

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  
2024 年第 3 季度报告

2024 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2024 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华宝券商 ETF 联接
基金主代码	006098
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2018 年 6 月 27 日
报告期末基金份额总额	3,110,826,224.96 份
投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金可以通过申购赎回代理券商以成份股实物形式申购及赎回目标 ETF 基金份额，也可以通过券商在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额。本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率×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 ETF 联接基金，目标 ETF 为指数型基金，本基

	金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，并且具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝券商 ETF 联接	华宝券商 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	006098	007531
报告期末下属分级基金的份额总额	737,610,981.30 份	2,373,215,243.66 份

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 30 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 9 月 14 日
基金管理人名称	华宝基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

### 2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取复制法，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	中证全指证券公司指数收益率
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，跟踪中证全指证券公司指数，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。

## §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 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	华宝券商 ETF 联接	华宝券商 ETF 联接 C
1. 本期已实现收益	-19,370,387.20	-67,195,584.55
2. 本期利润	334,888,287.65	1,064,926,630.24

3. 加权平均基金份额本期利润	0.4480	0.4175
4. 期末基金资产净值	1,158,519,078.54	3,650,314,815.44
5. 期末基金份额净值	1.5706	1.5381

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

华宝券商 ETF 联接

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	40.60%	2.16%	39.43%	2.18%	1.17%	-0.02%
过去六个月	29.08%	1.82%	27.67%	1.84%	1.41%	-0.02%
过去一年	17.74%	1.57%	16.75%	1.59%	0.99%	-0.02%
过去三年	-2.17%	1.50%	-5.66%	1.51%	3.49%	-0.01%
过去五年	21.65%	1.66%	13.32%	1.68%	8.33%	-0.02%
自基金合同生效起至今	57.06%	1.73%	41.30%	1.79%	15.76%	-0.06%

华宝券商 ETF 联接 C

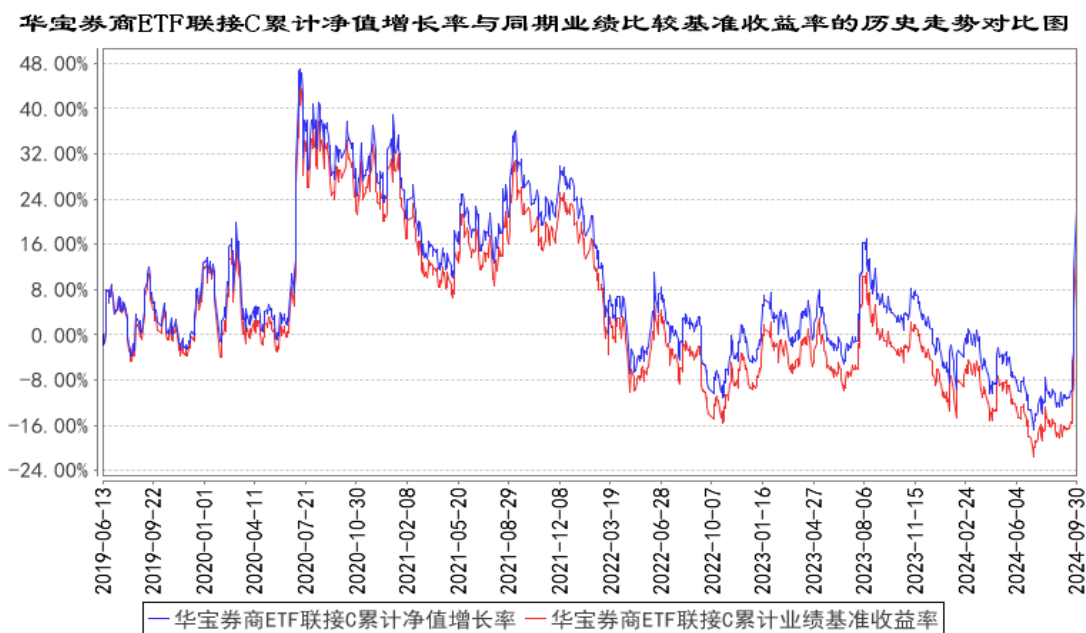
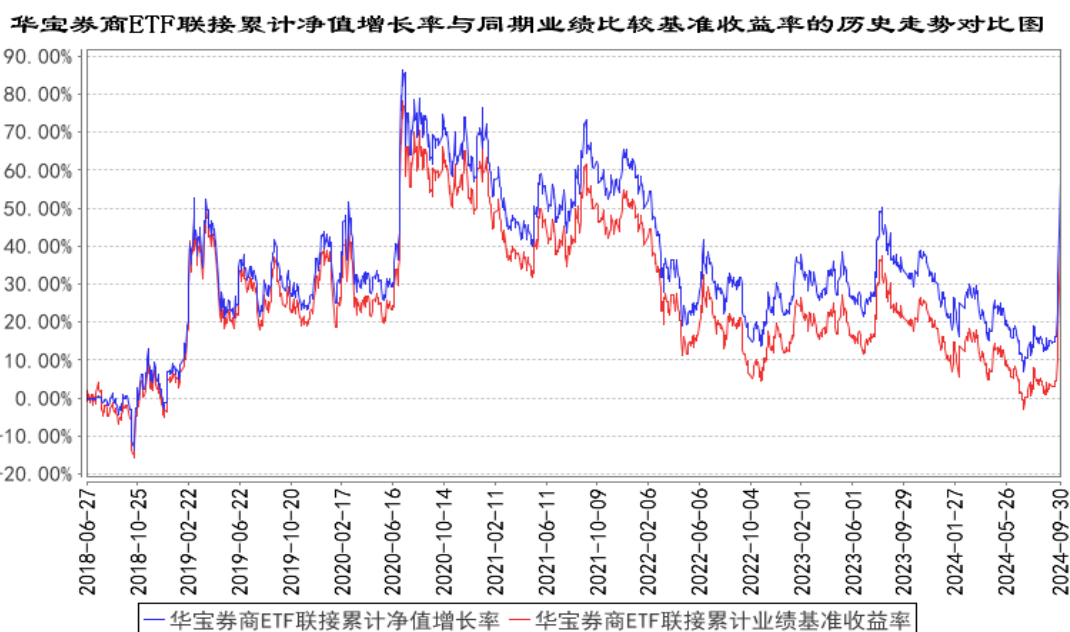
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	40.45%	2.16%	39.43%	2.18%	1.02%	-0.02%
过去六个月	28.82%	1.82%	27.67%	1.84%	1.15%	-0.02%
过去一年	17.26%	1.57%	16.75%	1.59%	0.51%	-0.02%
过去三年	-3.34%	1.50%	-5.66%	1.51%	2.32%	-0.01%
过去五年	19.25%	1.66%	13.32%	1.68%	5.93%	-0.02%

自基金合同 生效起至今	21.80%	1.65%	14.31%	1.68%	7.49%	-0.03%
----------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

注：（1）基金业绩基准：中证全指证券公司指数收益率×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12月27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		
丰晨成	本基金基金经理	2018-06-27	-	15年	硕士。2009年7月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015年11月起任华宝上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2016年8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基金经理，2018年4月至2021年1月任华宝中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2018年6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基金经理，2018年8月至2020年11月任华宝中证1000指数分级证券投资基金基金经理，2020年11月起任华宝中证1000指数证券投资基金基金经理，2022年2月起任华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022年9月至2023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，2022年12月起任华宝中证港股通互联网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。
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	2021-03-08	-	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

				<p>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

三季度 A 股市场股票日均交易额 6775 亿，环比减少 18%，也远低于去年同期水平。7 月上旬延续之前的振荡走低，至 7 月 9 日券商板块触及年内新低后企稳回升，证监会采取了一系列措施以维护市场稳定，提振资本市场信心，其中 7 月 31 日北向流入市场转暖引发券商板块大涨 5%。8 月即便 A 股振荡向下，受大金融板块整体抗跌，券商板块相对于沪深 300 及中小市值宽基指数波动较小。受 9 月底高层扭转经济预期目标明确、转向坚决，推动市场信心提升，短期大涨引发的财富效应吸引个人客户对于资本市场关注度明显提升，银证转账和互联网券商的数据均显示散户入场明显，休眠账户被唤醒。受益于从 9 月 24 日以来 A 股成交额急速上升，以及跑步入场让券商开户数翻倍上涨，市场重新燃起对股市流动性根本改善的预期。9 月 30 日 A 股成交额 2.6 万亿，



刷新了历史单日成交额最高的记录，政策超预期推动行情超预期，券商板块有望重新为“旗手”板块正名。

#### 4.5 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40.60%，本报告期基金份额C类净值增长率为40.45%；同期业绩比较基准收益率为39.43%。

#### 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	67,738,159.93	1.36
	其中：股票	67,738,159.93	1.36
2	基金投资	4,483,180,621.92	90.12
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	287,013,696.47	5.77
8	其他资产	136,795,372.13	2.75
9	合计	4,974,727,850.45	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）。

### 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	8,676.17	0.00
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	56,129.58	0.00
J	金融业	67,663,812.50	1.41
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	9,541.68	0.00
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	67,738,159.93	1.41

### 5.2.2 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	300059	东方财富	686,019	13,926,185.70	0.29
2	600837	海通证券	575,630	5,048,275.10	0.10
3	601211	国泰君安	270,358	4,996,215.84	0.10
4	000166	申万宏源	496,500	2,839,980.00	0.06
5	000776	广发证券	163,400	2,728,780.00	0.06
6	600030	中信证券	91,341	2,484,475.20	0.05
7	601066	中信建投	72,719	1,953,232.34	0.04
8	002736	国信证券	161,600	1,911,728.00	0.04
9	601995	中金公司	48,693	1,880,036.73	0.04
10	601878	浙商证券	107,800	1,553,398.00	0.03

### 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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	指数基金	交易型开放式	华宝基金管理有限公司	4,483,180,621.92	93.23

### 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。

#### 5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

### 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

#### 5.11.2 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。

#### 5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

### 5.12 投资组合报告附注

#### 5.12.1 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

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中信建投证券股份有限公司因在开展场外期权业务中存在对个别交易对手方准入及是否持续符合适当性管理要求审查不到位的情况；于 2023 年 10 月 11 日收到北京证监局警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信建投证券股份有限公司因违反规定办理资本项目资金收付; 于 2023 年 11 月 06 日收到国家外汇管理局北京市分局罚款的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 海通证券股份有限公司因未履行信披义务, 重大事项信息披露不及时或违规; 于 2023 年 11 月 17 日收到湖北证监局警示, 记入诚信档案的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 国泰君安证券股份有限公司因在保荐滁州多利汽车科技股份有限公司 (以下简称“发行人”) 首次公开发行股票并上市过程中, 未勤勉尽责, 导致出现对发行人董监高资金流水的穿透核查程序不充分、资金流水核查结论与实际不符等问题; 于 2023 年 11 月 17 日收到安徽证监局警示, 记入诚信档案的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 国泰君安证券股份有限公司因内部制度不完善; 于 2023 年 11 月 24 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信建投证券股份有限公司因信息披露不规范或不准确; 于 2024 年 01 月 03 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 国信证券股份有限公司因内部制度不完善, 财务会计报告违规; 于 2024 年 01 月 04 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 海通证券股份有限公司因未依法履行职责; 于 2024 年 01 月 05 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 国泰君安证券股份有限公司因作为泰禾集团股份有限公司 (以下简称发行人) 公司债券受托管理人, 在受托管理期

间未严格遵守执业行为准则，存在未及时召集持有人会议、未对发行人未披露相关重大债务逾期及诉讼事项保持必要关注等情形；于 2024 年 01 月 05 日收到证监会警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中国国际金融股份有限公司因未履行信披义务，重大事项信息披露不及时或违规，未依法履行职责；于 2024 年 01 月 05 日收到证监会警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中信证券股份有限公司因保荐的恒逸石化股份有限公司（发行人）可转债项目，发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑 50%以上；于 2024 年 01 月 12 日收到证监会警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中国国际金融股份有限公司因在资产证券化专项计划管理工作中，存在建立基础资产现金流归集机制不到位且管理不善，未能切实防范专项计划现金流被侵占、挪用等问题，违反了《证券公司及基金管理公司子公司资产证券化业务管理规定》（证监会公告〔2014〕49 号）第十三条的规定；于 2024 年 01 月 12 日收到浙江证监局警示，记入诚信档案的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，海通证券股份有限公司因：1. 对境外子公司合规管理和风险管理不到位，未健全覆盖境外子公司的风险指标体系；未督促境外子公司有效处置风险指标超限额的情形；未按规定就境外子公司相关议案进行集体讨论；未对境外子公司部分董事、高级管理人员开展离任审计或离任审查。2. 场外期权业务相关内部控制不健全，未建立健全覆盖场外期权业务各环节的内部管理制度；未明确部门层级风险指标超限额的报告路径和处理办法。场外衍生品业务相关风险指标体系不健全。3. 未清晰划分另类投资子公司业务范围；未及时处理另类投资子公司有关人员兼任利益冲突职务的行为；于 2024 年 01 月 22 日收到上海市证监局责令改正的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中信建投证券股份有限公司因内部制度不完善，未依法履行职责；于 2024 年 01 月 24 日收到山东证监局警示，记入诚信档案的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,海通证券股份有限公司因存在首发保荐业务履职尽责明显不到位、投行质控内核部门未识别项目重大风险及对尽职调查把关不审慎等缺陷。有关责任人对公司上述行为负有责任,未能审慎勤勉执业;于 2024 年 01 月 29 日收到上海证券交易所监管(约见)谈话的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,浙商证券股份有限公司因未保证信息披露的真实、准确、完整;于 2024 年 02 月 07 日收到全国股转公司要求提交书面承诺的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,浙商证券股份有限公司因作为浙江星星冷链集成股份有限公司(以下简称发行人)首次公开发行股票并上市(以下简称首发上市)申请项目的保荐人,存在保荐职责履行不到位的情形;于 2024 年 03 月 27 日收到上海证券交易所警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,国信证券股份有限公司因未履行信披义务,未依法履行职责;于 2024 年 04 月 18 日收到中国证券监督管理委员会广东监管局警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中信证券股份有限公司因定期报告披露超期限,内部制度不完善,未依法履行职责;于 2024 年 04 月 20 日收到中国证监会警告,罚款,没收违法所得、没收非法财物,责令改正的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国国际金融股份有限公司因合规管理存在以下问题:一是聘用未取得从业资格的人员开展相关证券业务;二是多名员工曾存在买卖股票、出借个人证券账户的行为,公司对员工行为监测监控不到位。违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法(2020 年修订)》第三条、第六条第四项的规定;于 2024 年 04 月 24 日收到中国证监会北京监管局警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,海通证券股份有限公司因内部制度不完善;于 2024 年 04 月 29 日收到上海市证监局责令改正的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信证券股份有限公司因在尽职调查过程中, 未按照《保荐人尽职调查工作准则》第七十条以及《监管规则适用指引——发行类第 4 号》4-11 等执业规范要求, 对发行人关联交易情况进行充分核查, 导致招股说明书遗漏披露关联交易相关信息; 在核查工作底稿已有记录的情况下, 中信证券未充分关注并执行进一步的核查程序, 在本所问询后仍未审慎核查, 发表的核查意见不准确。上述行为违反本所《股票发行上市审核规则》(以下简称《审核规则》)第二十七条、第三十八条的规定; 于 2024 年 04 月 30 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中国国际金融股份有限公司因存在自营和投顾账户间发生交易, 利益冲突管理不到位, 开展场外期权业务不审慎, 对子公司业务和投资行为管理不到位, 公司治理不规范的情况, 反映出公司未能有效实施合规管理, 内部控制不完善, 违反了《证券公司监督管理条例》(国务院令 653 号)第二十七条第一款及《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法(2020 年修订)》第三条的规定; 于 2024 年 04 月 28 日收到中国证监会北京监管局责令改正的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信建投证券股份有限公司因财务信息披露存在重大错误, 未履行信披义务; 于 2024 年 04 月 24 日收到中国证券监督管理委员会广东监管局警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信建投证券股份有限公司因存在以下问题: 开展场外期权及自营业务不审慎, 对从业人员管理不到位的情况, 公司治理不规范, 反映出公司未能有效实施合规管理、风险管理和内部控制, 违反了《证券公司监督管理条例》(国务院令 653 号)第二十七条第一款、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法(2020 年修订)》第三条的规定; 于 2024 年 04 月 30 日收到中国证监会北京监管局责令改正的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 海通证券股份有限公司因定期报告披露超期限, 内部制度不完善, 未依法履行职责; 于 2024 年 05 月 06 日收到中国证监会罚款, 没收违法所得、没收非法财物的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,海通证券股份有限公司因:(一)保荐核查工作履职尽责不到位;(二)保荐业务内部质量控制存在薄弱环节;于 2024 年 05 月 06 日收到上海证券交易所通报批评的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国国际金融股份有限公司因在开展资产管理业务时存在因操作风险造成流动性缺口、违规提供通道服务、同日反向交易未列明决策依据、产品账户间互相发生交易等问题,违反了《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(证监会令第 151 号)第三条第二款、第四十六条第一项、第六十四条第二款、第六十五条第一款的规定;于 2024 年 05 月 09 日收到中国证监会北京监管局责令改正的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中信建投证券股份有限公司因未履行信披义务,未依法履行职责;于 2024 年 05 月 17 日收到江苏证监局警示,记入诚信档案的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,海通证券股份有限公司因作为公司债券 21 格地 02、22 格地 02 的主承销商和受托管理人存在以下违规行为:未对个别存货周边楼盘开盘价格低于项目楼面价的情况予以审慎分析核查;在 22 格地 02 期后事项核查中,未对存货可变现净值的评估进行持续关注和尽职调查;未制作咨询审计机构工作底稿;未对发行人重大损失披露临时受托管理事务报告;对发行人差错更正事项披露临时受托管理事务报告不及时;于 2024 年 05 月 28 日收到上海证券交易所警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中信建投证券股份有限公司因未依法履行职责;于 2024 年 07 月 03 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,国信证券股份有限公司因一是部分产品具有通道业务特征,主动管理不足;二是资管新规整改不实,存在规模较大的资产管理计划实质仍为非净值化通道类产品;三是个别产品为其他金融机构违规运作资金池类理财业务提供便利;四是存在产品投资限额授权不审慎、债券评级方法客观性不足、投资者适当性管理不足等问题;于 2024 年 07 月 05 日收到深圳证监局责令改正的处罚措施。



华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信建投证券股份有限公司因承销业务违规; 于 2024 年 07 月 12 日收到北京证券交易所要求提交承诺或保证的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 浙商证券股份有限公司因未勤勉尽责; 于 2024 年 07 月 11 日收到全国股转公司要求提交书面承诺的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中国国际金融股份有限公司因证券异常交易, 未依法履行其他职责; 于 2024 年 08 月 23 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信建投证券股份有限公司因证券异常交易, 关联交易, 未依法履行其他职责, 未及时披露公司重大事件; 于 2024 年 09 月 03 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 广发证券股份有限公司因一是存在未审慎报价的情况, 部分内部研究报告计算过程存在明显错误, 审批复核工作不到位, 导致报告建议价格区间明显偏高并影响最终报价, 个别项目高报价情况引发投资者信访投诉。二是未履行报价评估和决策程序, 新股报价决策仅由一人在内部报告建议价格区间内确定最终报价, 最终报价的集体决策过程缺失。三是定价依据不充分, 内部研究报告相关估值参数的设置依据不充分, 逻辑推导过程缺失; 最终报价逻辑推导过程不完备, 新股投资决策人员在内部报告建议区间中随机确定申报价格, 报价的确定缺少逻辑推导过程; 于 2024 年 09 月 13 日收到中国证券业协会警示的处罚措施。

华宝券商 ETF 联接截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中国国际金融股份有限公司因薪酬管理制度不健全、薪酬相关信息披露存在错误、人员任职管理和信息报送存在问题, 反映出公司未能有效实施合规管理, 违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法(2020 年修订)》第三条的规定; 于 2024 年 09 月 29 日收到中国证监会北京监管局警示的处罚措施。

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。

#### 5.12.2 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。

#### 5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	142,073.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	136,653,298.63
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	136,795,372.13

#### 5.12.4 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。

#### 5.12.5 报告期末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	600837	海通证券	5,048,275.10	0.10	重大事项停牌
2	601211	国泰君安	4,996,215.84	0.10	重大事项停牌

#### 5.12.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝券商ETF联接	华宝券商ETF联接C
报告期期初基金份额总额	755,811,793.52	2,644,874,524.73
报告期期间基金总申购份额	56,789,565.54	672,722,783.30

减: 报告期期间基金总赎回份额	74,990,377.76	944,382,064.37
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	737,610,981.30	2,373,215,243.66

## §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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	10,000,450.05	0.32	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	10,000,450.05	0.32	-

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计 10,001,000.00 元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于 3 年；

2、本基金管理人运用固有资金于 2018 年 6 月 21 日通过本公司直销柜台认购本基金作为发起资金的认购费用为 1,000 元。符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

3、发起份额已满足承诺持有期限，管理人于 2021 年 6 月 29 日赎回 10,000,450.05 份。

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

## § 10 备查文件目录

### 10.1 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合同；  
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招募说明书；  
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。

### 10.2 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。

### 10.3 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 10 月 25 日