财通资管中证全指红利质量交易型开放式指数证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 月 30 日

基金管理人：财通证券资产管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 22 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 07 月 16 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	财通资管中证全指红利质量 ETF
基金主代码	561490
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2026 年 07 月 16 日
报告期末基金份额总额	76,631,257.00 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的最小化。
投资策略	1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、金融衍生产品投资策略；7、参与融资及转融通证券出借业务策略
业绩比较基准	中证全指红利质量指数收益率
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	财通证券资产管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司

§ 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 16 日-2026 年 09 月 30 日）
1.本期已实现收益	9,828,306.06
2.本期利润	7,004,480.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0439
4.期末基金资产净值	74,897,314.08
5.期末基金份额净值	0.9774

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、本基金合同于 2026 年 07 月 16 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一季度。

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

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
自基金合同生效起至今	-2.26%	0.71%	-1.29%	1.04%	-0.97%	-0.33%

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：1、本基金合同于 2026 年 07 月 16 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，本报告期本基金处于建仓期内。

§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		
王剑	本基金基金经理、财通资管沪深 300 指数增强型证券投资基金、财通资管璟兴债券型证券投资基金和财通资管双泰债券型证券投资基金基金经理。	2026 年 07 月 16 日	-	10	博士研究生学历、博士学位。曾在上海东证期货有限公司、浙商基金管理有限公司、申万菱信基金管理有限公司工作。2025 年 8 月加入财通证券资产管理有限公司，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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
王剑	公募基金	4	1,012,284,631.75	2026-03-25
	私募资产管理计划	2	32,261,271.29	2026-05-26
	其他组合	-	-	-
	合计	6	1,044,545,903.04	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《财通资管中证全指红利质量交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《财通资管中证全指红利质量交易型开放式指数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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，美伊地缘局势反复波动，市场对原油供应链稳定性的担忧持续升温，进而推高国际油价；叠加美国财政融资需求带来的美债供给扩容，以及 AI 头部企业为支撑大规模算力资本开支加大债券发行，多重因素共同冲击长端美债定价，推动长端美债收益率上行，全球市场流动性环境随之承压。与此同时，市场对于 AI 板块的预期叙事出现明显分歧，投资者的估值框架发生切换，不再简单依赖远期行业空间给予高估值，转而更加审慎地聚焦相关企业的现金流兑现能力与盈利质量。除 AI 主线之外，国

内其余多数行业景气度偏弱，企业盈利修复动能不足，A 股整体赚钱效应有限，市场风险偏好受到压制，整体情绪偏谨慎，全市场成交量从前期高点 3.6 万亿元回落近五成。展望后市，在内外环境多重约束下，市场大概率维持震荡格局。在市场方向尚不明朗、不确定性仍存的阶段，投资者风险偏好有所回落，资金配置思路趋于保守，更加倾向布局具备高分红能力与稳定股息特征的防御性资产。红利质量指数除了考虑持续稳定的股息收益外，在指数编制环节还纳入盈利、偿债等质量因子，使得指数在捕捉稳定分红回报的基础上，同时兼顾一定的基本面成长属性，实现红利与质量特征的融合。本基金上市以来维持较高仓位运作，通过规范的调仓与组合管理，基本完成对跟踪基准的跟踪。

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全指红利质量 ETF 份额净值为 0.9774 元，本报告期财通资管中证全指红利质量 ETF 份额净值增长率为-2.26%，同期业绩比较基准收益率为-1.29%。

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	73,841,997.03	98.09
	其中：股票	73,841,997.03	98.09
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	1,397,426.80	1.86
8	其他资产	42,181.18	0.06
9	合计	75,281,605.01	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	11,014,231.54	14.71
C	制造业	43,498,311.97	58.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	484,821.00	0.65
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	249,886.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	5,875,849.44	7.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,133,306.08	12.19
J	金融业	2,350,186.00	3.14
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	893,048.00	1.19
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	342,357.00	0.46
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	73,841,997.03	98.59

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	600519	贵州茅台	5,800	7,299,996.00	9.75
2	002128	电投能源	196,050	5,469,795.00	7.30
3	002555	三七互娱	266,640	4,586,208.00	6.12
4	601600	中国铝业	479,886	4,285,381.98	5.72
5	000651	格力电器	102,000	3,904,560.00	5.21
6	300628	亿联网络	90,300	3,565,947.00	4.76
7	601872	招商轮船	174,900	3,524,235.00	4.71
8	000423	东阿阿胶	76,300	3,505,985.00	4.68
9	002415	海康威视	107,400	3,486,204.00	4.65
10	002558	巨人网络	123,149	2,770,852.50	3.70

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

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

本基金本报告期未投资股指期货。

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。此外，本基金还可运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，三七互娱网络科技集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所、中国证券监督管理委员会的处罚。招商局能源运输股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所上市公司管理一部、中国证券监督管理委员会上海监管局的处罚。巨人网络集团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重庆监管局的处罚。

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 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	-
2	应收证券清算款	9,518.49
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	32,662.69
8	其他	-
9	合计	42,181.18

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

基金合同生效日（2026 年 07 月 16 日）基金份额总额	372,631,257.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	44,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	340,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	76,631,257.00

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

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、财通资管中证全指红利质量交易型开放式指数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、财通资管中证全指红利质量交易型开放式指数证券投资基金托管协议

4、财通资管中证全指红利质量交易型开放式指数证券投资基金基金合同

5、财通资管中证全指红利质量交易型开放式指数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 10 月 27 日