华泰柏瑞中证银行交易型开放式指数证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 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 2026 年 7 月 1 日起至 2026 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞中证银行 ETF
场内简称	中证银行（ 扩位简称：银行 ETF 华泰柏瑞）
基金主代码	560670
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2026 年 5 月 22 日
报告期末基金份额总额	30,974,000.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。
投资策略	1、股票（含存托凭证）的投资策略；2、债券投资策略；3、金融衍生工具投资策略；4、资产支持证券的投资策略；5、融资及转融通证券出借业务
业绩比较基准	中证银行指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，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：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§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（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）
1.本期已实现收益	3,178,489.80
2.本期利润	10,139,742.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.1847
4.期末基金资产净值	34,006,199.59
5.期末基金份额净值	1.0979

注：1、上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。

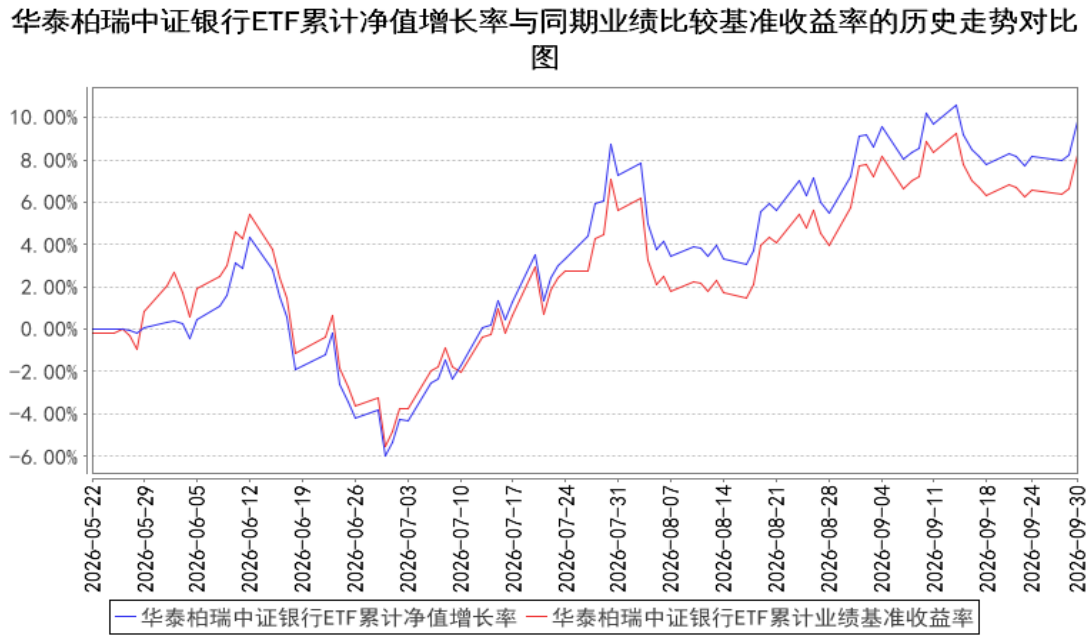
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	16.80%	1.02%	14.52%	1.04%	2.28%	-0.02%
自基金合同生效起至今	9.79%	1.05%	8.22%	1.11%	1.57%	-0.06%

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：1、图示日期为 2026 年 5 月 22 日至 2026 年 9 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

§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		
李茜	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2026 年 5 月 22 日	-	11 年	伦敦政治经济学院金融数学硕士。曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员。2019 年 11 月至 2022 年 12 月任上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2025 年 6 月任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经

					理。2021 年 2 月至 2024 年 5 月任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2026 年 4 月任华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2024 年 9 月任华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2021 年 11 月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月起任华泰柏瑞中证港股通金融服务交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 5 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 12 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 3 月起任华泰柏瑞中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月起任华泰柏瑞中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 9 月起任华泰柏瑞恒生港股通红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月至 2026 年 1 月任华泰柏瑞恒生创新药交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金的基金经理。2024 年 12 月至 2026 年 2

					月任华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 1 月至 2026 年 2 月任华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 9 月起任华泰柏瑞中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞恒生港股通红利低波动交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2026 年 3 月起任华泰柏瑞中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 5 月起任华泰柏瑞中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 7 月起任华泰柏瑞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的基金经理。

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

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定、勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，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 1 次，为投资组合的投资策略需要

而发生的同日反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾三季度，银行板块走出独立行情，单季明显上涨，基本抹平年内跌幅，相对沪深 300 收获显著超额收益。板块走强源于三重逻辑：市场风险偏好回落，高股息资产成为资金防御选择；险资资负新规落地，带来长久期资金配置红利资产的增量需求；更核心是基本面拐点得到验证，二季度银行净息差迎来四年多首次环比企稳，负债端存款利率下调对冲资产端收益下行，行业利润增速转正。信贷投放呈现结构性特征，对公贷款贡献主要增量，零售信贷偏弱，区域分化明显。行业资产质量保持稳健，不良率平稳，银行主动加大减值计提夯实风险缓冲。板块分红比例提升，红利属性进一步强化，当前估值并非极端低估，后续修复有赖 ROE 与资产质量持续改善。

展望四季度，红利价值仍是银行板块估值修复主线，存款成本仍有下行空间，息差企稳态势有望延续。公募银行持仓处于历史低位，叠加险资增配红利资产，板块具备增量资金空间。配置上优选优质城农商行与高股息国有大行，持续关注国有大行基本面边际改善机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0979 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.80%，业绩比较基准收益率为 14.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截止本报告期末，因赎回等原因，本基金自 2026-08-31 至 2026-09-30 存在连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，但无基金份额持有人数量低于 200 人的情形。

§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	32,808,289.50	96.10
	其中：股票	32,808,289.50	96.10
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	1,298,022.42	3.80
8	其他资产	35,098.38	0.10
9	合计	34,141,410.30	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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	32,807,743.20	96.48
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	32,807,743.20	96.48

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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	546.30	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	-	-
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	-	-
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	546.30	0.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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	121,400	5,008,964.00	14.73
2	601166	兴业银行	171,300	3,091,965.00	9.09
3	601398	工商银行	327,100	2,708,388.00	7.96
4	601328	交通银行	270,800	2,098,700.00	6.17
5	601288	农业银行	290,500	2,024,785.00	5.95
6	600919	江苏银行	148,100	1,833,478.00	5.39
7	600000	浦发银行	133,100	1,261,788.00	3.71
8	002142	宁波银行	33,000	1,169,190.00	3.44
9	000001	平安银行	98,200	1,136,174.00	3.34
10	601988	中国银行	146,000	982,580.00	2.89

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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	603468	津富士达	30	546.30	0.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，浦发银行（600000）在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚；农业银行（601288）在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；平安银行（000001）在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；招商银行（600036）在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；中国银行（601988）在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；兴业银行（601166）在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国银行间市场交易商协会的处罚;江苏银行(600919)在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚;工商银行(601398)在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚；交通银行(601328)在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,240.86
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	32,857.52
8	其他	-
9	合计	35,098.38

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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	603468	津富士达	546.30	0.00	新股锁定期内

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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	85,974,000.00
报告期期间基金总申购份额	51,500,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	106,500,000.00
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	30,974,000.00

§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

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§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

注：本报告期内未有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

注：无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》

4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日