东财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09月30日

基金管理人:东财基金管理有限公司

基金托管人:金融街证券股份有限公司

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。

基金托管人金融街证券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07月01日起至09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	创业板综指增强ETF东财
场内简称	创业板综指增强ETF东财
基金主代码	159290
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025年09月09日
报告期末基金份额总额	45,100,396.00份
投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数的基础上，通过主动化投资管理，力争获取超越指数表现的投资收益。
投资策略	本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用主动量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。 1、指数化被动投资策略 指数化被动投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整。 2、量化增强策略 量化增强策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，运用数量化的策略体系构建投资组合，

	实现在偏离度控制的基础上获取超额收益，主要包括多因子选股策略、事件驱动策略和风险优化策略。基金管理人通过考察市场风格的变化趋势，可选择适宜的策略进行配置。 （1）多因子选股策略 本基金的多因子选股策略通过对上市公司的股价走势、财务报告、卖方分析师研究报告、大数据舆情及投资者行为等信息的跟踪，综合测试各类因子在股票长期表现上所产生的超额收益，构建价值因子、盈利因子、成长因子、动量因子、流动性因子、投资者行为及大数据舆情数据因子等几大类因子。基金管理人可依据特定因子在个股选择上的有效性及因子间的相关性，并且基于市场状态，进行股票筛选，构建和优化投资组合，通过对投资组合进行定期或不定期调整，在合理的偏离度水平下追求超额收益。 （2）事件驱动策略 事件驱动策略是通过分析特定事件对上市公司价值和股价表现的影响，获取特定事件影响所带来的投资回报。基金管理人可根据对特定事件的定性和定量分析，调整成份股及个股权重，从而优化组合获得超额收益的能力。 （3）风险优化策略 本基金为指数增强型基金，在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。本基金将根据投资组合相对标的指数的偏离度等因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。在正常市场情况下，本基金追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过6.5%。
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，本基金属于指数增强型基金，跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。

基金管理人	东财基金管理有限公司
基金托管人	金融街证券股份有限公司

§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07月01日 - 2026年09月30日）
1.本期已实现收益	-930,384.04
2.本期利润	-10,726,041.98
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2326
4.期末基金资产净值	49,302,255.47
5.期末基金份额净值	1.0932

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

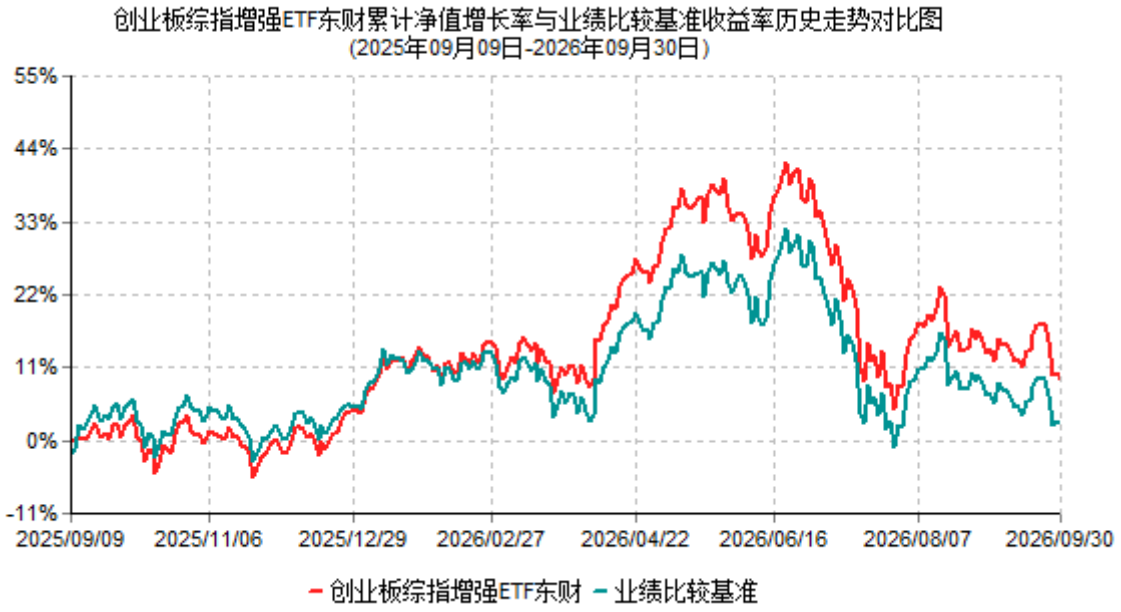
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-21.61%	2.47%	-21.18%	2.40%	-0.43%	0.07%
过去六个月	0.57%	2.22%	-1.67%	2.22%	2.24%	0.00%
过去一年	6.20%	1.91%	-2.86%	1.91%	9.06%	0.00%
自基金合同生效起至今	9.32%	1.87%	2.53%	1.89%	6.79%	-0.02%

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、本基金基金合同于2025年9月9日生效。

2、按本基金基金合同约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§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		
杨路炜	本基金基金经理	2025-09-09	-	10年	北京大学软件工程（金融工程方向）硕士。曾任兴业经济研究咨询股份有限公司分析师，现任东财基金管理有限公司基金经理。
赵肖萌	本基金基金经理	2025-09-09	-	12年	复旦大学国际贸易学硕士。曾任海通证券股份有限公司（现国泰海通证券股份有限公司）管理培训生、申万宏源证券有限公司做市经理，现任东财基金管理有限公司基金经理兼基金经理助理。

刘志豪	本基金基金经理	2026-05-29	-	5年	伊利诺伊大学香槟分校经济学、统计学硕士。曾任平安科技股份有限公司资深投资研究员，平安证券股份有限公司资产管理事业部量化投资团队投资经理、副经理职务，现任东财基金管理有限公司基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别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》等相关规定。

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

报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，未发现存在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

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于公平交易管理的相关内部制度规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。公平交易制度规范的范围包括上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动以及包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，基金管理人公平交易制度执行情况良好，未发现存在违反公平交易管理要求的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于异常交易管理的相关内部制度规定，对本基金的异常交易

行为进行监督检查，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度创业板综合指数大幅回调，累计跌幅约 28%，创指数发布以来单季度最大跌幅，市场风格呈现极致的“价值强、成长弱”分化。本轮调整核心源于前期 AI 科技赛道估值扩张后，市场定价逻辑从赛道普涨转向盈利验证；叠加海外美债收益率快速上行、风险偏好阶段性收缩，电子、半导体、电力设备等指数权重赛道集中承压。指数内部中小盘个股调整幅度大于龙头，板块内部分化加剧，资金从高估值成长标的向高股息价值板块切换，交易拥挤度得到充分释放。经过深度调整，指数估值回落至近五年低位区间，后续行情将更多依赖产业景气兑现与业绩支撑。基金采用基本面核心策略叠加量价卫星策略的方式，在市场大跌中快速收敛敞口，保持策略的稳定性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2026年09月30日，创业板综指增强ETF东财份额净值为1.0932元，报告期内基金份额净值增长率为-21.61%，同期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，本基金未发生连续二十个工作日出现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	47,327,768.08	95.66
	其中：股票	47,327,768.08	95.66
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	2,118,293.03	4.28
8	其他资产	30,245.79	0.06
9	合计	49,476,306.90	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而行业分类的合计项中不含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	347,928.00	0.71
C	制造业	37,667,989.39	76.40
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	521,016.00	1.06
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	2,826,678.20	5.73
J	金融业	994,197.29	2.02
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	1,111,295.00	2.25
N	水利、环境和公共设施管理业	483,840.00	0.98
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	360,332.00	0.73

S	综合	-	-
	合计	44,313,275.88	89.88

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	6,488.99	0.01
C	制造业	1,967,323.21	3.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	101,661.00	0.21
E	建筑业	100,650.00	0.20
F	批发和零售业	320,817.00	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	135,152.00	0.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,710.00	0.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	97,300.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	92,400.00	0.19
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	97,990.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	3,014,492.20	6.11

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	14,951	4,352,385.61	8.83
2	300308	中际旭创	4,100	3,314,604.00	6.72
3	300502	新易盛	4,680	1,820,520.00	3.69
4	300394	天孚通信	2,800	730,156.00	1.48
5	300476	胜宏科技	3,200	672,960.00	1.36
6	300033	同花顺	2,800	551,768.00	1.12
7	300757	罗博特科	1,000	533,500.00	1.08
8	300475	香农芯创	3,400	521,016.00	1.06
9	301200	大族数控	2,300	517,017.00	1.05
10	301165	锐捷网络	5,100	513,774.00	1.04

5.3.2 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	600479	千金药业	9,800	121,520.00	0.25
2	605277	新亚电子	6,500	108,745.00	0.22
3	600573	惠泉啤酒	10,100	105,242.00	0.21
4	600218	全柴动力	13,000	104,390.00	0.21
5	002014	永新股份	9,300	104,253.00	0.21

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

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

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

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本期没有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。

5.11.2 本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	应收证券清算款	-
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	30,245.79

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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	39,100,396.00
报告期期间基金总申购份额	48,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	42,000,000.00
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	45,100,396.00

§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

本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

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
机构	1	2026-07-17至2026-07-19	2,470,093.00	35,853,505.00	37,149,993.00	1,173,605.00	2.60%
产品特有风险							
本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险。							

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、中国证监会准予东财创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件

二、《东财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》

三、《东财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》

四、法律意见书

五、基金管理人业务资格批件、营业执照

六、基金托管人业务资格批件、营业执照

七、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

东财基金管理有限公司

2026年10月27日