兴业中证红利指数型证券投资基金

2026年第3季度报告

2026年09月30日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:中国农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。

基金托管人中国农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及其更新。

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	兴业中证红利指数
基金主代码	022290
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025年05月29日
报告期末基金份额总额	9,896,031.57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最小化。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券（除可转换债券和可交换债券）投资策略；5、资产支持证券的投资策略；6、可转换债券和可交换债券投资策略；7、衍生品投资策略；8、参与融资与转融通证券出借业务策略
业绩比较基准	中证红利指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业中证红利指数A	兴业中证红利指数C
下属分级基金的交易代码	022290	022291
报告期末下属分级基金的份额总额	7,012,270.85份	2,883,760.72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07月01日 - 2026年09月30日)	
	兴业中证红利指数A	兴业中证红利指数C
1.本期已实现收益	241,987.79	105,356.25
2.本期利润	1,080,706.72	415,257.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.1140	0.0987
4.期末基金资产净值	7,131,642.59	2,924,900.79
5.期末基金份额净值	1.0170	1.0143

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

兴业中证红利指数A净值表现

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	9.37%	0.92%	8.91%	0.96%	0.46%	-0.04%
过去六个月	-1.59%	0.89%	-3.86%	0.93%	2.27%	-0.04%
过去一年	2.39%	0.83%	0.63%	0.87%	1.76%	-0.04%
自基金合同	1.70%	0.76%	1.17%	0.80%	0.53%	-0.04%

生效起至今						

注：本基金的业绩比较基准为：中证红利指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

兴业中证红利指数C净值表现

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	9.32%	0.92%	8.91%	0.96%	0.41%	-0.04%
过去六个月	-1.68%	0.89%	-3.86%	0.93%	2.18%	-0.04%
过去一年	2.19%	0.83%	0.63%	0.87%	1.56%	-0.04%
自基金合同生效起至今	1.43%	0.76%	1.17%	0.80%	0.26%	-0.04%

注：本基金的业绩比较基准为：中证红利指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

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：根据本基金基金合同规定，基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。



注：根据本基金基金合同规定，基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内已使基金的投资组合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		
楼华锋	基金经理	2025-05-29	2026-08-19	16年	中国籍，上海交通大学通信与信息系统专业硕士学历，具有证券投资基金从业资格。曾就职于东方证券研究所担任金工分析师、光大证券信用业务部担任高级经理、方正证券研究所担任金融工程高级分析师；曾任银河基金管理有限公司量化与指数工作室负责人。2021年6月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。

丁小丰	基金经理	2026-08-19	-	8年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格，2018年3月起先后在国泰基金管理有限公司、招商基金管理有限公司从事行业研究和策略研究等工作，2025年8月加入兴业基金管理有限公司担任指数与量化业务团队研究员、基金经理助理，现任基金经理。

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“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；
2、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》的相关规定。

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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，本基金运作整体合法合规，未发现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，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金为被动指数基金，跟踪中证红利指数，根据基金产品合同复制跟踪中证红利成分股权重和行业配置。2026年三季度，A股市场波动加大，科技等成长板块出现调整，市场风险偏好明显收敛，中证红利指数跑出明显的超额收益。展望四季度，市场或仍将维持震荡格局，结构性机会和防御需求并存。在利率中枢下行、市场波动加大的背景下，高股息、低波动的红利资产有望持续获得资金青睐，其作为组合“压舱石”的配置价值值得重视。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业中证红利指数A基金份额净值为1.0170元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.37%，同期业绩比较基准收益率为8.91%；截至报告期末兴业中证红利指数C基金份额净值为1.0143元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.32%，同期业绩比较基准收益率为8.91%。

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数量不满二百人的情形；

本基金自2025年11月6日起至2026年9月30日止基金资产净值低于五千万，已连续六十个工作日以上。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案，采取持续营销方案。

本报告期内，本基金处于迷你期间内的信息披露费、审计费、银行间账户维护费、持有人大会费用等各类固定费用由基金管理人自主承担。

§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	9,338,173.94	92.69
	其中：股票	9,338,173.94	92.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	504,328.49	5.01
	其中：债券	504,328.49	5.01
	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	224,738.22	2.23
8	其他资产	6,885.29	0.07
9	合计	10,074,125.94	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（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	2,418,822.00	24.05
C	制造业	2,055,168.00	20.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	156,037.00	1.55
E	建筑业	244,236.00	2.43
F	批发和零售业	190,176.00	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	1,078,113.00	10.72
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	2,302,260.00	22.89
K	房地产业	77,184.00	0.77
L	租赁和商务服务业	240,170.00	2.39
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	78,812.00	0.78
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	317,365.00	3.16
S	综合	-	-
	合计	9,158,343.00	91.07

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	179,830.94	1.79
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	179,830.94	1.79

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	601919	中远海控	18,100	296,297.00	2.95
2	600256	广汇能源	32,500	216,775.00	2.16
3	603565	中谷物流	17,400	201,666.00	2.01
4	600188	兖矿能源	9,400	182,736.00	1.82
5	600546	山煤国际	13,600	178,432.00	1.77

6	601699	潞安环能	11,300	170,517.00	1.70
7	601168	西部矿业	4,600	162,610.00	1.62
8	601225	陕西煤业	6,000	156,180.00	1.55
9	601101	昊华能源	12,100	154,033.00	1.53
10	600985	淮北矿业	9,700	153,939.00	1.53

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	002326	永太科技	8,900	146,583.00	1.46
2	920599	同力股份	1,913	33,247.94	0.33

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	504,328.49	5.01
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	504,328.49	5.01

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	019827	26国债01	5,000	504,328.49	5.01

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投资，也无期间损益。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人以套期保值为目的，根据风险管理的原则，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

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

本基金投资国债期货，根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

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投资，也无期间损益。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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	4,710.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	2,174.52
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,885.29

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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	兴业中证红利指数A	兴业中证红利指数C
报告期期初基金份额总额	11,110,096.60	4,035,113.78
报告期期间基金总申购份额	1,494,875.65	3,935,325.96
减：报告期期间基金总赎回份额	5,592,701.40	5,086,679.02
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	7,012,270.85	2,883,760.72

注:申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

§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

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

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会（以下简称“本次大会”），本次大会投票表决起止时间为自2026年7月24日起至2026年8月24日17：00止。2026年8月25日，在本基金的基金托管人中国农业银行股份有限公司授权代表的监督下，本基金管理人授权的两名监督员对本次大会表决进行了计票，上海源泰律师事务所对计票过程进行了见证，上海市东方公证处对计票过程及结果进行了公证。经统计，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，因此未达到法律法规规定和《基金合同》约定的会议召开条件。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予兴业中证红利指数型证券投资基金募集注册的文件

（二）《兴业中证红利指数型证券投资基金基金合同》

（三）《兴业中证红利指数型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和营业执照

（六）基金托管人业务资格批件和营业执照

（七）中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅 。

网站：http：//www.cib-fund.com.cn

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话 4000095561

兴业基金管理有限公司

2026年10月27日