华宝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：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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝中证银行 ETF
场内简称	银行 ETF 华宝
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	11,669,079,906.00 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（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）
1.本期已实现收益	108,614,237.35
2.本期利润	1,619,893,160.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.1259
4.期末基金资产净值	9,927,297,546.95
5.期末基金份额净值	0.8507

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

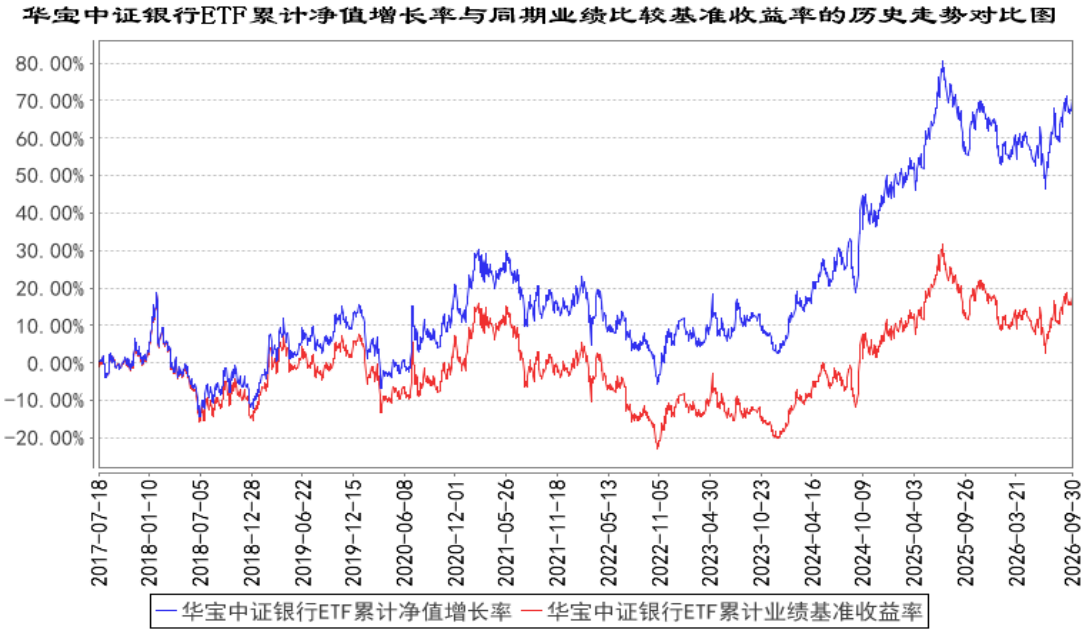
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	16.20%	1.04%	14.52%	1.04%	1.68%	0.00%
过去六个月	6.27%	1.00%	3.79%	1.00%	2.48%	0.00%
过去一年	9.29%	0.94%	5.24%	0.94%	4.05%	0.00%
过去三年	51.18%	1.02%	34.29%	1.03%	16.89%	-0.01%
过去五年	49.48%	1.05%	21.11%	1.07%	28.37%	-0.02%
过去七年	60.65%	1.12%	19.20%	1.14%	41.45%	-0.02%
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	70.14%	1.13%	17.71%	1.15%	52.43%	-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



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		
丰晨成	本基金基金经理	2025-06-04	-	17 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 月至 2026 年 4 月任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、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 月至 2025 年 1 月任华宝中证 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，2025 年 3 月至 2026 年 5 月任华宝上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 6 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、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 6 月起任华宝恒生港股通创新药精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 7 月起任华宝上证科创板人工智能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，2025 年 9 月起任华宝恒生港股通创新药精选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，2025 年 12 月起任华宝中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 2 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，2026 年 2 月起任华宝中证光伏产业指数型发起式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，本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

7 月 A 股科技成长板块领跌，带动科创、创业板指数走弱，银行板块在“风格再平衡”的跷跷板效应下反弹明显，收复了 6 月份中下旬的跌幅。外围日韩股市回调，国际油价反弹，美国通胀预期加剧，市场对美联储加息概率攀升，全球成长风格让位于价值风格。国内 10 年期国债利率持续走低，同时基金二季报披露的重仓行业分布中显示，银行板块基金重仓占比下降至历史性低位，风格再平衡过程伴随着此前欠配的再均衡，在此背景下 8-9 月间，银行股继续振荡上行。整体看，银行行业在三季度所有一级行业涨跌幅中领先，中期来看估值修复的进程仍在持续。

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 16.20%，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

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	9,870,531,970.95	99.30

	其中：股票	9,870,531,970.95	99.30
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	62,951,029.29	0.63
8	其他资产	6,302,541.86	0.06
9	合计	9,939,785,542.10	100.00

注：1、此处股票投资项含可退替代款估值增值，而“报告期末按行业分类的股票投资组合”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、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	9,870,030,600.57	99.42
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	9,870,030,600.57	99.42

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	433,929.38	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	433,929.38	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	600036	招商银行	36,216,830	1,494,306,405.80	15.05
2	601166	兴业银行	51,148,181	923,224,667.05	9.30
3	601398	工商银行	97,847,745	810,179,328.60	8.16
4	601328	交通银行	80,493,525	623,824,818.75	6.28
5	601288	农业银行	86,711,028	604,375,865.16	6.09

6	600919	江苏银行	44,143,177	546,492,531.26	5.50
7	600000	浦发银行	40,200,187	381,097,772.76	3.84
8	002142	宁波银行	9,993,833	354,081,503.19	3.57
9	000001	平安银行	29,376,259	339,883,316.63	3.42
10	601229	上海银行	30,051,131	292,998,527.25	2.95

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	301660	粤芯半导体	28,853	346,524.53	0.00
2	001232	嘉立创	230	33,784.70	0.00
3	301717	超纯应材	100	23,309.00	0.00
4	301583	托伦斯	169	14,405.56	0.00
5	301707	展芯股份	167	8,097.83	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 截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,上海浦东发展银行股份有限公司因未按规定进行国际收支申报;于 2025 年 10 月 29 日收到国家外汇管理局上海市分局警告,罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截至 2026 年 09 月 30 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相关互联网贷款、代销等业务管理不审慎；于 2025 年 10 月 31 日收到金融监管总局警告,罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截至 2026 年 09 月 30 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相关产品销售、服务收费不合规，信贷资金流向管理不审慎等；于 2025 年 10 月 31 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,上海浦东发展银行股份有限公司因相关互联网贷款、代销等业务管理不审慎；于 2025 年 10 月 31 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,宁波银行股份有限公司因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；于 2025 年 11 月 25 日收到中国人民银行宁波市分行罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截至 2026 年 09 月 30 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外包机构管理不到位、企业划型不准确等；于 2025 年 12 月 05 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截至 2026 年 09 月 30 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未经批准办理跨境资产转让业务；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；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理结汇、售汇业务；未按照规定进行国际收支统计申报；于 2025 年 12 月 18 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 截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,交通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.违反特约商户实名制管理规定；4.违反反假货币业务管理规定；5.占压财政存款或者资金；6.违反国库科目设置和使用规定；7.违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；8.未按规定履行客户身份识别义务；9.未按规定保存客户身份资料和交易记录；10.未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；11.与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户;于 2025 年 12 月 19 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 截至 2026 年 09 月 30 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:1.违反金融统计相关规定；2.违反账户管理规定；3.违反清算管理规定；4.违反特约商户实名制管理规定；5.违反反假货币业务管理规定；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；于 2025 年 12 月 19 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 截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,上海浦东发展银行股份有限公司因相关理财、代销等业务管理不审慎，员工管理不到位等；于 2025 年 12 月 19 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,上海银行股份有限公司因：以贷收费；隐匿不良贷款；提供虚假的文件资料；代销业务严重违反审慎经营规则；流动资金贷款违规被挪用；存在未按要求开放系统权限等情况，阻碍现场检查；流动资金贷款管理严重违反审慎经营规则；同业投资业务未将最终债务人纳入授信；同业客户未纳入集团统一授信；于 2026 年 01 月 28 日收到上海金融监管局罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,上海浦东发展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.违反银行卡收单业务管理规定；4.违反反假货币业务管理规定；5.占压财政存款或资金；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；于 2026 年 02 月 14 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 截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,上海浦东发展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.违反银行卡收单业务管理规定；4.违反反假货币业务管理规定；5.占压财政存款或资金；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。；于 2026 年 02 月 14 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 截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,交通银行股份有限公司因灾备恢复能力建设不足、重要信息系统应急管理不足等；于 2026 年 06 月 05 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截至 2026 年 09 月 30 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重要信息系统投产变更风险管控不到位、未按规定报告重要信息系统突发事件等；于 2026 年 06 月 05 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截至 2026 年 09 月 30 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部分机构未纳入并表管理范围、未从银行集团层面对同一客户统一授信等；于 2026 年 07 月 17 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,上海银行股份有限公司因银行承兑汇票业务背景审查不严、贷款管理严重违反审慎经营规则、部分业务手续费收入会计核算不规范、未开立独立的代理保险业务佣金收取账户；于 2026 年 08 月 03 日收到上海金融监管局警告,罚款的处罚措施。

华宝中证银行 ETF 截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,江苏银行股份有限公司因：1.违反金融统计管理规定;2.违反账户管理规定;3.违反收单业务管理规定;4.违反代收业务管理规定;5.违反数据安全管理规定;6.违反网络安全管理规定;7.违反人民币流通管理规定;8.违反反假货币业务管理规定;9.占压财政存款或者资金;10.违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定;11.未按规定履行客户身份识别义务；12.未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；13.与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户；于 2026 年 09 月 08 日收到中国人民银行警告,通报批评,罚款,没收违法所得的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析，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约定的备选股票库

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	1,694,420.33
2	应收证券清算款	4,608,121.53
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,302,541.86

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

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	301660	粤芯半导体	346,524.53	0.00	新股流通受限
2	001232	嘉立创	33,784.70	0.00	新股锁定
3	301717	超纯应材	23,309.00	0.00	新股锁定
4	301583	托伦斯	14,405.56	0.00	新股锁定
5	301707	展芯股份	8,097.83	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	14,423,679,906.00
报告期期间基金总申购份额	10,735,800,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	13,490,400,000.00
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	11,669,079,906.00

§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

2026 年 10 月 27 日