兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金

2026年中期报告

2026年06月30日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2026年08月29日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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01月01日起至06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 41
7.1 期末基金资产组合情况 41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 50
7.6 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 50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 50
7.8 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贵金属投资明细 50
7.9 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 50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 51
7.12 投资组合报告附注 51
§8 基金份额持有人信息 52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 53
§9 开放式基金份额变动 53
§10 重大事件揭示 54
10.1 基金份额持有人大会决议 54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 54
10.4 基金投资策略的改变 54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 54
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 55
10.8 其他重大事件 56
§11 影响投资者决策的其他重要信息 57
11.1 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 57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 57
§12 备查文件目录 57
12.1 备查文件目录 57
12.2 存放地点 58
12.3 查阅方式 58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金	
基金简称	兴业华证沪港深红利100指数	
基金主代码	021931	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024年11月26日	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	42,028,591.71份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴业华证沪港深红利100指数A	兴业华证沪港深红利100指数C
下属分级基金的交易代码	021931	021932
报告期末下属分级基金的份额总额	13,013,918.14份	29,014,673.57份

2.2 基金产品说明

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	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。 由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适

	当变通和调整，力求降低跟踪误差。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 1、大类资产配置；2、股票投资策略；3、债券（除可转换债券和可交换债券）投资策略；4、资产支持证券的投资策略；5、可转换债券和可交换债券投资策略；6、衍生品投资策略。
业绩比较基准	华证沪港深红利100指数收益率×95%＋银行人民币活期存款利率（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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴业基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张顺国	方圆
	联系电话	021-22211888	95559
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		40000-95561	95559
传真		021-22211997	021-62701216
注册地址		福建省福州市鼓楼区湖东路154号中山大厦A座5层507室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区银城路167号13、14层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		刘宗治	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披	中国证券报

露报纸名称	
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cib-fund.com.cn
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区银城路167号13、14层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴业基金管理有限公司	上海市浦东新区银城路167号13、14层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026年01月01日-2026年06月30日)	
	兴业华证沪港深红利100指数A	兴业华证沪港深红利100指数C
本期已实现收益	721,072.37	1,682,775.01
本期利润	-1,940,529.93	-3,774,460.94
加权平均基金份额本期利润	-0.1205	-0.0977
本期加权平均净值利润率	-10.61%	-8.63%
本期基金份额净值增长率	-12.44%	-12.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026年06月30日)	
期末可供分配利润	-437,453.14	-1,086,619.49
期末可供分配基金份额利润	-0.0336	-0.0375
期末基金资产净值	12,576,465.00	27,928,054.08
期末基金份额净值	0.9664	0.9625
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026年06月30日)	

基金份额累计净值增长率	1.14%	0.75%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

兴业华证沪港深红利100指数A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-14.92%	0.78%	-15.79%	0.81%	0.87%	-0.03%
过去六个月	-12.44%	0.88%	-12.79%	0.90%	0.35%	-0.02%
过去一年	-3.70%	0.81%	-4.13%	0.81%	0.43%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.14%	0.84%	1.70%	0.89%	-0.56%	-0.05%

注：本基金的业绩比较基准为：华证沪港深红利100指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率（税后）*5%。

兴业华证沪港深红利100指数C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-14.97%	0.78%	-15.79%	0.81%	0.82%	-0.03%
过去六个月	-12.53%	0.88%	-12.79%	0.90%	0.26%	-0.02%
过去一年	-3.96%	0.81%	-4.13%	0.81%	0.17%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.75%	0.84%	1.70%	0.89%	-0.95%	-0.05%

注：本基金的业绩比较基准为：华证沪港深红利100指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率（税后）*5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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





§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴业基金管理有限公司（以下简称“兴业基金”或“公司”）成立于2013年4月17日，是兴业银行控股下的全国性基金管理公司。公司注册资本人民币12亿元，其中，兴业银行股份有限公司出资10.8亿元，持股比例90%；中海集团投资有限公司出资1.2亿元，持股比例10%。公司业务范围主要包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。2015年兴业基金成功核准获批QDII资格；2017年2月，兴业基金获批受托管理保险资金资格。目前，兴业基金已设立了北京、上海、深圳、福州四个分公司，并设立基金子公司-兴业财富资产管理有限公司。截至2026年6月30日，兴业基金共管理128只公募基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职	离任		

		日期	日期		
楼华锋	基金经理	2024-11-26	2026-04-24	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。
徐成城	多元业务部/指数与量化业务部总经理助理、基金经理	2025-05-22	-	22年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。曾就职于闽发证券有限责任公司、国泰基金管理有限公司，历任交易员、基金经理助理、基金经理。2023年11月加入兴业基金管理有限公司，现任多元业务部/指数与量化业务部总经理助理、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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年上半年，A股市场整体科技成长风格占优，在经历了年初至4月上旬的剧烈调整后，呈现出以科技带动大盘的反弹态势：沪深300指数录得收益率近8%，中证500收益率超过20%，中证1000指数近16%。以科技资产为代表的科创50指数和创业板指的收益率则录得60%和30%以上的巨大涨幅，表现亮眼。 分行业来看，上半年表现最好的申万一级行业分别是电子和通信行业，表现较差的行业则包括钢铁、房地产和社会服务等传统行业。

本基金被动指数基金，跟踪华证沪港深红利指数，根据基金产品合同复制跟踪华证沪港深红利指数的成股份权重和行业配置，该指数为兴业基金与华证指数公司合作研发，遵循价值投资为核心原则，以为投资者提供较好的回报率与胜率为目标进行编制。指数聚焦于沪港深三地市场的高股息资产，通过股息率加权等方式筛选出具备稳定高股息特征的资产，并通过多样化的因子策略来强化指数收益特征。

本基金为指数型基金，基金管理人将继续按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，拟合指数收益表现，在确保基金产品平稳运行的前提下，努力将基金的跟踪误差控制在较低水平，以达成投资人的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业华证沪港深红利100指数A基金份额净值为0.9664元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.44%，同期业绩比较基准收益率为-12.79%；截至报告期末兴业华证沪港深红利100指数C基金份额净值为0.9625元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.53%，同期业绩比较基准收益率为-12.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026年上半年A股市场的结构较为极致，进入7月份以后市场进行了一次再平衡，红利类资产有所修复，科技成长类资产有所回落。展望后市，我们认为市场仍处在由人工

智能驱动的科技上行的周期中，中国科技、制造等领域的优势仍在强化，科技成长的叙事需要等待产业的突破带动，科技对经济发展的带动值得期待。同时，红利价值类资产作为市场的基本盘，持续带来稳定的回报，起到了稳定器的作用,提升了A股市场的配置价值。策略指数伴随着市场的演绎，行业配置也在同步调整，有望更好的帮助投资者配置市场。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。

估值委员会设主任委员一名，由分管运营的公司领导担任，副主任委员一名，由分管合规的公司领导担任，专业委员若干名，由研究部、投资管理部门（视会议议题内容选择相关投资方向部门）、风险部门、监察稽核部门、基金运营部门负责人或其指定人员组成。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。

估值委员会主要工作职责如下：制定合理、公允的估值方法；对估值方法进行讨论并作出评价，在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用；评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性，对新投资策略或新投资品种采用的估值方法作出决定；讨论、决定其他与估值相关的重大问题。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性出具意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》，收益分配后基金份额净值有可能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，兴业基金管理有限公司在兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由兴业基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	5,179,304.46	5,547,250.06
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	38,341,367.56	77,016,873.03
其中：股票投资		38,341,367.56	76,309,805.52
基金投资		-	-
债券投资		-	707,067.51
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		353,850.87	63,812.00
应收申购款		91,197.11	132,338.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		43,965,720.00	82,760,273.42
负债和净资产	**附注号**	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,373,728.07	1,213,164.82
应付管理人报酬		20,530.14	35,773.83
应付托管费		4,106.04	7,154.76
应付销售服务费		5,742.43	10,828.43
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	57,094.24	155,000.00
负债合计		3,461,200.92	1,421,921.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	42,028,591.71	73,862,599.72

未分配利润	6.4.7.8	-1,524,072.63	7,475,751.86
净资产合计		40,504,519.08	81,338,351.58
负债和净资产总计		43,965,720.00	82,760,273.42

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额总额42,028,591.71份，其中下属A类基金份额净值0.9664元，基金份额总额13,013,918.14份，下属C类基金份额净值0.9625元，基金份额总额29,014,673.57份。

6.2 利润表

会计主体：兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
一、营业总收入		-5,425,802.99	7,102,875.68
1.利息收入		4,675.73	98,612.37
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,675.73	20,835.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	77,777.24
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,683,632.31	6,486,616.00
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,566,678.76	3,735,231.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	2,129.65	74,977.21
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-

股利收益	6.4.7.14	1,114,823.90	2,676,406.84
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-8,118,838.25	514,340.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,727.22	3,307.15
减：二、营业总支出		289,187.88	685,423.94
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	154,721.64	392,174.98
2.托管费	6.4.10.2.2	30,944.34	78,435.02
3.销售服务费	6.4.10.2.3	43,701.81	132,850.18
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		-	280.00
8.其他费用	6.4.7.18	59,820.09	81,683.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,714,990.87	6,417,451.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,714,990.87	6,417,451.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,714,990.87	6,417,451.74

6.3 净资产变动表

会计主体：兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	73,862,599.72	7,475,751.86	81,338,351.58
二、本期期初净资产	73,862,599.72	7,475,751.86	81,338,351.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-31,834,008.01	-8,999,824.49	-40,833,832.50
（一）、综合收益总额	-	-5,714,990.87	-5,714,990.87
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-31,834,008.01	-3,284,833.62	-35,118,841.63
其中：1.基金申购款	29,400,316.61	4,156,591.94	33,556,908.55
2.基金赎回款	-61,234,324.62	-7,441,425.56	-68,675,750.18
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	42,028,591.71	-1,524,072.63	40,504,519.08
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	300,536,515.39	-221,307.35	300,315,208.04

二、本期期初净资产	300,536,515.39	-221,307.35	300,315,208.04
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-220,357,341.81	4,169,845.44	-216,187,496.37
（一）、综合收益总额	-	6,417,451.74	6,417,451.74
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-220,357,341.81	-2,247,606.30	-222,604,948.11
其中：1.基金申购款	44,988,984.67	829,088.84	45,818,073.51
2.基金赎回款	-265,346,326.48	-3,076,695.14	-268,423,021.62
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	80,179,173.58	3,948,538.09	84,127,711.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

刘宗治	蒲延杰	楼怡斐
_____	_____	_____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规

定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2024]1061号文准予募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为300,536,515.39份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(24)第00231号的验资报告。基金合同于2024年11月26日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据基金合同相关规定，本基金份额分为A类基金份额(以下简称“兴业华证沪港深红利100指数A”)和C类基金份额(以下简称“兴业华证沪港深红利100指数C”)两类份额。其中，兴业华证沪港深红利100指数A是指在认购/申购时收取认购/申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；兴业华证沪港深红利100指数C是指在认购/申购时不收取认购/申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股和其他非成份股(包含主板、创业板及其他国内依法发行上市的股票)、港股通标的股票、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金以标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。股票资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：华证沪港深红利100指数收益率×95％＋银行人民币活期存款利率(税后)×5％。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)自2026年1月1日至2027年12月31日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2)对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、

地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(3)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4)对证券投资基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(5)对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	9,055.42
等于：本金	9,051.01
加：应计利息	4.41
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	5,170,249.04
等于：本金	5,170,101.56
加：应计利息	147.48
减：坏账准备	-
合计	5,179,304.46

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		44,189,768.04	-	38,341,367.56	-5,848,400.48
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		44,189,768.04	-	38,341,367.56	-5,848,400.48

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	57,027.67
应付转出补差费	66.57
合计	57,094.24

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 兴业华证沪港深红利100指数A

金额单位：人民币元

项目 (兴业华证沪港深红利100指数A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,366,861.26	17,366,861.26
本期申购	7,864,116.29	7,864,116.29
本期赎回（以“-”号填列）	-12,217,059.41	-12,217,059.41
本期末	13,013,918.14	13,013,918.14

6.4.7.7.2 兴业华证沪港深红利100指数C

金额单位：人民币元

项目(兴业华证沪港深红利100指数C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	56,495,738.46	56,495,738.46
本期申购	21,536,200.32	21,536,200.32
本期赎回（以“-”号填列）	-49,017,265.21	-49,017,265.21
本期末	29,014,673.57	29,014,673.57

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。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 兴业华证沪港深红利100指数A

单位：人民币元

项目(兴业华证沪港深红利100指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,481,695.18	319,295.04	1,800,990.22
本期期初	1,481,695.18	319,295.04	1,800,990.22
本期利润	721,072.37	-2,661,602.30	-1,940,529.93
本期基金份额交易产生的变动数	-546,126.58	248,213.15	-297,913.43
其中：基金申购款	870,364.52	281,875.86	1,152,240.38
基金赎回款	-1,416,491.10	-33,662.71	-1,450,153.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,656,640.97	-2,094,094.11	-437,453.14

6.4.7.8.2 兴业华证沪港深红利100指数C

单位：人民币元

项目(兴业华证沪港深红利	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

100指数C)			
上年度末	4,669,549.43	1,005,212.21	5,674,761.64
本期期初	4,669,549.43	1,005,212.21	5,674,761.64
本期利润	1,682,775.01	-5,457,235.95	-3,774,460.94
本期基金份额交易产生的变动数	-2,772,879.90	-214,040.29	-2,986,920.19
其中：基金申购款	2,278,439.83	725,911.73	3,004,351.56
基金赎回款	-5,051,319.73	-939,952.02	-5,991,271.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,579,444.54	-4,666,064.03	-1,086,619.49

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	1,193.36
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,482.37
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	4,675.73

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	52,705,050.79
减：卖出股票成本总额	51,063,228.22
减：交易费用	75,143.81
买卖股票差价收入	1,566,678.76

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	2,180.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-51.09
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,129.65

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	709,038.25
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	700,044.00
减：应计利息总额	9,038.25
减：交易费用	7.09
买卖债券差价收入	-51.09

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期间无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,114,823.90
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,114,823.90

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-8,118,838.25
——股票投资	-8,118,672.25
——债券投资	-166.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-8,118,838.25

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	4,709.27
转换费收入	17.95
合计	4,727.22

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	39,671.58
汇划手续费	1,617.04
证券组合费	1,175.38
合计	59,820.09

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴业基金管理有限公司(以下简称"兴业基金")	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")	基金托管人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中海集团投资有限公司(以下简称"中海集	基金管理人的股东

团")	
兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富")	基金管理人控制的公司

注：本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化；下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	154,721.64	392,174.98
其中：应支付销售机构的客户维护费	73,521.95	180,713.32
应支付基金管理人的净管理费	81,199.69	211,461.66

注：支付基金管理人兴业基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	30,944.34	78,435.02

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业华证沪港深红利100指数A	兴业华证沪港深红利100指数C	合计
兴业银行	0.00	1,396.34	1,396.34
交通银行	0.00	22,964.84	22,964.84
合计	0.00	24,361.18	24,361.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业华证沪港深红利100指数A	兴业华证沪港深红利100指数C	合计
兴业基金	0.00	4,831.86	4,831.86
兴业银行	0.00	5,771.04	5,771.04
交通银行	0.00	101,355.74	101,355.74
合计	0.00	111,958.64	111,958.64

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金的销售服务费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提。其计算公式为：销售服务费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	9,055.42	1,193.36	2,373,862.76	1,923.99

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金报告期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有基金管理人的股东发行的股票兴业银行(601166.SH)21,600股，占本基金资产净值的0.88%。（上年度末，本基金持有基金管理人的股东发行的股票兴业银行(601166.SH)25,400股，占本基金资产净值的0.70%）

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601369	陕鼓动力	2026-06-29	临时停牌	9.05	2026-07-13	9.96	42,900	379,261.36	388,245.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与本基金所投资金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对各类市场影响因素分析以及投资组合积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

本基金基金管理人按照"自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工"的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。本基金基金管理人建立的风险管理体系由三层风险防范等级构成：

一级风险防范是指公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。董事会下设审计与风险管理委员会，负责公司审计风险的控制、管理、监督和评价；对公司经营的合法、合规性进行监控和检查，对经营活动进行审计。

二级风险防范是指公司内部控制与风险管理委员会、投资决策委员会和风险管理部层次对公司风险进行的预防和控制。管理层下设内部控制与风险管理委员会，对公司在经营管理和基金运作中的风险进行研究、分析与评估，制定相应风险控制制度并监督其执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各类风险。

三级风险防范是指公司各部门对自身业务工作风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及部门具体情况，制定本部门业务流程及风险控制措施。

针对金融工具所面临的相关风险，本基金基金管理人主要通过定性与定量分析相结合的方法进行管理，即依据定性分析以判断风险损失的严重程度及同类风险损失的发生频度，凭借定量分析以确定风险损失的限度及相应的置信程度，进而及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，以确保将风险控制在可承受范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金基金管理人建立了较为完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等方面的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。本基金通过对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金基金管理人旗下其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

除国债、央行票据、政策性金融债外，本基金报告期末及上年度末未持有按信用评级列示的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金基金管理人主要通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2026年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,179,304.46	-	-	-	5,179,304.46
交易性金融资产	-	-	-	38,341,367.56	38,341,367.56

应收股利	-	-	-	353,850.87	353,850.87
应收申购款	-	-	-	91,197.11	91,197.11
资产总计	5,179,304.46	-	-	38,786,415.54	43,965,720.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,373,728.07	3,373,728.07
应付管理人报酬	-	-	-	20,530.14	20,530.14
应付托管费	-	-	-	4,106.04	4,106.04
应付销售服务费	-	-	-	5,742.43	5,742.43
其他负债	-	-	-	57,094.24	57,094.24
负债总计	-	-	-	3,461,200.92	3,461,200.92
利率敏感度缺口	5,179,304.46	-	-	35,325,214.62	40,504,519.08
上年度末2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,547,250.06	-	-	-	5,547,250.06
交易性金融资产	707,067.51	-	-	76,309,805.52	77,016,873.03
应收股利	-	-	-	63,812.00	63,812.00

应收申购款	-	-	-	132,338.33	132,338.33
资产总计	6,254,317.57	-	-	76,505,955.85	82,760,273.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,213,164.82	1,213,164.82
应付管理人报酬	-	-	-	35,773.83	35,773.83
应付托管费	-	-	-	7,154.76	7,154.76
应付销售服务费	-	-	-	10,828.43	10,828.43
其他负债	-	-	-	155,000.00	155,000.00
负债总计	-	-	-	1,421,921.84	1,421,921.84
利率敏感度缺口	6,254,317.57	-	-	75,084,034.01	81,338,351.58

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
假设	利率曲线平行移动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	市场利率上升25个基点	0.00	-506.25
	市场利率下降25个基点	0.00	506.98

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的投资范围包含港股通标的股票，如果港币资产相对人民币贬值，将对基金收益产生不利影响，港币兑人民币汇率的大幅波动也会加大基金净值的波动。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	21,117,443.56	-	21,117,443.56
应收股利	-	353,850.87	-	353,850.87
资产合计	-	21,471,294.43	-	21,471,294.43
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	21,471,294.43	-	21,471,294.43
项目	上年度末 2025年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	40,519,982.88	-	40,519,982.88
应收股利	-	63,812.00	-	63,812.00
资产合计	-	40,583,794.88	-	40,583,794.88
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	40,583,794.88	-	40,583,794.88

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	港币兑人民币汇率贬值5%	-1,073,564.72	-2,029,189.74
	港币兑人民币汇率升值5%	1,073,564.72	2,029,189.74

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险可来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项，也可来源于市场整体波动。

本基金基金管理人在构建和管理投资组合过程中，通过对宏观经济情况及政策分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金基金管理人定期结合宏观及微观环境变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行动态修正，以主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，基金管理人对本基金所持仓证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量，以测试本基金所面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	38,341,367.56	94.66	76,309,805.52	93.82
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资	-	-	-	-

产－贵金属投资				
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	38,341,367.56	94.66	76,309,805.52	93.82

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票价格以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	股票价格上升5%	1,917,068.38	3,815,490.28
	股票价格下降5%	-1,917,068.38	-3,815,490.28

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	37,953,122.56	76,309,805.52
第二层次	388,245.00	707,067.51
第三层次	-	-
合计	38,341,367.56	77,016,873.03

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	38,341,367.56	87.21
	其中：股票	38,341,367.56	87.21
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	5,179,304.46	11.78
8	其他各项资产	445,047.98	1.01
9	合计	43,965,720.00	100.00

注：本报告期末，本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为21,117,443.56元，占基金净值的比例52.14%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	2,632,618.00	6.50
C	制造业	3,862,465.00	9.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	394,940.00	0.98
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,531,588.00	3.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	415,140.00	1.02
J	金融业	1,010,030.00	2.49
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	9,846,781.00	24.31

7.2.2 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	1,468,776.00	3.63
C	制造业	4,391,218.00	10.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	795,514.00	1.96
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	335,907.00	0.83
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	385,728.00	0.95
S	综合	-	-
	合计	7,377,143.00	18.21

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例（%）
原材料	1,335,981.90	3.30
非日常生活消费品	1,757,250.36	4.34
日常消费品	1,931,229.61	4.77
能源	3,295,048.54	8.14
金融	1,923,273.69	4.75
医疗保健	1,185,351.88	2.93
工业	4,445,846.89	10.98
通讯业务	1,002,523.84	2.48
公用事业	2,739,821.88	6.76
房地产	1,501,114.97	3.71
合计	21,117,443.56	52.14

注：以上分类采用国际通用的具有权威性的行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	58,300	773,058.00	1.91
1	H01919	中远海控	43,500	491,542.84	1.21
2	H01171	兖矿能源	66,000	633,433.52	1.56
2	600188	兖矿能源	24,100	428,257.00	1.06
3	H00386	中国石油化工股份	152,000	528,078.40	1.30
3	600028	中国石化	98,200	437,972.00	1.08
4	H00914	海螺水泥	30,500	444,250.30	1.10
4	600585	海螺水泥	22,000	372,900.00	0.92
5	H01088	中国神华	13,000	453,000.94	1.12
5	601088	中国神华	9,300	363,072.00	0.90

6	600398	海澜之家	136,000	711,280.00	1.76
7	H00598	中国外运	103,000	341,739.68	0.84
7	601598	中国外运	59,800	296,608.00	0.73
8	601318	中国平安	6,600	315,084.00	0.78
8	H02318	中国平安	7,000	310,376.34	0.77
9	H00857	中国石油股份	42,000	309,342.77	0.76
9	601857	中国石油	29,400	255,192.00	0.63
10	H00883	中国海洋石油	19,000	335,329.78	0.83
10	600938	中国海油	8,200	222,630.00	0.55
11	H00546	阜丰集团	129,000	529,963.15	1.31
12	H01929	周大福	54,200	513,121.97	1.27
13	600985	淮北矿业	35,600	500,180.00	1.23
14	H01800	中国交通建设	155,000	494,074.67	1.22
15	000651	格力电器	12,900	483,750.00	1.19
16	H01398	工商银行	86,000	480,290.78	1.19
17	H01186	中国铁建	119,500	474,328.18	1.17
18	H00152	深圳国际	102,500	473,620.32	1.17
19	601006	大秦铁路	100,200	461,922.00	1.14
20	601225	陕西煤业	20,900	425,315.00	1.05
21	002555	三七互娱	22,000	415,140.00	1.02
22	H00939	建设银行	58,000	406,533.51	1.00
23	002563	森马服饰	79,700	401,688.00	0.99
24	601668	中国建筑	91,000	394,940.00	0.98
25	601369	陕鼓动力	42,900	388,245.00	0.96
26	H03360	远东宏信	81,000	376,386.14	0.93
27	H00552	中国通信服务	108,000	367,709.33	0.91
28	600066	宇通客车	13,600	364,616.00	0.90

29	H00270	粤海投资	54,000	363,957.19	0.90
30	H03323	中国建材	78,000	361,768.45	0.89
31	601166	兴业银行	21,600	357,696.00	0.88
32	H02388	中银香港	9,500	349,686.92	0.86
33	H06098	碧桂园服务	82,000	346,134.55	0.85
34	H00371	北控水务集团	174,000	341,548.60	0.84
35	H01044	恒安国际	18,000	339,880.99	0.84
36	600036	招商银行	9,500	337,250.00	0.83
37	H00177	江苏宁沪高速公路	42,000	334,513.35	0.83
38	H00941	中国移动	5,000	330,700.41	0.82
39	000895	双汇发展	14,600	327,040.00	0.81
40	H01071	华电国际电力股份	100,000	323,969.15	0.80
41	H00322	康师傅控股	38,000	322,787.92	0.80
42	H00003	香港中华煤气	57,000	321,797.78	0.79
43	600295	鄂尔多斯	28,700	307,664.00	0.76
44	H00728	中国电信	82,000	304,114.10	0.75
45	H02128	中国联塑	92,000	284,467.50	0.70
46	000708	中信特钢	22,100	278,902.00	0.69
47	H00257	光大环境	70,000	277,241.16	0.68
48	H01109	华润置地	10,500	273,593.25	0.68
49	600873	梅花生物	30,800	226,380.00	0.56

7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	000983	山西焦煤	131,100	760,380.00	1.88

2	600256	广汇能源	143,400	708,396.00	1.75
3	H02602	万物云	46,500	609,044.63	1.50
4	H06110	滔搏	383,000	578,819.09	1.43
5	H00288	万洲国际	74,000	532,820.68	1.32
6	H02285	泉峰控股	34,100	491,651.41	1.21
7	002271	东方雨虹	40,400	479,548.00	1.18
8	H00390	中国中铁	160,000	459,984.08	1.14
9	H00874	白云山	36,000	444,315.44	1.10
10	601098	中南传媒	39,200	385,728.00	0.95
11	H02386	中石化炼化工程	89,500	383,234.66	0.95
12	H00836	华润电力	26,000	382,092.52	0.94
13	H02666	环球医疗	97,500	375,995.30	0.93
14	603948	建业股份	15,400	371,140.00	0.92
15	H01876	百威亚太	70,000	370,870.85	0.92
16	H06862	海底捞	40,000	368,960.04	0.91
17	H01513	丽珠医药	17,600	365,041.14	0.90
18	H01579	颐海国际	33,000	364,869.17	0.90
19	H01193	华润燃气	28,500	362,888.88	0.90
20	000538	云南白药	7,600	360,012.00	0.89
21	H00135	昆仑能源	64,000	357,425.70	0.88
22	H00956	新天绿色能源	128,000	344,640.64	0.85
23	600566	济川药业	15,200	337,288.00	0.83
24	600941	中国移动	3,900	335,907.00	0.83
25	000672	上峰材料	14,000	331,520.00	0.82
26	600273	嘉化能源	49,900	325,348.00	0.80
27	H03877	中国船舶租赁	172,000	322,683.70	0.80
28	002508	老板电器	21,600	315,792.00	0.78
29	H01898	中煤能源	36,000	307,987.83	0.76

30	300628	亿联网络	9,100	307,762.00	0.76
31	002043	兔宝宝	27,700	306,916.00	0.76
32	H00868	信义玻璃	40,000	296,349.26	0.73
33	603355	莱克电气	11,200	295,456.00	0.73
34	002833	弘亚数控	15,000	289,350.00	0.71
35	H00384	中国燃气	63,600	286,142.06	0.71
36	600803	新奥股份	17,900	282,820.00	0.70
37	600461	洪城环境	31,100	281,766.00	0.70
38	601216	君正集团	62,100	276,966.00	0.68
39	H00688	中国海外发展	26,000	272,342.54	0.67
40	603816	顾家家居	11,800	263,848.00	0.65
41	600008	首创环保	84,900	230,928.00	0.57
42	002756	永兴材料	2,300	130,272.00	0.32

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	H06110	滔搏	1,103,950.29	1.36
2	000983	山西焦煤	1,039,074.00	1.28
3	600256	广汇能源	993,954.00	1.22
4	H02602	万物云	890,138.06	1.09
5	002271	东方雨虹	780,082.00	0.96
6	603279	景津装备	674,832.00	0.83
7	H06098	碧桂园服务	596,840.11	0.73
8	H06862	海底捞	557,135.60	0.68
9	600398	海澜之家	528,726.00	0.65
10	H01579	颐海国际	506,969.95	0.62

11	H01876	百威亚太	459,798.79	0.57
12	H01193	华润燃气	448,656.86	0.55
13	603833	欧派家居	431,088.00	0.53
14	H00688	中国海外发展	394,874.70	0.49
15	H02285	泉峰控股	340,584.25	0.42
16	H00546	阜丰集团	327,039.02	0.40
17	H00152	深圳国际	326,594.22	0.40
18	601919	中远海控	313,819.00	0.39
19	H01800	中国交通建设	304,030.94	0.37
20	H00914	海螺水泥	281,592.87	0.35

注："买入金额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	H01171	兖矿能源	2,546,827.08	3.13
2	600188	兖矿能源	1,458,782.00	1.79
3	H01919	中远海控	1,075,442.59	1.32
4	600894	广日股份	1,022,230.00	1.26
5	002756	永兴材料	926,342.70	1.14
6	002032	苏泊尔	890,473.40	1.09
7	H03360	远东宏信	875,871.05	1.08
8	H00857	中国石油股份	875,503.21	1.08
9	H00598	中国外运	872,675.80	1.07
10	H01088	中国神华	870,968.93	1.07
11	H02602	万物云	800,369.05	0.98
12	600295	鄂尔多斯	778,247.08	0.96
13	H00883	中国海洋石油	754,550.93	0.93

14	H00257	光大环境	750,479.75	0.92
15	601088	中国神华	720,015.00	0.89
16	603855	华荣股份	708,278.00	0.87
17	600985	淮北矿业	705,991.00	0.87
18	H00386	中国石油化工股份	702,552.07	0.86
19	H00270	粤海投资	698,747.09	0.86
20	002572	索菲亚	685,547.00	0.84

注："卖出金额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	21,213,462.51
卖出股票收入（成交）总额	52,705,050.79

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

以套期保值为目的配置股指期货，当期货价格相对现货贴水幅度较大时增加期货多头套保额度，当期货价格相对现货贴水幅度减少时，减少期货多头套保额度。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	353,850.87
4	应收利息	-
5	应收申购款	91,197.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	445,047.98

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 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的股票。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴业华证沪港深红利100指数A	1,068	12,185.32	0.00	0.00%	13,013,918.14	100.00%
兴业华证沪港深红利100指数C	1,952	14,864.07	4,972,572.47	17.1381%	24,042,101.10	82.8619%
合计	2,941	14,290.58	4,972,572.47	11.8314%	37,056,019.24	88.1686%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。2、持有人户数（户）合计数中针对同时持有各分级基金份额的持有人算为一户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例

基金管理人所有从业人员持有本基金	兴业华证沪港深红利100指数A	669,923.16	5.1477%
	兴业华证沪港深红利100指数C	8,973.14	0.0309%
	合计	678,896.30	1.6153%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	兴业华证沪港深红利100指数A	0
	兴业华证沪港深红利100指数C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴业华证沪港深红利100指数A	10~50
	兴业华证沪港深红利100指数C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	兴业华证沪港深红利100指数A	兴业华证沪港深红利100指数C
基金合同生效日(2024年11月26日)基金份额总额	58,055,854.76	242,480,660.63
本报告期期初基金份额总额	17,366,861.26	56,495,738.46
本报告期基金总申购份额	7,864,116.29	21,536,200.32
减：本报告期基金总赎回份额	12,217,059.41	49,017,265.21

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,013,918.14	29,014,673.57

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。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2026年7月20日，黄文锋先生离任兴业基金管理有限公司副总经理。详见本公司于2026年7月21日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

2、2026年7月20日，李辉先生离任兴业基金管理有限公司总经理，由董事长刘宗治先生代为履行总经理职务。详见本公司于2026年7月21日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

3、2026年7月31日，周鸣女士担任兴业基金管理有限公司总经理助理。详见本公司于2026年8月3日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

4、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	73,918,513.30	100.00%	16,493.75	100.00%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择证券经纪机构的标准，即：i资力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币。ii财务状况良好,经营行为规范,最近一年未因发生重大违法违规行为而受到有关管理机关处罚。iii内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,合规风控能力较强，并能满足各产品运作高度保密的要求。iv具备各标准化产品运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理各标准化产品进行证券交易的需要,并能为各标准化产品提供全面的信息服务，交易能力较强。v研究综合实力较强。vi其他因素（例如，虽综合能力一般，但在某些特色领域或行业，其研究能力、深度和质量在行业领先）。

②基金管理人经内部适当程序，参照前述标准选择合作的证券经纪机构。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例

				比例				
长江证券	700,000.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金2025年第四季度报告	中国证监会规定的媒介	2026-01-22
2	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金2027年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定的媒介	2026-01-30
3	兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定的媒介	2026-02-13
4	兴业基金管理有限公司关于住所变更的公告	中国证监会规定的媒介	2026-03-27
5	兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金2025年年度报告	中国证监会规定的媒介	2026-03-28
6	兴业基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会规定的媒介	2026-03-31
7	兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金2026年第一季度报告	中国证监会规定的媒介	2026-04-22
8	兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定的媒介	2026-04-25
9	兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金招募说明书（更新）（2026年第2号）	中国证监会规定的媒介	2026-04-29

10	兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2026-04-29
11	兴业基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2026-06-16
12	兴业基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金风险评价结果及旗下部分基金风险等级调整的通知	中国证监会规定的媒介	2026-06-18
13	兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2026-06-23

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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者超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金募集注册的文件

（二）《兴业华证沪港深红利100指数型证券投资基金基金合同》

（三）《兴业华证沪港深红利100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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

12.3 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

二〇二六年八月二十九日