华泰柏瑞中证动漫游戏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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	华泰柏瑞中证动漫游戏 ETF
场内简称	游戏动漫（扩位证券简称：游戏 ETF 华泰柏瑞）
基金主代码	516770
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 25 日
报告期末基金份额总额	250,048,000.00 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	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整：当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差，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。
业绩比较基准	中证动漫游戏指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金；本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证动漫游戏指数，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	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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	-34,094,928.47
2.本期利润	-7,913,422.32
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0257
4.期末基金资产净值	273,813,445.54
5.期末基金份额净值	1.0950

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。

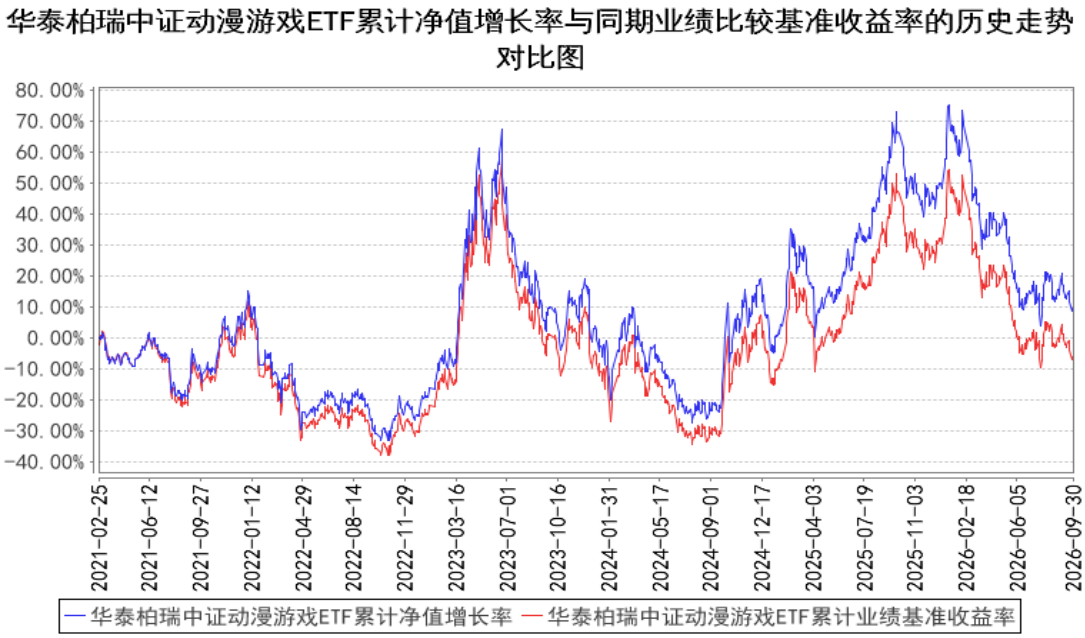
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-4.48%	2.09%	-5.67%	2.10%	1.19%	-0.01%
过去六个月	-16.77%	2.05%	-18.74%	2.07%	1.97%	-0.02%
过去一年	-33.96%	2.02%	-35.86%	2.04%	1.90%	-0.02%
过去三年	-0.26%	2.39%	-7.11%	2.44%	6.85%	-0.05%
过去五年	24.15%	2.39%	9.85%	2.45%	14.30%	-0.06%
自基金合同生效起至今	9.50%	2.32%	-6.10%	2.38%	15.60%	-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：图示日期为 2021 年 2 月 25 日至 2026 年 9 月 30 日。

§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		
胡亦清	本基金的基金经理	2025 年 4 月 1 日	2026 年 7 月 28 日	12 年	硕士毕业于美国东北大学应用数学专业。2014 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任风险分析员、高级风险分析师、指数投资部高级研究员、总监助理兼投资经理。2025 年 1 月至 2026 年 7 月任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 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 4 月至 2026 年 7 月任华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞北证 50 成份指数型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月至 2026 年 7 月任华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基

					金的基金经理。
肖承志	本基金的基金经理	2026 年 7 月 3 日	-	10 年	同济大学应用数学硕士。曾任东北证券股份有限公司金融工程分析师、德邦证券股份有限公司金工首席分析师、中邮证券有限责任公司首席金融工程分析师，2025 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司任指数投资部研究员。2026 年 7 月起任华泰柏瑞北证 50 成份指数型证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金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：1、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。

2、本报告期内兼任投资人员有产品离任情况，胡亦清离任产品情况：

① 产品类型：公募，离任数量：9 只，离任时间：2026-07-28；

② 产品类型：私募资产管理计划，离任数量：5 只；离任时间：2026-07-27、2026-07-30。

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

本基金以完全复制中证动漫游戏指数为投资策略，产品回报主要取决于标的指数收益率。2026 年三季度，受海外科技股调整、资金面扰动及风险偏好回落等因素影响，A 股市场整体跌幅较大，前期领涨的通信设备、半导体、存储等 AI 硬件方向回撤幅度居前。三季度中证全指下跌 13.79%，科创 50、创业板指分别下跌 30.70%和 27.80%。中证动漫游戏指数三季度下跌 5.67%，跑赢大盘，板块表现出较强的相对收益，其中 7 月逆势上涨 1.65%，8 月窄幅波动，9 月随市场回落。

从产业基本面看，游戏行业供给端延续改善趋势。2026 年 7 月、8 月、9 月分别发放游戏版号 197 个、215 个和 209 个，三季度国产游戏版号合计发放 608 个，进口游戏版号合计发放 13 个，整体版号数量达到 621 个，较二季度进一步增加，前三季度累计发放 1571 个，供给端仍维持较高活跃度，政策环境延续常态化和稳定化。需求端来看，游戏行业用户基础稳定、长线运营能力持续强化，头部公司依靠成熟产品矩阵、精细化运营和全球化发行，仍具备较强现金流和盈利韧性。

展望后市，我们对游戏板块仍维持相对积极的判断。一方面，版号持续发放为后续产品周期提供基础，头部厂商重点产品储备有望逐步进入测试、上线和流水验证阶段，产品周期仍是影响板块风险偏好的核心变量。另一方面，AI 对游戏研发、美术、剧情、NPC 交互、买量投放和用户运营等环节的赋能仍在深化，游戏仍是 AI 应用落地较早、商业模式较清晰、用户付费习惯较成熟的方向之一。经过三季度调整，中证动漫游戏指数市盈率（TTM）由二季度末的 24.51 倍降至 22.13 倍，估值进一步消化，若后续市场风格从 AI 硬件向 AI 应用扩散，或重点产品流水表现超预期，游戏板块有望重新获得资金关注。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

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 1.0950 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.48%，业绩比较基准收益率为-5.67%。

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，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	270,611,077.30	98.02
	其中：股票	270,611,077.30	98.02
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	5,197,553.61	1.88
8	其他资产	276,531.64	0.10
9	合计	276,085,162.55	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	10,173,345.40	3.72
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	238,487,536.72	87.10
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	21,266,342.16	7.77
S	综合	-	-
	合计	269,927,224.28	98.58

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	580,113.64	0.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	103,739.38	0.04
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	683,853.02	0.25

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	002602	世纪华通	2,937,500	40,537,500.00	14.80
2	002558	巨人网络	1,281,600	28,836,000.00	10.53
3	002517	恺英网络	1,645,300	26,341,253.00	9.62
4	002555	三七互娱	1,489,925	25,626,710.00	9.36
5	300251	光线传媒	1,411,600	15,485,252.00	5.66
6	300002	神州泰岳	1,892,931	14,935,225.59	5.45
7	603444	吉比特	40,397	13,722,456.93	5.01
8	002624	完美世界	1,308,172	12,702,350.12	4.64
9	002174	游族网络	942,163	12,427,129.97	4.54
10	300315	掌趣科技	2,607,700	10,274,338.00	3.75

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	301666	大普微	471	155,966.94	0.06
2	001248	华润新能源	11,107	103,739.38	0.04
3	301660	粤芯半导体	6,813	81,824.13	0.03
4	301569	联亚药业	8,164	57,148.00	0.02
5	001399	惠科股份	1,836	35,820.36	0.01

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，三七互娱（002555）在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所的公开谴责和中国证券监督管理委员会的处罚。

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	246,285.85

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	276,531.64

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	301666	大普微	155,966.94	0.06	新股锁定期内
2	001248	华润新能源	103,739.38	0.04	新股锁定期内
3	301660	粤芯半导体	81,824.13	0.03	新股未上市
4	301569	联亚药业	57,148.00	0.02	新股未上市
5	001399	惠科股份	35,820.36	0.01	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	331,048,000.00
报告期期间基金总申购份额	246,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	327,000,000.00
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	250,048,000.00

§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