

华宝中证全指证券公司交易型开放式指数  
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	华宝中证全指证券公司 ETF
场内简称	券商 ETF
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
报告期末基金份额总额	24,440,717,683.00 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。
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

## §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	-461,288,293.74
2. 本期利润	-1,055,364,230.71
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0428
4. 期末基金资产净值	20,079,311,613.76
5. 期末基金份额净值	0.8216

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

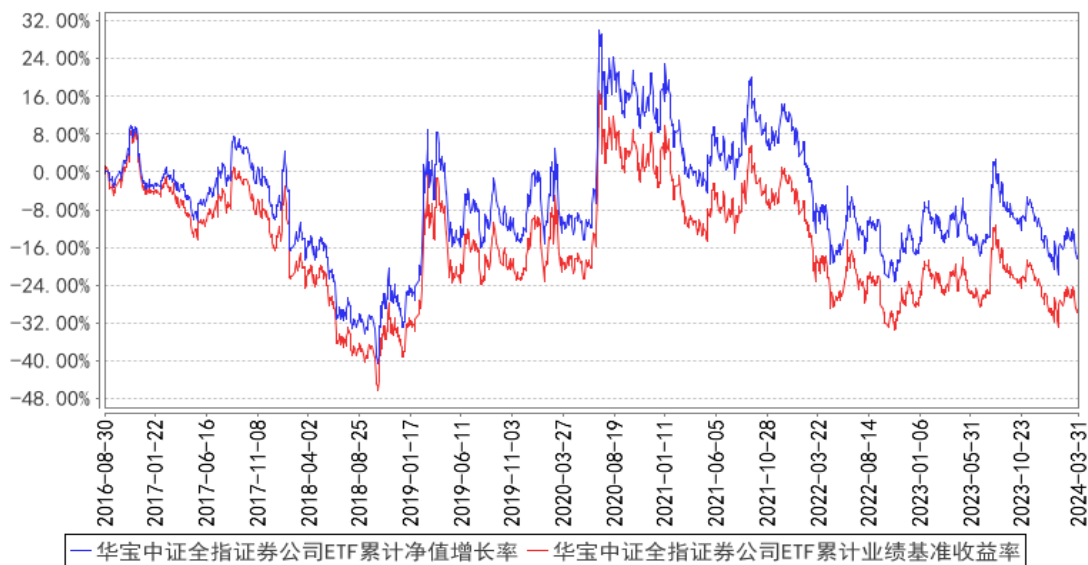
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.00%	1.58%	-4.88%	1.58%	-0.12%	0.00%
过去六个月	-9.28%	1.34%	-9.04%	1.34%	-0.24%	0.00%
过去一年	-5.20%	1.47%	-6.03%	1.48%	0.83%	-0.01%
过去三年	-17.14%	1.54%	-20.33%	1.55%	3.19%	-0.01%
过去五年	-18.99%	1.77%	-23.50%	1.78%	4.51%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	-17.84%	1.75%	-29.35%	1.76%	11.51%	-0.01%

注：（1）基金业绩基准：中证全指证券公司指数收益率；

（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

华宝中证全指证券公司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2017年02月28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	2016-08-30	-	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、产品开发和量化投资部工作, 现任指数投资总监、指数研发投资部总经理。2012 年 10 月至 2018 年 11 月任华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2012 年 10 月至 2019 年 1 月任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2015 年 5 月至 2020 年 12 月任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理, 2015 年 6 月至 2018 年 8 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 8 月起任华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2017 年 1 月起任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2017 年 7 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2018 年 11 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2019 年 1 月至 2021 年 3 月任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2019 年 5 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2019 年 7 月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2019 年 8 月至 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。
--	--	--	--	--	---

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遵规守信情况的说明

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

一季度 A 股股票日均交易额 8953 亿，环比增长 7.5%，也高于去年同期水平，一季度 A 股市场整体呈现 V 字形走势：1 月受市场风险偏好低迷，中小市值指数领跌，拖累上证指数 2 月初一度跌破 2700 点，形成短期杀跌行情，春节前市场在一系列稳增长政策、资本市场政策的支撑下触底反弹，并在节后持续反弹到 3 月中旬，3 月下旬伴随着反弹告一段落，短期交易型资金离场驱动券商板块有所回落。截至一季度末，券商 ETF 跟踪的中证全指证券公司指数的市净率只有 1.22，位于指数上市以来的历史 4.5%分位点。证监会新提出“一个基石、五个支柱”，“强本强基、严监管”体现围绕上市公司质量和金融高质量发展的监管新气象。近期多家券商公告股权调整事项，反映出行业供给侧改革的持续推进，整合催化是今年券商行业的主题主线，行业并购呈现多点开花的局面。

### 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-5.00%，业绩比较基准收益率为-4.88%。

### 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	20,054,449,680.24	99.62
	其中：股票	20,054,449,680.24	99.62
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	49,615,035.40	0.25
8	其他资产	26,177,697.46	0.13
9	合计	20,130,242,413.10	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 223,118,663.00 元，占基金资产净值的比例为 1.11%。

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	20,054,164,182.04	99.87
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	20,054,164,182.04	99.87

### 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	247,963.22	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	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	6,536.72	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	-	-
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	284,904.20	0.00

### 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	600030	中信证券	137,645,295	2,642,789,664.00	13.16
2	300059	东方财富	179,001,868	2,307,334,078.52	11.49
3	600837	海通证券	136,076,015	1,183,861,330.50	5.90
4	601688	华泰证券	72,585,970	1,019,107,018.80	5.08
5	601211	国泰君安	63,493,351	880,652,778.37	4.39
6	600999	招商证券	52,460,048	732,342,270.08	3.65
7	600958	东方证券	73,778,087	608,669,217.75	3.03
8	000166	申万宏源	127,089,169	566,817,693.74	2.82
9	000776	广发证券	41,802,134	558,058,488.90	2.78
10	601377	兴业证券	97,427,989	530,008,260.16	2.64

### 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	301526	国际复材	9,723	39,475.38	0.00
2	301559	中集环科	1,315	21,250.40	0.00
3	601096	宏盛华源	3,918	17,631.00	0.00
4	688652	京仪装备	416	17,621.76	0.00
5	301508	中机认检	419	15,750.21	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

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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作为西藏华钰矿业股份有限公司（以下简称华钰矿业）首次公开发行并上市项目保荐机构，在 2017 年至 2018 年 6 月持续督导工作中存在以下问题：一、对关联方及关联交易现场检查不到位，未保持应有的职业审慎并开展审慎核查，未能督导发行人有效防止关联方违规占用发行人资金。二、对销售收入及主要客户异常变化核查不充分，未采取充分的核查程序。于 2023 年 04 月 06 日收到西藏证监局警示的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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担任陕西嘉禾生物科技股份有限公司（以下简称嘉禾生物或发行人）首次公开发行股票并在创业板上市的项目保荐人过程中，存在以下违规行为：

一、对发行人境外存货核查程序执行不到位，实际开展的核查工作与披露情况存在差异；二、未充分关注发行人境外销售交易存在的异常情形并进行审慎核查；三、未充分关注发行人销售、采购、研发相关内部控制存在的薄弱环节；四、对发行人转贷、与供应商异常资金往来等事项核查不到位，发表的核查意见不准确；于 2023 年 04 月 12 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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作为西藏华钰矿业股份有限公司首次公开发行并上市项目保荐机构，在 2017 年至 2018 年 6 月持续督导工作中存在以下问题：一、对关联方及关联交易现场检查不到位，未保持应有的职业审慎并开展审慎核查，未能督导发行人有效防止关联方违规占用发行人资金。二、对销售收入及主要客户异常变化核查不充分，未采取充分的核查程序。；于 2023 年 05 月 17 日收到上海证券交易所警示的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 日持仓前十名证券的发行主体中, 招商证券股份有限公司因公司发布证券研究报告业务存在以下问题：一是市场影响评估机制不完善，对个别研究报告的市场影响力评估不充分，提级审核管理不到位；二是在分析师调研活动管理、服务客户、公开发表言论等方面的内控管理有效性不足；三是个别研报制作不审慎，存在内容表述不

严谨、未注明引用信息、数据来源披露不当、研报署名不规范等情形；于 2023 年 06 月 08 日收到深圳证监局警示的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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存在机房基础设施建设安全性不足,信息系统设备可靠性管理疏漏等问题,导致 2023 年 6 月 19 日集中交易系统出现异常,部分客户交易受到影响;上述行为违反了《证券期货业网络和信息安全管理办法》(证监会令第 218 号,以下简称《网络和信息安全管理办法》)第十三条相关规定;于 2023 年 07 月 13 日收到深圳证监局警示的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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信息披露不合格;于 2023 年 07 月 15 日收到上海证券交易所监管工作函的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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违规经营,未依法履行职责;于 2023 年 07 月 18 日收到中国证监会警告,罚款,责令停止承销或者代理买卖,没收违法所得、没收非法财物,责令改正的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 日持仓前十名证券的发行主体中,华泰证券股份有限公司因违反外汇账户管理规定;于 2023 年 08 月 25 日收到国家外汇管理局江苏省分局警告,罚款的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 日持仓前十名证券的发行主体中,兴业证券股份有限公司因违规经营,内部制度不完善;于 2023 年 08 月 25 日收到福建证监局警示的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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违反反洗钱管理规定,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 08 月 31 日收到中国人民银行广东省分行罚款的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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违规经营,未依法履行职责;于 2023 年 09 月 23 日收到证监会警告,罚款,责令停止承销或者代理买卖,没收违法所得、没收非法财物,责令改正的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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存在机房基础设施建设安全性不足,信息系统设备可靠性管理疏漏等问题,导致 2023 年 6 月 19 日集中交易系统出现异常,部分客户交易受到影响;上述行为违反了《证券期货业网络和信息安全管理办法》(证监会令第 218 号,以下简称《网络和信息安全管理办法》)第十三条相关规定;于 2023 年 09 月 25 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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经查, 我会发现你公司在担任航天通信控股集团股份有限公司收购智慧海派科技有限公司重大资产重组财务顾问过程中, 存在以下违规情形: 一是重组阶段未对标的公司的主要供应商、主要客户和关联关系等进行审慎核查; 二是持续督导阶段未对上市公司销售真实性等进行审慎核查; 三是重大资产重组实施完毕后, 上市公司所购买资产真实实现的利润未达到预测金额的 50%; 四是内部控制制度执行不严格。; 于 2023 年 09 月 28 日收到证监会监管谈话、谈话提醒的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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, 内部制度不完善, 未依法履行职责; 于 2023 年 11 月 09 日收到证监会警示的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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 29 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 日持仓前十名证券的发行主体中, 华泰证券股份有限公司因未按规定履行客户身份识别义务; 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告; 于 2023 年 12 月 22 日收到中国人民银行江苏省分行罚款的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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 08 日收到深圳证券交易所警示的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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 08 日收到证监会警示的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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财务信息披露存在重大错误, 内部制度不完善; 于 2024 年 01 月 22 日收到上海市证监局责令改正的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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未依法履行职责；于 2024 年 01 月 24 日收到安徽证监局警示, 记入诚信档案的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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 29 日收到上海证券交易所监管(约见)谈话的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 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 02 月 01 日收到上海市证监局责令改正的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 日持仓前十名证券的发行主体中, 招商证券股份有限公司因未履行信披义务；于 2024 年 02 月 02 日收到安徽证监局警示, 记入诚信档案的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 日持仓前十名证券的发行主体中, 招商证券股份有限公司因在 2021 年以前对于从业人员行为管理存在以下问题：一是对从业人员买卖股票行为重视程度和问责力度不够。常规及专项核查频次较少，对员工行为的持续监督、警示教育力度不足；二是从业人员行为监测监控管理不到位。对员工手机号码等信息的准确性、完整性没有及时检查、核对、更新。对员工登录他人账户以及借用亲属或他人账户买卖股票的行为未予以充分关注；三是配套信息技术系统建设不足。证券账户终端使用数据记录存在缺陷，客户信息采集不完整、不及时；于 2024 年 02 月 09 日收到深圳证监局责令增加内部合规检查次数的处罚措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2024 年 03 月 31 日持仓前十名证券的发行主体中, 兴业证券股份有限公司因保荐业务违规；于 2024 年 03 月 07 日收到北京证券交易所警示, 监管关注, 监管(约见)谈话, 要求提交书面承诺的处罚措施。

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。

### 5.11.2 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	967,532.03
2	应收证券清算款	24,950,538.59

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	259,626.84
7	其他	-
8	合计	26,177,697.46

#### 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	600837	海通证券	1,978,380.00	0.01	转融通流通受限
2	000166	申万宏源	1,973,104.00	0.01	转融通流通受限
3	601688	华泰证券	1,916,460.00	0.01	转融通流通受限
4	600958	东方证券	1,907,400.00	0.01	转融通流通受限
5	601211	国泰君安	1,872,450.00	0.01	转融通流通受限
6	601377	兴业证券	1,868,640.00	0.01	转融通流通受限
7	600999	招商证券	938,112.00	0.00	转融通流通受限
8	300059	东方财富	287,447.00	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	301526	国际复材	39,475.38	0.00	新股锁定
2	301559	中集环科	21,250.40	0.00	新股锁定
3	601096	宏盛华源	17,631.00	0.00	新股锁定
4	688652	京仪装备	17,621.76	0.00	新股锁定
5	301508	中机认检	15,750.21	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	25,280,417,683.00
报告期期间基金总申购份额	3,912,300,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	4,752,000,000.00

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	24,440,717,683.00

## §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；  
华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同；  
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办公场所备投资者查阅。

### 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项



种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2024 年 4 月 19 日