

新华中证科创创业 50 指数型证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§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。

基金托管人中国邮政储蓄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 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华中证科创创业 50 指数
基金主代码	026882
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026 年 6 月 16 日
报告期末基金份额总额	137,096,526.94 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	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来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进行相应调整。本基金的投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、资产支持证券投资

	策略、股指期货、国债期货交易策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。	
业绩比较基准	中证科创创业 50 指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%	
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。本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	新华中证科创创业 50 指数 A	新华中证科创创业 50 指数 C
下属分级基金的交易代码	026882	026883
报告期末下属分级基金的份额总额	109,075,323.53 份	28,021,203.41 份

§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)	
	新华中证科创创业 50 指数 A	新华中证科创创业 50 指数 C
1.本期已实现收益	-2,920,248.06	-725,270.99
2.本期利润	-31,666,234.56	-7,540,189.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2720	-0.2719

4.期末基金资产净值	80,618,576.14	20,698,822.45
5.期末基金份额净值	0.7391	0.7387

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；

2、以上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（例如基金申购费、赎回费等），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 本报告期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

新华中证科创创业 50 指数 A

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	-27.01%	2.85%	-31.91%	2.97%	4.90%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-26.09%	2.66%	-22.77%	2.98%	-3.32%	-0.32%

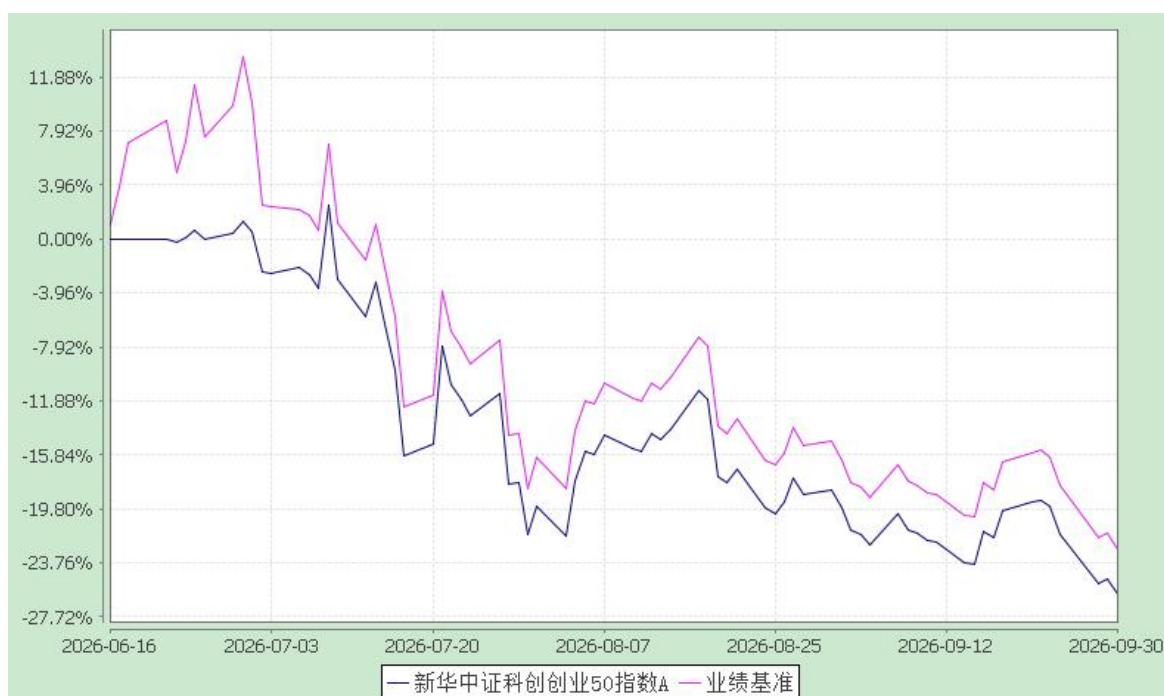
新华中证科创创业 50 指数 C

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	-27.04%	2.85%	-31.91%	2.97%	4.87%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-26.13%	2.66%	-22.77%	2.98%	-3.36%	-0.32%

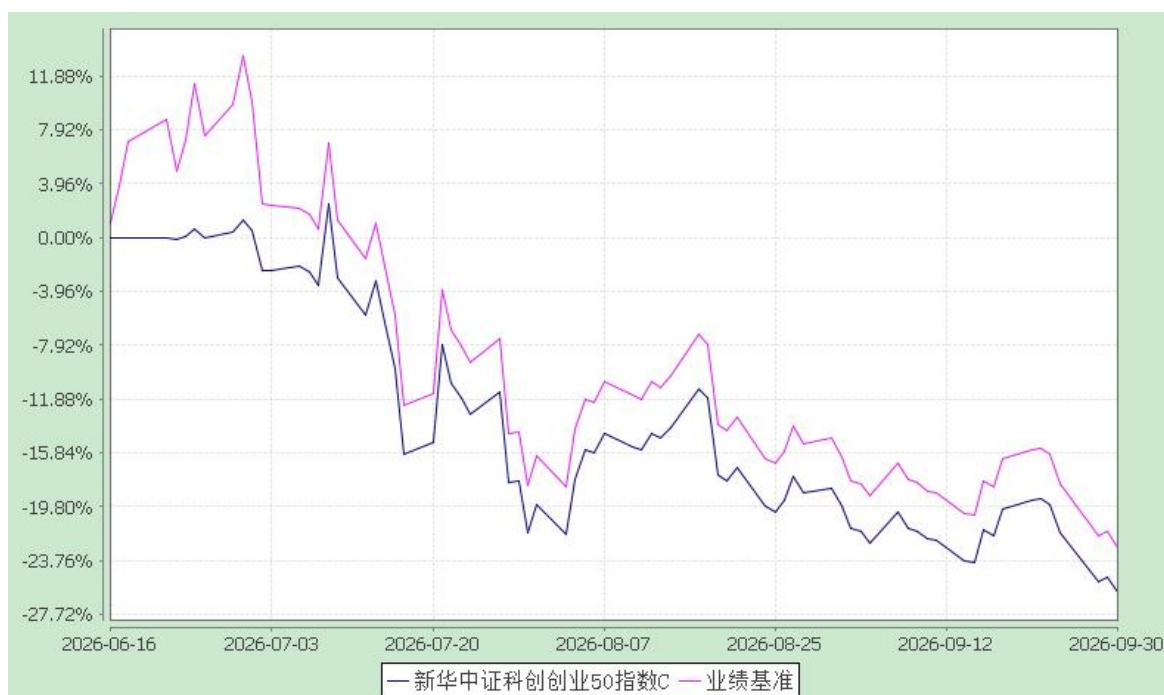
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华中证科创创业 50 指数型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2026 年 6 月 16 日至 2026 年 9 月 30 日)

新华中证科创创业 50 指数 A



新华中证科创创业 50 指数 C



注：1、本基金合同于 2026 年 6 月 16 日生效，截至本报告期末基金合同生效未满一年。

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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		
邓岳	本基金基金经理，指数与量化投资部总监，新华中证环保产业指数证券投资基金基金经理、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、新华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、新华中证云计算 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、新华北证 50 成份指数型证券投资基金基金经理。	2026-06-16	-	18	信息与信号处理专业硕士，曾任北京红色天时金融科技有限公司量化研究员，国信证券股份有限公司量化研究员，光大富尊投资有限公司量化研究员、投资经理，盈融达投资（北京）有限公司投资经理。

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《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》、《基金从业人员管理规则》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

本报告期末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，新华基金管理股份有限公司作为新华中证科创创业 50 指数证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华中证科创创业 50 指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无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

本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，通过制度、流程、系统和技术手段落实公平交易原则，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期，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，本基金未发生违法违规或对基金财产造成损失的异常交易行为；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，未发生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% 情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年 3 季度，市场整体下跌，其中科技类指数跌幅较大。上证指数触及年内低点 3741.11 后，小幅反弹进入震荡区间。全市场日交易额从季度初期的超 3 万亿元，下滑至季度后期的不足 2 万亿元，整体交易热度有所收敛。宽基指数方面，从偏大盘的沪深 300 指数 到偏小盘的中证 2000 指数全线跌幅超 10%；偏中小盘的中证 500 指数、中证 1000 指数跌幅超过 17%，呈现普跌格局，且中盘市值板块表现最弱。风格维度，以中证红利指数为代表的红利风格与大盘走势反向，中证红利指数、红利低波指数涨幅接近 10%，表现大幅领先各类宽基指数。行业层面更是冰火两重天：30 个中信一级行业中，排名靠前的银行、煤炭、农林牧渔、石油石化等偏红利防御板块涨幅均超 10%；而前期领涨的科技赛道 —— 电子、通信板块表现低迷，跌幅超过 30%。由此可见，3 季度市场主线转向防御。此前进攻属性最强的科技赛道回吐了大量涨幅；而在行情

上行阶段不受资金青睐的红利风格，展现出较强的防御属性。

3 季度市场风格突变的诱因较多。宏观层面，中东军事冲突从以伊朗为核心逐步扩散，沙特、也门相继卷入战事，对中东原油生产与运输形成显著冲击。油价上行推升美国通胀，促使美联储加息；抬升的融资成本与流动性收紧，压制科技成长风格。AI 产业自身层面，三季度负面情绪集中发酵：市场担忧 AI 资本开支，叠加 FCC 相关制裁传闻，资金对 AI 科技行业前景的预期出现明显分化。外围市场层面，高杠杆特性下，以半导体为核心的韩国股市大幅下挫，进一步拖累全球科技股情绪。多重利空叠加，加之科技股历经近两年长牛、估值处于高位，共同触发科技板块在 3 季度出现深度回调。当前科技股调整幅度已经较大，相对前期高点，性价比显著提升。

从基本面看，以 AI 标的为代表的科技股盈利增速依旧维持较高水平。各大模型厂商仍频繁出现算力供不应求的情况。AI 大模型应用正逐步从文本对话，拓展至编程助手、办公助手、图像影视创作工具、生活助理等场景。应用场景持续扩容，势必带来新增算力需求。只要 AI 大模型应用持续迭代、终端需求不断拓宽，上游模型、算力的需求就会持续增长。云服务商大规模举债采购算力硬件：悲观视角认为，这预示后续硬件采购资金存在压力；乐观视角则解读为，云服务商看好 AI 长期算力需求，愿意承担债务成本，提前储备充足算力。如果着眼于远期行业发展，AI 的核心逻辑并未破坏。就像移动互联网爆发阶段，当时市场同样充斥各类质疑，但如今我们日常使用的大量应用，都诞生于那一时期，头部平台巨头也借此成长壮大。本轮 AI 浪潮同理：人类追求效率、简化劳动的诉求，是技术持续迭代的底层驱动力。因此 AI 契合人的内在需求，未来有望像移动互联网一样深度融入日常生活，成长空间广阔。叠加国内大力推进科技创新，将科技创新打造为经济增长新引擎，中长期维度应当对科技赛道保持乐观。持续的科技创新也将持续拉动经济增长，为股市重回慢牛轨道奠定基础。

科创创业 50 指数成分股主要是科创板与创业板的龙头，是代表中国科技股总体走势的最合适的宽基指数，是投资中国科技龙头企业的非常合适的指数标的。3 季度科技股表现不佳，指数大幅下跌，大幅落后于沪深 300 指数等宽基指数。当前指数调整较深，成分股整体盈利增速仍然较快，投资性价比相比 2 季度末大幅提升。

本基金为指数基金，以对标的指数的有效跟踪为投资目标。

2026 年 3 季度，本基金采用完全复制的被动式指数投资方法，避免不必要的交易，产品紧密跟踪了指数的走势，保持了较小的跟踪误差。报告期内，标的指数发生一次成分股定期调整。

未来本基金将延续同样的被动投资策略，紧跟标的指数，争取维持与指数较小的偏离度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 0.7391 元，本报告期份额净值增长率为-27.01%，同期业绩比较基准收益率为-31.91%；C 类基金份额净值为 0.7387 元，本报告期份额净值增长率为-27.04%，同期业绩比较基准收益率为-31.91%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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	95,192,304.16	93.68
	其中：股票	95,192,304.16	93.68
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,327,579.81	6.23
7	其他资产	89,403.42	0.09
8	合计	101,609,287.39	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.1.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	85,000,173.55	83.89
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	10,192,130.61	10.06
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	95,192,304.16	93.95

5.2.2 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通过港股通投资的股票。

5.3 报告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 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	300502	新易盛	24,800	9,647,200.00	9.52
2	300308	中际旭创	11,500	9,297,060.00	9.18
3	300750	宁德时代	29,700	8,645,967.00	8.53
4	688256	寒武纪	6,185	6,240,726.85	6.16
5	688012	中微公司	14,829	4,723,777.95	4.66
6	688008	澜起科技	22,777	4,608,014.87	4.55
7	688981	中芯国际	40,616	4,548,585.84	4.49
8	688041	海光信息	18,534	4,203,511.20	4.15
9	300394	天孚通信	13,000	3,390,010.00	3.35
10	300408	三环集团	26,700	3,132,711.00	3.09

5.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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。

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。

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

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

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

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

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

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

本报告期末，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	89,403.42
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	89,403.42

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 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 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

项目	新华中证科创创业 50指数A	新华中证科创创业 50指数C
报告期期初基金份额总额	183,651,351.39	49,658,545.37
报告期期间基金总申购份额	10,196,416.91	7,530,631.69
减：报告期期间基金总赎回份额	84,772,444.77	29,167,973.65
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	109,075,323.53	28,021,203.41

§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

报告期内，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

报告期内，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

本报告期内本基金未有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

- （一）中国证监会准予新华中证科创创业 50 指数证券投资基金注册的文件
- （二）《关于申请募集新华中证科创创业 50 指数证券投资基金之法律意见书》
- （三）《新华中证科创创业 50 指数证券投资基金托管协议》
- （四）《新华中证科创创业 50 指数证券投资基金基金合同》
- （五）《新华中证科创创业 50 指数证券投资基金招募说明书》
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

新华基金管理股份有限公司

二〇二六年十月二十七日