎；六、网络安全域未开展安全评估，网络架构重大变更未开展风险评估且未向监管部门报告；七、信息系统突发事件定级不准确，导致未按监管要求上报；八、迟报重要信息系统重大突发事件九、错报漏报监管标准化（EAST）数据；于 2024 年 01 月 05 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

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	165,069.15
2	应收证券清算款	553,692.37
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	58,922.67
7	其他	-
8	合计	777,684.19

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	601288	农业银行	5,333,184.00	0.09	转融通流通受限
2	600000	浦发银行	1,991,409.00	0.03	转融通流通受限
3	600016	民生银行	1,990,170.00	0.03	转融通流通受限

4	000001	平安银行	1,022,544.00	0.02	转融通流通受限
5	601328	交通银行	944,660.00	0.02	转融通流通受限
6	601166	兴业银行	875,790.00	0.01	转融通流通受限
7	601988	中国银行	743,600.00	0.01	转融通流通受限
8	601398	工商银行	200,112.00	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	301589	诺瓦星云	240,108.68	0.00	新股锁定
2	301587	中瑞股份	66,406.88	0.00	新股流通受限
3	301526	国际复材	39,475.38	0.00	新股锁定
4	001389	广合科技	38,677.17	0.00	新股流通受限
5	301559	中集环科	21,250.40	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	5,756,239,953.00
报告期期间基金总申购份额	1,295,400,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	1,844,400,000.00
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	5,207,239,953.00

§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

§ 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

2024 年 4 月 19 日