

华宝中证全指证券公司交易型开放式指数  
证券投资基金  
2022 年第 3 季度报告

2022 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：2022 年 10 月 26 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 2022 年 10 月 24 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 2022 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	27,575,717,683.00 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-89,956,850.98
2. 本期利润	-3,874,211,548.11
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1487
4. 期末基金资产净值	21,591,389,655.91
5. 期末基金份额净值	0.7830

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

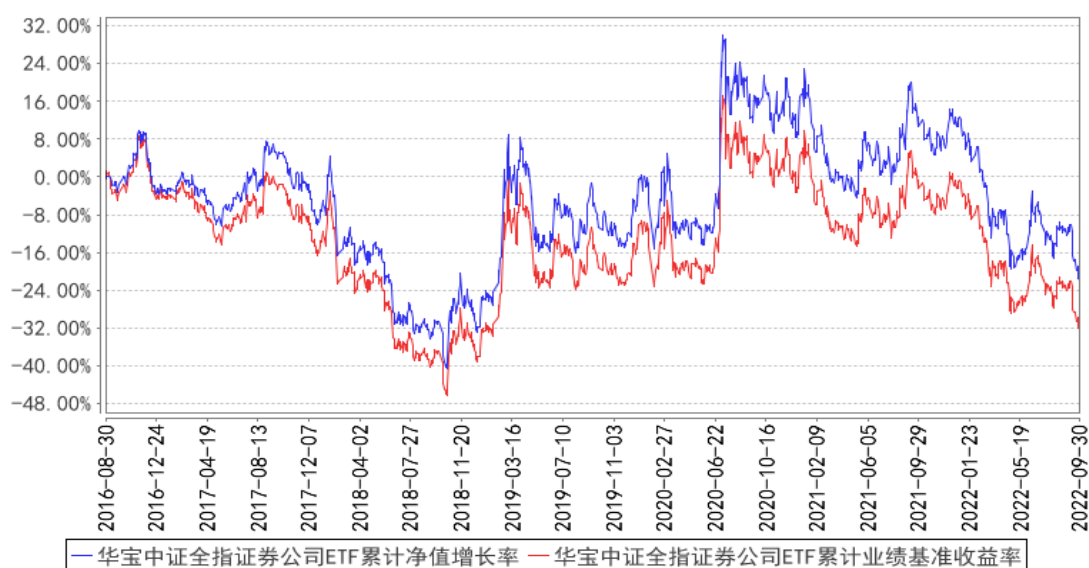
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-16.18%	1.45%	-17.48%	1.45%	1.30%	0.00%
过去六个月	-14.49%	1.72%	-16.04%	1.72%	1.55%	0.00%
过去一年	-29.29%	1.59%	-30.44%	1.59%	1.15%	0.00%
过去三年	-12.42%	1.88%	-16.08%	1.89%	3.66%	-0.01%
过去五年	-25.50%	1.94%	-31.07%	1.95%	5.57%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	-21.70%	1.82%	-32.17%	1.83%	10.47%	-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	-	13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 月起任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。
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	-	16 年	<p>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，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</p>

					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。
--	--	--	--	--	---

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 股市场日均成交额 9153 亿，相较去年同期三季度的高基数同比下降 28.77%，也比今年二季度环比下降。受二季度末的反弹行情在 7 月不再创新高，市场成交额持续走低，券商股在 7 月份明显弱于市场，短期博弈反弹告一段落，加速了券商板块的走弱。尽管八月份券商有所反弹，但是市场的疲弱，加之赛道股的低迷使得市场没有很好的赚钱效应和主题方向，压制了市场的风险偏好，小盘股和科创股的持续下跌，使得被误读的降费政策成为一个消息面的诱发因素，导致了整个板块出现情绪化急跌行情，其实背后反映出在市场成交额持续下行逼近五千多亿地量下，市场人气低迷时券商行业已处于短期情绪的冰点。截至三季度末，券商 ETF 跟踪的中证全指证券公司指数的市净率只有 1.21，位于指数上市以来的历史 3%分位点，接近 2018 年下半年的位置，彼时上证综指在 2700 点。理性的来看，现时与彼时的资本市场体量、券商资产的质量不确定性都有明显的差异。在这个时点看，踏空风险和回撤风险孰多孰少，相信每个人自有判断。我们统计自 2007 年以来历史数据看，券商 ETF 跟踪的中证全指证券公司指数在 600 点以下介入的获利空间的确定性较强，大概率能获得较好收益，具备较足的安全边际。

#### 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-16.18%，业绩比较基准收益率为-17.48%。

#### 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	21,568,601,837.27	99.61
	其中：股票	21,568,601,837.27	99.61
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	60,230,223.62	0.28

8	其他资产	25,167,026.25	0.12
9	合计	21,653,999,087.14	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 609,804,998.00 元，占基金资产净值的比例为 2.82%。

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	21,563,291,615.79	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	21,563,291,615.79	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	4,939,084.38	0.02
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	103,232.30	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	239,599.60	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	28,305.20	0.00
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	5,310,221.48	0.02

### 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	160,942,833	2,803,624,150.86	12.98
2	300059	东方财富	151,276,452	2,665,491,084.24	12.35
3	600837	海通证券	159,141,932	1,378,169,131.12	6.38
4	601688	华泰证券	97,068,348	1,176,468,377.76	5.45
5	601211	国泰君安	74,326,728	1,016,046,371.76	4.71
6	600999	招商证券	61,203,379	755,249,696.86	3.50
7	000776	广发证券	48,823,134	696,706,122.18	3.23
8	600958	东方证券	86,171,444	662,658,404.36	3.07
9	601377	兴业证券	114,852,243	625,944,724.35	2.90
10	000166	申万宏源	148,766,969	574,240,500.34	2.66

#### 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	688041	海光信息	70,208	3,593,245.44	0.02
2	688035	德邦科技	4,981	339,206.10	0.00
3	688459	哈铁科技	17,259	234,377.22	0.00
4	688073	毕得医药	2,544	223,872.00	0.00
5	688125	安达智能	3,774	196,474.44	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 2022 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于 2021 年 10 月 15 日公告,由于公司在执行奥瑞德 2017 年度持续督导过程中存在财务信息披露存在重大错误,财务信息造假,传播虚假信息,未履行公开承诺事项,违规经营,定期报告披露超期限,未履行信披义务,重大事项信息披露不及时或违规,业绩预测不准确,内部制度不完善,未依法履行职责等行为,于 2021 年 10 月 15 日收到重庆证监局责令海通证券改正,没收财务顾问业务收入 100 万元,并处以 300 万元罚款的行政处罚。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2022 年 09 月 30 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发布的研究报告《医美行业深度:举重若“轻”,求美有方》存在以下问题:一是研究报告个别内容数据列示错误、文字表述不严谨,未准确标明个别数据出处,就同一数据的列示或预测,你公司同期发布的不同研究报告存在差异。二是存在具体判断或观点论述不够严密的情况,表现为个别具体观点分析依据不充分、以偏概全,个别行业发展趋势的结论基于一家公司的财务数据推论而出、不够严密。三是底稿未记录个别数据的演算方法与过程。于 2021 年 10 月 22 日收到福建证监局采取出具警示函的行政监管措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2022 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:1.违反规定办理资本项目资金收付 2.违反规定开立 B 股资金账户 3.违反规定办理 B 股资金非本人提款业务 4.违反规定串用外汇账户于 2021 年 12 月 16 日收到国家外汇管理局广东省分局责令改正,给予警告,处罚款 94 万元人民币的行政处罚。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2022 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力同科技股份有限公司(以下简称发行人)首次公开发行股票并上市过程中,未勤勉尽责对发行人主要客户环球佳美与客户法力盈的关联关系履行充分的核查程序合并披露相关信息,涉诉专利涉及产品金额前后披露不一致且差异大,对发行人相关流水核查存在依赖发行人提供资料的情形,于 2022 年 1 月 12 日收到中国证监会采取出具警示函的监督管理措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2022 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,招商证券股份有限公司 2022 年 3 月 14 日集中交易系统发生技术故障,导致大量客户成交回报缓慢、部分

客户无法登录系统交易，并且导致部分客户报价回购交易申报未成功，引发市场高度关注。经查，故障原因系公司集中交易系统于 3 月 11 日在上线新功能时，未对程序变更进行充分的回归和性能测试，未发现系统存在严重性能问题导致，反映出公司存在程序变更管理不完善，应急处置不及时、不到位等问题。公司于 2022 年 4 月 2 日收到了深圳证监局采取责令改正的行政监管措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2022 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存在以下行为：一是 2015 年设立中信证券海外投资有限公司，未按照当时《证券法》第一百二十九条的规定报证监会批准。二是未按期完成境外子公司股权架构调整工作，存在控股平台下设控股平台、专业子公司下设专业子公司、特殊目的实体（SPV）下设子公司、股权架构层级多达 8 层等问题。三是存在境外子公司从事房地产基金管理等非金融相关业务和返程子公司从事咨询、研究等业务的问题。公司于 2022 年 6 月 2 日收到中国证监会责令你公司改正，并于收到决定之日起 3 个月内向深圳证监局提交整改报告的行政监管措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2022 年 09 月 30 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存在以下问题：一是部分场外期权合约个股挂钩标的超出当期融资融券范围，违反了《证券公司场外期权业务管理办法》第十七条的规定；二是未对部分期限小于 30 天的场外期权合约出具书面合规意见书，违反了《证券公司场外期权业务管理办法》第二十条的规定；三是场外期权业务相关内部制度不健全，内部流程执行不规范，未按要求进行衍生品准入管理。于 2022 年 6 月 2 日收到中国证监会采取责令改正的行政监督管理措施。

华宝中证全指证券公司 ETF 截止 2022 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，东方证券股份有限公司因在开展股票质押业务、子公司投资等业务过程中，未按照审慎经营的原则，有效控制和防范风险，存在部分业务决策流于形式、风险管理不到位和内部控制不健全等问题。于 2022 年 8 月 3 日收到上海证监局对公司采取出具警示函的监督管理措施。

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	2,137,656.11

2	应收证券清算款	22,691,110.60
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	338,259.54
7	其他	-
8	合计	25,167,026.25

#### 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	300059	东方财富	103,025,902.00	0.48	转融通流通受限
2	600030	中信证券	53,282,554.00	0.25	转融通流通受限
3	601377	兴业证券	30,424,080.00	0.14	转融通流通受限
4	600837	海通证券	19,375,018.00	0.09	转融通流通受限
5	601211	国泰君安	18,306,864.00	0.08	转融通流通受限
6	000776	广发证券	12,232,244.00	0.06	转融通流通受限
7	600999	招商证券	10,579,082.00	0.05	转融通流通受限
8	000166	申万宏源	8,319,072.00	0.04	转融通流通受限
9	600958	东方证券	7,863,025.00	0.04	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	688041	海光信息	3,593,245.44	0.02	新股锁定
2	688035	德邦科技	339,206.10	0.00	新股锁定
3	688459	哈铁科技	234,377.22	0.00	新股流通受限
4	688073	毕得医药	223,872.00	0.00	新股流通受限
5	688125	安达智能	196,474.44	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	24,476,717,683.00
-------------	-------------------

报告期期间基金总申购份额	6,292,200,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	3,193,200,000.00
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	27,575,717,683.00

## § 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

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 (%)
中国建设银行股份有限公司-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	1	20220701~20220930	5,845,194,487.00	1,692,000,000.00	1,018,511,400.00	6,518,683,087.00	23.64
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。</p> <p>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>							

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2022 年 7 月 2 日，基金管理人发布董事长变更公告，黄孔威担任公司董事长，朱永红不再担任公司董事长。

2022 年 10 月 15 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任向辉为公司总经理。

## § 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种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2022 年 10 月 26 日