华宝创业板综合增强策略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：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 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	华宝创业板综合增强策略 ETF
场内简称	创业板综增强 ETF 华宝
基金主代码	159292
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 8 月 20 日
报告期末基金份额总额	172,189,531.00 份
投资目标	通过数量化的投资策略模型精选创业板优质股票，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获得超越业绩比较基准的超额收益。控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%。
投资策略	本基金主要投资于创业板综合指数成份股及备选成份股。本基金股票投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。
业绩比较基准	创业板综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数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	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	-16,211,298.19
2.本期利润	-42,365,027.85
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2353
4.期末基金资产净值	193,220,290.52
5.期末基金份额净值	1.1221

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

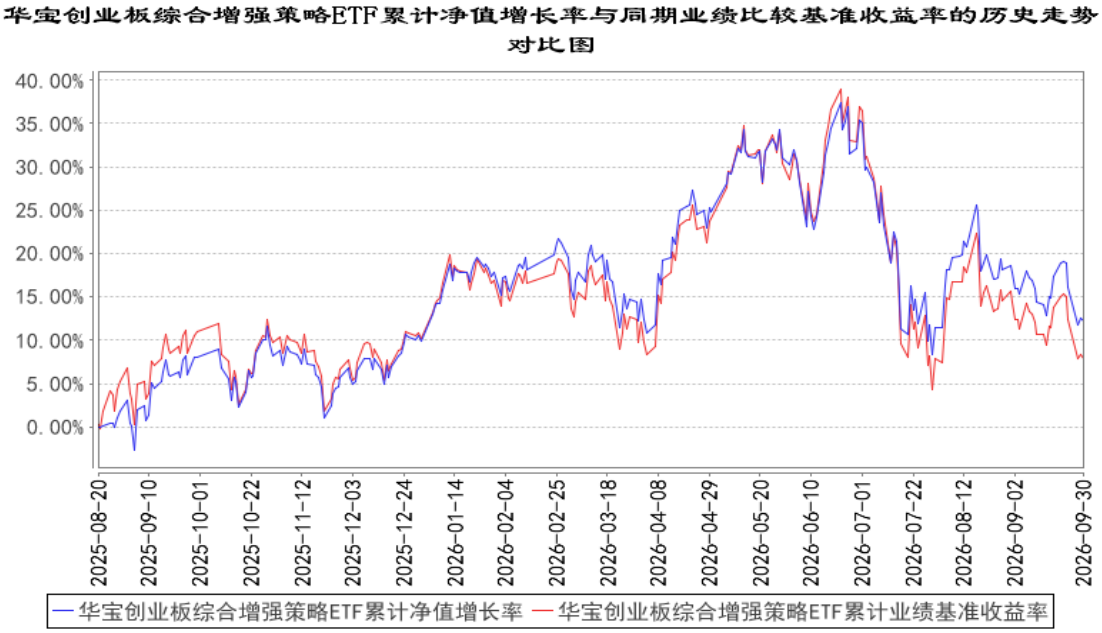
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-17.08%	2.22%	-21.18%	2.40%	4.10%	-0.18%
过去六个月	-0.05%	2.07%	-1.67%	2.22%	1.62%	-0.15%
过去一年	3.89%	1.77%	-2.86%	1.91%	6.75%	-0.14%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	12.21%	1.75%	7.88%	1.90%	4.33%	-0.15%

注：（1）基金业绩基准：创业板综合指数收益率；

（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



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 2026 年 02 月 20 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		
王正	本基金基金经理	2025-08-20	-	14 年	硕士。2012 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理量化分析师、分析师、基金经理助理等职务。2020 年 1 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2020 年 1 月至 2026 年 1 月任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 1 月至 2022 年 7 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，2021 年 1 月至 2022 年 8 月任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 1 月至 2024 年 7 月任华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至 2023 年 3 月任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理，2025 年 8 月起任华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 8 月至 2026 年 9 月任华宝科技先锋混

					合型证券投资基金基金经理，2025 年 8 月起任华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起任华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 1 月起任华宝沪深 300 增强策略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，2026 年 6 月起任华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（原：华宝创业板综指增强型发起式证券投资基金）基金经理，2026 年 8 月起任华宝质量量化选股混合型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、《华宝创业板综合增强策略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

2026 年三季度，全球资本市场在美联储重启加息周期、中东停火破裂与贸易摩擦再起的三重影响下，从二季度的极致分化转入高位震荡、风格再平衡的格局。霍尔木兹海峡通行受阻，油价冲高重新点燃通胀预期，主要发达经济体央行收紧政策，十年期美债收益率升至 5%上方，美国亦宣布新一轮关税措施，全球风险偏好显著收敛。国内经济方面，K 型非对称复苏态势延续，出口与生产端保持韧性，PPI 受输入性因素影响有所走高，CPI 则保持温和运行，但内需修复依然偏弱，消费与投资动能不足，地产链持续承压。宏观经济仍处于政策托底和结构转型的关键期。整体看，中国经济在全球不确定性中凸显韧性，政策发力与产业升级为市场提供长期支撑。

股票市场方面，三季度 A 股呈震荡调整、结构再平衡的格局，主要宽基指数普遍录得负收益。报告期内沪深 300 指数下跌 12.39%，本基金跟踪的创业板综合指数累计下跌 21.18%，创业板指下跌 27.80%，科创 50 下跌 30.70%，而上半年表现一般的红利价值风格逆势走强。行业层面，煤炭、石油石化、农林牧渔、银行、医药生物等低估值防御板块涨幅居前，电子、通信等前期领涨板块回撤幅度较大。因子层面，二季度占优的成长、动量、超预期、大市值等因子普遍回撤，价值、红利、低波、反转等因子修复，市场从高估值、高波动、高换手占优的异常状态逐步向常态化因子分布回归，虽然本季度 Beta 表现不佳，但 Alpha 环境改善，基金相对基准取得了一定的超额收益。

本基金运用量化 Alpha 多因子选股模型和风险模型进行股票筛选和权重配置，在创业板上市公司内精选业绩和估值相匹配、基本面优质的股票，并严格控制市值、行业等风险暴露，在有限的跟踪误差下力争实现稳定的超越指数的表现。

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-17.08%，业绩比较基准收益率为-21.18%。

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	183,893,192.11	95.05
	其中：股票	183,893,192.11	95.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	151,800.67	0.08
	其中：债券	151,800.67	0.08
	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	8,375,626.16	4.33
8	其他资产	1,044,002.47	0.54
9	合计	193,464,621.41	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	606,312.00	0.31
B	采矿业	1,110,165.00	0.57
C	制造业	152,162,120.43	78.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	203,190.00	0.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,422,230.00	2.81
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	11,671,699.00	6.04
J	金融业	3,297,020.00	1.71
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	582,120.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	6,716,800.00	3.48
N	水利、环境和公共设施管理业	693,648.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	375,516.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	918,825.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	183,759,645.43	95.10

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	134,552.68	0.07
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	134,552.68	0.07

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	300750	宁德时代	59,100	17,204,601.00	8.90
2	300308	中际旭创	16,100	13,015,884.00	6.74
3	300502	新易盛	19,800	7,702,200.00	3.99
4	300408	三环集团	38,100	4,470,273.00	2.31
5	300394	天孚通信	14,780	3,854,180.60	1.99
6	301200	大族数控	10,600	2,382,774.00	1.23
7	300124	汇川技术	43,200	2,242,080.00	1.16
8	300054	鼎龙股份	30,500	2,057,225.00	1.06
9	301308	江波龙	6,600	1,992,738.00	1.03
10	300014	亿纬锂能	39,000	1,942,590.00	1.01

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	4,554	54,693.54	0.03
2	301569	联亚药业	5,442	38,094.00	0.02
3	001246	力勤资源	336	16,830.24	0.01
4	301716	鸿富诚	36	14,562.72	0.01
5	301686	中塑股份	51	5,818.59	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	151,800.67	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	151,800.67	0.08

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123288	隆新转债	1,518	151,800.67	0.08

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IM2612	IM2612	1	1,435,120.00	85,880.00	-
IM2703	IM2703	5	6,991,000.00	89,040.00	-
公允价值变动总额合计（元）					174,920.00
股指期货投资本期收益（元）					-190.43
股指期货投资本期公允价值变动（元）					174,920.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要利用股指期货提高投资效率，进行有效的现金头寸管理，以更好地实现本基金的投资目标，降低跟踪误差。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

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	1,011,134.40
2	应收证券清算款	2,622.28
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	30,245.79
8	其他	-
9	合计	1,044,002.47

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	54,693.54	0.03	新股流通受限
2	301569	联亚药业	38,094.00	0.02	新股流通受限
3	001246	力勤资源	16,830.24	0.01	新股锁定
4	301716	鸿富诚	14,562.72	0.01	新股锁定
5	301686	中塑股份	5,818.59	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	187,189,531.00
报告期期间基金总申购份额	12,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	27,000,000.00

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	172,189,531.00

§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（%）
兴业银行股份有限公司-华宝创业板综合增强策略交	1	20260701~20260930	156,805,300.00	1,700,000.00	18,781,200.00	139,724,100.00	81.15

易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金							
产品特有风险							
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。 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。							

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；

华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同；

华宝创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；

华宝创业板综合增强策略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

2026 年 10 月 27 日