明亚中证1000指数增强型证券投资基金
2026年第3季度报告

2026年9月30日

基金管理人：明亚基金管理有限责任公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

报告送出日期：2026年10月26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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，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。

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	明亚中证 1000 指数增强
基金主代码	017505
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 4 月 25 日
报告期末基金份额总额	109,800,848.17 份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值；力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略：（1）指数投资策略；（2）量化增强策略（量化多因子模型、结构化风险模型、行业轮动模型、组合优化模型）；3、债券投资策略；4、衍生品投资策略（股指期货交易策略、股票期权投资策略、国债期货交易策略）；5、资产支持证券投资策略；6、可转换债券、可交换债券投资策略；7、参与融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，预期风险与预期收益高

	于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	明亚基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	明亚中证 1000 指数增强 A	明亚中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017505	017506
报告期末下属分级基金的份额总额	1,316,186.40 份	108,484,661.77 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）	
	明亚中证 1000 指数增强 A	明亚中证 1000 指数增强 C
1.本期已实现收益	-75,620.51	-5,814,099.98
2.本期利润	-185,695.91	-12,968,987.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1460	-0.1229
4.期末基金资产净值	1,586,337.14	129,101,120.55
5.期末基金份额净值	1.2053	1.1900

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、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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润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

明亚中证 1000 指数增强 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	-11.97%	1.78%	-16.31%	1.97%	4.34%	-0.19%
过去六个月	-1.88%	1.62%	-3.90%	1.78%	2.02%	-0.16%
过去一年	-1.63%	1.38%	-3.30%	1.58%	1.67%	-0.20%
过去三年	26.66%	1.46%	19.66%	1.65%	7.00%	-0.19%
自基金合同生效起至今	20.53%	1.38%	8.75%	1.58%	11.78%	-0.20%

明亚中证 1000 指数增强 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标	业绩比较基准	业绩比较基准	①－③	②－④

		准差②	收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	-12.07%	1.78%	-16.31%	1.97%	4.24%	-0.19%
过去六个月	-2.08%	1.62%	-3.90%	1.78%	1.82%	-0.16%
过去一年	-2.03%	1.38%	-3.30%	1.58%	1.27%	-0.20%
过去三年	25.17%	1.46%	19.66%	1.65%	5.51%	-0.19%
自基金合同生效起至今	19.00%	1.38%	8.75%	1.58%	10.25%	-0.20%

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





§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		
何明	基金经理、研究部总监	2023年4月25日	-	26年	武汉大学国际金融硕士、英国巴斯大学MBA，曾任国投瑞银基金管理有限公司研究部研究员、研究部总监、基金经理；2020年7月加入明亚基金，现任研究部总监、权益投资部基金经理。

注：

1、本处基金经理的“任职日期”指中国证券投资基金业协会核准任职注册的日期；

2、证券从业年限计算标准遵从《证券业从业人员资格管理办法》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

报告期内，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则的规定以及《明亚中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，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，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的情况。

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，基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，未发现违反公平交易原则的情况。

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，未出现基金参与的交易所公开竞价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%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026年三季度，中证1000指数呈现"7月急跌、8月修复、9月再回落"的宽幅震荡格局，季度跌幅超过沪深300和上证指数，但优于科创50和创业板指。三季度行业分化极为剧烈，呈现"资源红利领涨、科技制造领跌"的再平衡格局。策略配置方面，本季度继续坚持以基本面因子为主，重点配置高质量、高盈利的公司。在估值风格与成长风格的选择上，仍然采取了均衡配置加小幅轮动的思路，避免出现估值、盈利同时下跌造成超额过度回撤。选股范围保持中证1000成分股的高占比，减少了对其他指数风格的配置。超额收益来自于对价值风格、质量风格、成长风格的有效轮动。操作上增加了仓位调整的频率，尽可能紧跟指数的表现，减少跟踪误差。

展望四季度， 中证1000指数以TMT和高端制造类企业为主，科创成长属性突出，经过三季度的估值消化，盈利趋势向好的细分领域存在修复空间。我们仍然会坚持更多在高质量公司中赚取超额收益，谨慎对待市值下沉。坚持以基本面因子为主，关注业绩超预期且股价反映不充分以及专精特新"小巨人"企业中具备技术壁垒和国产替代逻辑的公司，积极运用量化模型和选股模型，主动调整组合的风险敞口，力争在与中证 1000 指数保持较小跟踪误差的前提下，创造较为稳定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末明亚中证1000指数增强A的基金份额净值为1.2053元，本报告期基金份额净值增长率为-11.97%，同期业绩比较基准收益率为-16.31%；截至本报告期末明亚中证1000指数增强C的基金份额净值为1.1900元，本报告期基金份额净值增长率为-12.07%，同期业绩比较基准收益率为-16.31%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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不满二百人或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	119,381,973.79	89.72
	其中：股票	119,381,973.79	89.72
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	796,899.86	0.60
	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	12,150,303.00	9.13
8	其他资产	738,823.39	0.56
9	合计	133,068,000.04	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	1,219,163.00	0.93
B	采矿业	6,030,227.00	4.61
C	制造业	80,501,501.39	61.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,449,916.00	1.87
E	建筑业	747,066.00	0.57
F	批发和零售业	7,980,992.00	6.11
G	交通运输、仓储和邮政业	2,467,864.00	1.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,034,110.40	9.21
J	金融业	2,209,590.00	1.69
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	1,236,048.00	0.95
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	1,293,600.00	0.99
S	综合	1,211,896.00	0.93
	合计	119,381,973.79	91.35

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

本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

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	002372	伟星新材	149,300	1,304,882.00	1.00
2	300133	华策影视	168,000	1,293,600.00	0.99
3	600335	国机汽车	239,800	1,261,348.00	0.97
4	600572	康恩贝	291,700	1,257,227.00	0.96
5	300841	康华生物	22,300	1,256,828.00	0.96
6	301510	固高科技	45,200	1,255,204.00	0.96
7	000650	仁和药业	238,700	1,250,788.00	0.96
8	300910	瑞丰新材	44,600	1,249,692.00	0.96
9	600017	日照港	440,800	1,247,464.00	0.95
10	603193	润本股份	61,600	1,247,400.00	0.95

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

本基金投资股指期货，根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过参与股指期货交易，实现管理市场风险和改善投资组合风险收益特性的目的。

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

本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理原则，以套期保值为目的。基金管理人将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，适度参与国债期货交易。

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

本报告期内，本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

本基金投资的前十名股票，没有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	738,823.39
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	738,823.39

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 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

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算结果四舍五入，分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	明亚中证 1000 指数增强 A	明亚中证 1000 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	1,054,945.61	91,614,134.05
报告期期间基金总申购份额	750,865.82	58,924,951.11
减:报告期期间基金总赎回份额	489,625.03	42,054,423.39
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	1,316,186.40	108,484,661.77

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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

单位：份

项目	明亚中证 1000 指数增强 A	明亚中证 1000 指数增强 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	18,763.12	-
报告期期间买入/申购总份额	0.00	-
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	18,763.12	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.43	-

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，本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（%）
产品特有风险							
1、大额赎回风险 本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致： （1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； （2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平； （3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动； （4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略； （5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。 2、大额申购风险 若投资者大额申购，基金所投资的标的资产未及时准备，导致净值涨幅可能会因此降低。							

注：本报告期内不存在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

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；

2、《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；

3、《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；

4、《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要》；

5、《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心 T1 写字楼 1804B

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人办公场所或登录基金管理人网站：www.mingyafunds.com 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，可致电基金管理人全国统一客户服务电话：4008-785-795。

明亚基金管理有限责任公司

2026 年 10 月 26 日