

财通资管中证 500 指数增强型证券投资基金
2026 年第 2 季度报告

2026 年 06 月 30 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 07 月 21 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约定，于 2026 年 07 月 16 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 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

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	192,930,596.62 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	56,620,790.50 份	136,309,806.12 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 04 月 01 日-2026 年 06 月 30 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	3,645,761.54	11,692,310.84
2. 本期利润	9,864,606.50	29,063,808.31
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1711	0.1578
4. 期末基金资产净值	65,708,212.89	157,856,651.00
5. 期末基金份额净值	1.1605	1.1581

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

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	14.70%	1.44%	17.61%	1.56%	-2.91%	-0.12%
过去六个月	15.85%	1.47%	19.93%	1.58%	-4.08%	-0.11%
自基金合同生效起 至今	16.05%	1.41%	25.78%	1.53%	-9.73%	-0.12%

财通资管中证 500 指数增强 C

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	14.58%	1.44%	17.61%	1.56%	-3.03%	-0.12%
过去六个月	15.63%	1.47%	19.93%	1.58%	-4.30%	-0.11%
自基金合同生效起 至今	15.81%	1.41%	25.78%	1.53%	-9.97%	-0.12%

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



注：1、本基金合同于 2025 年 12 月 19 日生效，截至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，报告期末本基金已建仓完毕，截至建仓期结束，各项资产配置比例符合本基金基金合同约定。

§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		
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、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、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 年 12 月 19 日	-	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、权益投资副总监、

					权益公募投资二部副总经理，现任权益投资副总监、权益公募投资一部兼二部副总经理。
杨宸祎	本基金基金经理和财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。	2025 年 12 月 22 日	-	4	硕士研究生学历、硕士学位。曾在华创证券有限责任公司工作。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场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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年第二季度，中证 500 指数在宽幅震荡格局中录得阶段性上行，上半年累计涨幅达 20.97%。当前指数估值已触及近五年以来峰值位置，这在一定程度上映射出市场交易活跃度与情绪温度的提升，后续行情演绎或从“估值修复”主导逐步向“业绩验证”阶段过渡。在海外流动性环境仍存边际收敛预期的背景下，前期估值扩张较快的板块，或需经历业绩验证与估值再平衡的过程；其后续上行空间的拓展，或更取决于盈利端能否提供持续且实质性的支撑，需关注业绩兑现节奏与估值匹配度的动态变化。

当前宏观环境与资金面的交互作用，或正对市场风格产生阶段性影响。一方面，尽管市场对地缘政治因素的边际反应有所钝化，但海外货币政策预期仍存变数，美债收益率面临的上行压力尚未完全解除。这一外部流动性环境或对利率敏感型板块构成一定制约，同时也可能使部分高估值科技板块面临估值再审视的风险。另一方面，伴随季末时点临近，资金对组合均衡性的诉求有所提升，前期分化显著的成长与价值风格相对强弱趋于收敛，市场或呈现向均衡状态过渡的特征。

展望三季度，随着盈利验证窗口期的开启，市场或呈现更显著的结构性分化特征。相较于普涨式的估值修复，后续行情的持续性或更取决于细分领域盈利改善的节奏与质量；若部分前期表现活跃板块的业绩兑现程度不及预期，则不排除面临估值修正的可能。在此背景下，资金配置重心或倾向于向具备基本面支撑的品种适度倾斜。往后看，7 至 8 月中报密集披露期的业绩验证情况，以及海外美债收益率的演变路径，仍是影响市场中期走向的关键观测变量，需保持密切跟踪与动态评估，并视信息更新适时修正判断。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末财通资管中证 500 指数增强 A 份额净值为 1.1605 元，本报告期财通资管中证 500 指数增强 A 份额净值增长率为 14.70%，同期业绩比较基准收益率为 17.61%；截至本报告期末财通资管中证 500 指数增强 C 份额净值为 1.1581 元，本报告期财通资管中证 500 指数增强 C 份额净值增长率为 14.58%，同期业绩比较基准收益率为 17.61%。

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	210,203,349.08	86.89
	其中：股票	210,203,349.08	86.89
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	30,363,080.39	12.55
8	其他资产	1,366,264.90	0.56
9	合计	241,932,694.37	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	60,704.00	0.03
B	采矿业	7,263,214.00	3.25
C	制造业	133,051,251.87	59.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,794,236.00	0.80
E	建筑业	655,247.00	0.29
F	批发和零售业	2,053,187.00	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	853,015.00	0.38
H	住宿和餐饮业	823,942.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,771,023.55	7.05
J	金融业	3,871,764.00	1.73
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,046,077.00	0.47
M	科学研究和技术服务业	1,946,945.70	0.87

N	水利、环境和公共设施管理业	2,186,932.00	0.98
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	171,377,539.12	76.66

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	153,692.74	0.07
C	制造业	34,723,120.14	15.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	573,342.00	0.26
F	批发和零售业	1,762,288.00	0.79
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	1,613,367.08	0.72
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	38,825,809.96	17.37

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	001309	德明利	5,300	4,997,370.00	2.24
2	300604	长川科技	14,600	4,984,732.00	2.23
3	300857	协创数据	12,840	4,364,316.00	1.95
4	002281	光迅科技	15,500	3,982,570.00	1.78
5	002008	大族激光	26,400	3,962,904.00	1.77
6	688002	睿创微纳	18,834	2,913,431.46	1.30
7	300757	罗博特科	4,600	2,847,400.00	1.27
8	001389	广合科技	11,900	2,823,275.00	1.26
9	688220	翱捷科技	22,102	2,747,720.64	1.23
10	601869	长飞光纤	5,000	2,729,500.00	1.22

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	688766	普冉股份	4,319	3,310,945.40	1.48
2	301308	江波龙	3,459	2,434,444.20	1.09
3	300308	中际旭创	1,600	2,032,000.00	0.91
4	002803	吉宏股份	68,200	1,762,288.00	0.79
5	603317	天味食品	131,000	1,704,310.00	0.76

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
IC2607	中证 500 股指期货	1	1,785,640.00	63,672.00	-
公允价值变动总额合计（元）					63,672.00
股指期货投资本期收益（元）					598,373.88
股指期货投资本期公允价值变动（元）					728,546.67

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 基金投资前十名证券的发行主体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、处罚说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本

基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

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中，没有超出基金合同约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	214,276.80
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,151,988.10
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	1,366,264.90

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的情况。

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

项目	财通资管中证 500 指数增强 A	财通资管中证 500 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	79,944,762.61	226,705,467.26

报告期期间基金总申购份额	31,764,043.64	60,563,889.20
减：报告期期间基金总赎回份额	55,088,015.75	150,959,550.34
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	56,620,790.50	136,309,806.12

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

2026 年 6 月，基金托管人中信银行股份有限公司聘任王坚为资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。

§ 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 07 月 21 日