
财通资管中证500指数增强型证券投资基金

2026年第1季度报告

2026年03月31日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2026年04月22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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年4月17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01月01日起至03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	财通资管中证500指数增强
基金主代码	026083
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025年12月19日
报告期末基金份额总额	306,650,229.87份
投资目标	本基金为指数增强型基金，在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、股票投资策略；2、港股通标的股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、金融衍生产品投资策略；7、融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	中证500指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其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。本基金为指数增强型基金，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。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	财通证券资产管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	财通资管中证500指数增强A	财通资管中证500指数增强C
下属分级基金的交易代码	026083	026084
报告期末下属分级基金的份额总额	79,944,762.61份	226,705,467.26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01月01日 - 2026年03月31日)	
	财通资管中证500指数增强A	财通资管中证500指数增强C
1.本期已实现收益	11,672,707.22	28,268,568.99
2.本期利润	8,866,630.66	11,804,971.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0895	0.0461
4.期末基金资产净值	80,886,478.00	229,120,321.61
5.期末基金份额净值	1.0118	1.0107

注：1、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。

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。

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

财通资管中证500指数增强A净值表现

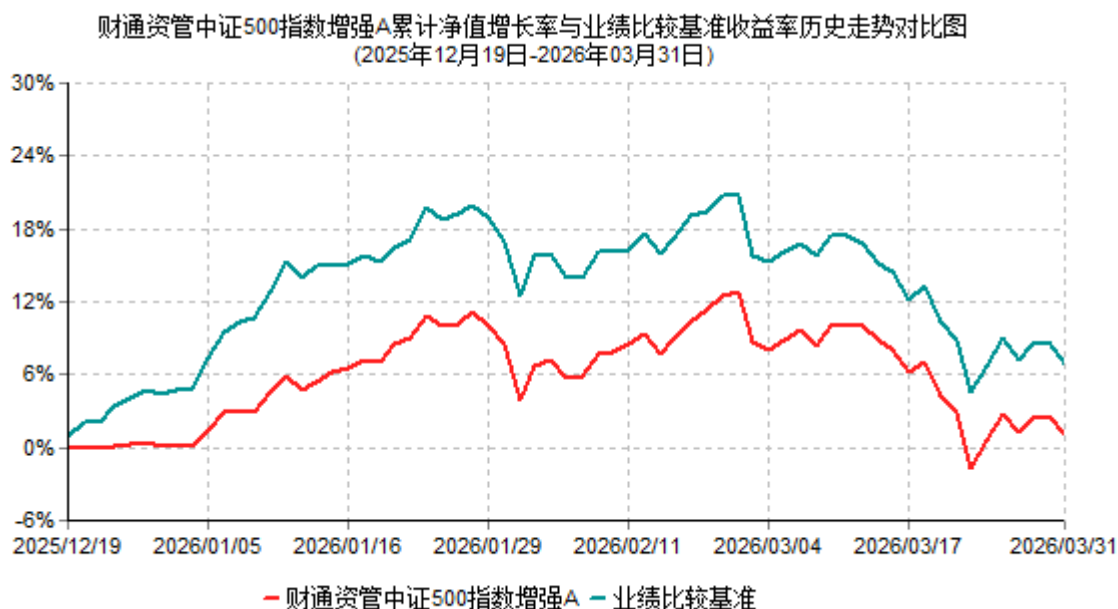
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去三个月	1.01%	1.50%	1.97%	1.59%	-0.96%	-0.09%
自基金合同生效起至今	1.18%	1.39%	6.94%	1.50%	-5.76%	-0.11%

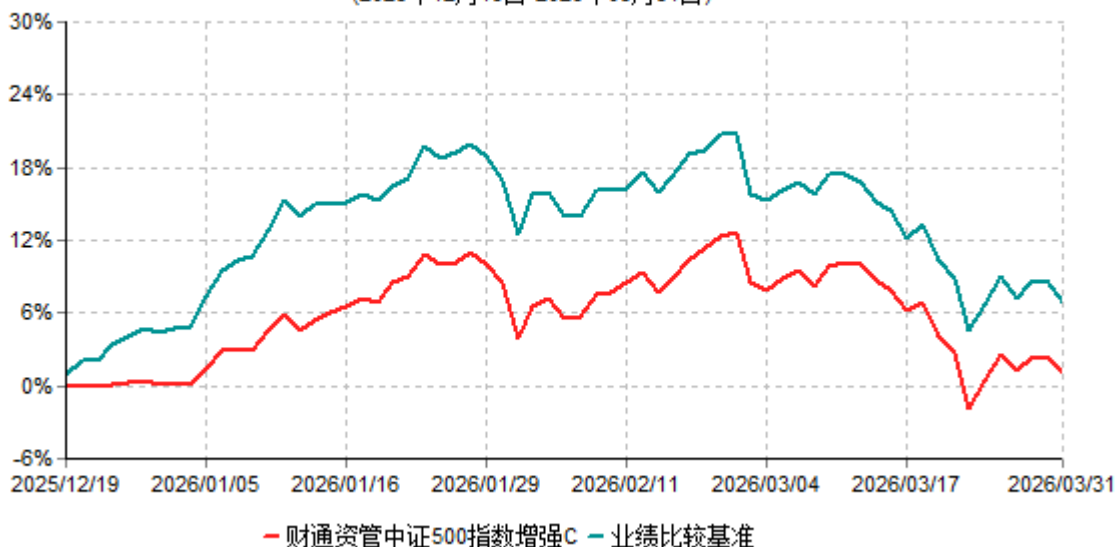
财通资管中证500指数增强C净值表现

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	0.91%	1.50%	1.97%	1.59%	-1.06%	-0.09%
自基金合同生效起至今	1.07%	1.39%	6.94%	1.50%	-5.87%	-0.11%

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



财通资管中证500指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年12月19日-2026年03月31日)



注：1、本基金合同于2025年12月19日生效，截止报告期末本基金合同生效未满一年。
2、本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月，报告期末本基金未建仓完毕。

§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		
王浩冰	本基金基金经理、财通资管行业精选混合型证券投资基金、财通资管均衡价值一年持有期混合型证券投资基金、财通资管均衡臻选混合型证券投资基金和财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金基金经理。	2025-12-19	-	13	硕士研究生学历、硕士学位。曾在中信证券股份有限公司、华商基金管理有限公司、华泰资产管理有限公司、中庚基金管理有限公司、创金合信基金管理有限公司工作。2023年8月加入财通证券资产管理有限公司，曾任权益公募投资部权益投资副总监，现任权益投资副总监、权益公募投资二部副总经理。
杨宸祎	本基金基金经理和财通资管量化选股	2025-12-22	-	4	硕士研究生学历、硕士学位。曾在华创证券有限责任

	股票型发起式证券投资基金基金经理。				公司工作。2025年5月加入财通证券资产管理有限公司，曾任量化及多资产投资部研究员，现任量化及多资产投资部基金经理。
--	-------------------	--	--	--	--

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

期末本基金基金经理无同时管理私募资产管理计划的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《财通资管中证500指数增强型证券投资基金基金合同》、《财通资管中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等规定。

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，未出现涉及本基金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5%的情况，本基金与本公司管理的其他基金在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026年第一季度，中证500指数整体呈现先扬后抑走势。年初1至2月，在政策预期与流动性支持下，指数迎来一波快速上行；进入3月后，随着全球地缘政治局势再度趋紧，前期涨幅较大的高估值板块面临较大获利了结压力，市场整体出现明显调整，短期避险情绪有所升温。

在风格表现上，成长风格在年初的上涨阶段表现相对占优，但近期受市场整体回调与风险偏好收敛影响，其调整幅度也更为显著，表明弹性较高的板块在震荡环境中波动性更大。

展望下一季度，当前市场心态尚未稳定，短期来看指数或维持震荡，等待局势清晰及一季报验证。中期来看，经济温和复苏背景下，反弹强度需看盈利修复进度，预计4月起市场重心将转向业绩兑现。在全球避险情绪下，中国资产的安全属性可能带来阶段性溢价机会。

策略上，我们将继续紧密跟踪基准指数，同时在结构上采取均衡的配置思路。一方面，关注那些具备财务边际改善信号、估值处于合理区间的行业与个股，以增强组合的稳健性，另一方面，在风格层面保持中盘均衡偏好，力求在控制波动的同时，捕捉市场结构性机会，争取实现可持续的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管中证500指数增强A基金份额净值为1.0118元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.01%，同期业绩比较基准收益率为1.97%；截至报告期末财通资管中证500指数增强C基金份额净值为1.0107元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.91%，同期业绩比较基准收益率为1.97%。

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	280,391,335.28	90.20
	其中：股票	280,391,335.28	90.20
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	27,669,339.28	8.90
8	其他资产	2,792,071.49	0.90
9	合计	310,852,746.05	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	9,813,152.00	3.17
C	制造业	169,265,910.54	54.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,914,183.00	2.23
E	建筑业	1,769,372.00	0.57
F	批发和零售业	2,475,056.00	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	55,625.00	0.02
H	住宿和餐饮业	2,506,971.00	0.81
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	20,736,727.27	6.69
J	金融业	8,268,832.00	2.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	587,852.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	4,119,516.95	1.33
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	221,190.00	0.07

	合计	226,734,387.76	73.14
--	----	----------------	-------

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	1,322,136.74	0.43
C	制造业	42,289,968.74	13.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	548,405.00	0.18
E	建筑业	132,997.00	0.04
F	批发和零售业	54,120.00	0.02
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	3,388,090.04	1.09
J	金融业	3,348,092.00	1.08
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	83,666.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	2,318,228.00	0.75
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	126,940.00	0.04
Q	卫生和社会工作	44,304.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	53,656,947.52	17.31

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	002738	中矿资源	53,300	3,960,190.00	1.28
2	000933	神火股份	117,900	3,631,320.00	1.17
3	002008	大族激光	58,500	3,584,880.00	1.16
4	600487	亨通光电	65,900	3,470,294.00	1.12
5	002558	巨人网络	109,600	3,456,784.00	1.12
6	688002	睿创微纳	33,384	3,378,460.80	1.09
7	002271	东方雨虹	206,000	3,153,860.00	1.02
8	600352	浙江龙盛	238,800	3,106,788.00	1.00
9	601233	桐昆股份	167,100	3,016,155.00	0.97
10	002402	和而泰	100,300	2,999,973.00	0.97

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	600201	生物股份	175,100	2,521,440.00	0.81
2	301257	普蕊斯	41,800	2,318,228.00	0.75
3	600362	江西铜业	52,500	2,257,500.00	0.73
4	000725	京东方A	577,000	2,256,070.00	0.73
5	605196	华通线缆	38,500	1,812,580.00	0.58

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

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市 值(元)	公允价值变 动(元)	风险说明
IC2604	IC2604	8	12,146, 240.00	-664,874.67	-
公允价值变动总额合计(元)					-664,874.67
股指期货投资本期收益(元)					714,021.44
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-680,514.67

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，同时本着谨慎原则，适度参与股指期货交易。本基金将通过对现货市场和期货市场运行形势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

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

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与国债期货交易。本基金将结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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中，北京东方雨虹防水技术股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会北京监管局、深圳证券交易所的处罚。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资有严格的投资决策流程控制，本基金对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上，本基金严格执行公司个券审核流程。在对该证券的持有过程中，研究员密切关注证券发行主体动向，在上述处罚发生时及时分析其对该投资决策的影响。经过分析认为此事件对该证券发行主体的财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，因此不影响对该证券基本面和投资价值的判断。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,457,548.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,334,522.69
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,792,071.49

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，各比例的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

	财通资管中证500指数	财通资管中证500指数
--	-------------	-------------

	增强A	增强C
报告期期初基金份额总额	332,145,359.28	595,673,096.56
报告期期间基金总申购份额	35,445,257.72	138,369,147.86
减：报告期期间基金总赎回份额	287,645,854.39	507,336,777.16
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	79,944,762.61	226,705,467.26

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§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

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§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

本基金本报告期内未出现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

报告期内，经本基金管理人第三届董事会第二十四、二十五次会议审议通过并按规定备案，自2026年1月1日起邹广航先生担任副总经理兼财务负责人。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、财通资管中证500指数增强型证券投资基金相关批准文件
- 2、财通证券资产管理有限公司营业执照、公司章程
- 3、财通资管中证500指数增强型证券投资基金托管协议
- 4、财通资管中证500指数增强型证券投资基金基金合同
- 5、财通资管中证500指数增强型证券投资基金招募说明书
- 6、本报告期内按照规定披露的各项公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层
浙江省杭州市上城区新业路300号中国人寿大厦2幢22层

9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：400-116-7888

公司网址：www.ctzg.com

财通证券资产管理有限公司

2026年04月22日