财通资管中证 1000 指数增强型证券投资基金

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：国信证券股份有限公司

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。

基金托管人国信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 01 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 1000 指数增强
基金主代码	019402
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 04 月 29 日
报告期末基金份额总额	12,636,290.06 份
投资目标	本基金为指数增强型基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、可转换债券和可交换债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、参与融资及转融通证券出借业务策略；6、存托凭证投资策略；7、金融衍生产品投资策略。
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其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	财通证券资产管理有限公司

基金托管人	国信证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	财通资管中证 1000 指数增强 A	财通资管中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	019402	019403
报告期末下属分级基金的份额总额	1,394,161.76 份	11,242,128.30 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 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）	
	财通资管中证 1000 指数增强 A	财通资管中证 1000 指数增强 C
1.本期已实现收益	-776,795.92	-1,087,612.12
2.本期利润	-1,417,100.54	-1,789,595.47
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5453	-0.1930
4.期末基金资产净值	1,842,770.97	14,714,117.77
5.期末基金份额净值	1.3218	1.3088

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 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	-23.74%	2.07%	-16.31%	1.97%	-7.43%	0.10%
过去六个月	-8.72%	1.93%	-3.90%	1.78%	-4.82%	0.15%
过去一年	-3.00%	1.60%	-3.30%	1.58%	0.30%	0.02%
自基金合同生效起至今	32.18%	1.58%	33.38%	1.64%	-1.20%	-0.06%

财通资管中证 1000 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	-23.81%	2.07%	-16.31%	1.97%	-7.50%	0.10%
过去六个月	-8.90%	1.93%	-3.90%	1.78%	-5.00%	0.15%
过去一年	-3.40%	1.60%	-3.30%	1.58%	-0.10%	0.02%
自基金合同生效起至今	30.88%	1.58%	33.38%	1.64%	-2.50%	-0.06%

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 1000 指数增强 A



财通资管中证 1000 指数增强 C



§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		
辛晨晨	本基金基金经理。	2024 年 04 月 29 日	-	14	硕士研究生学历、硕士学位。曾在中信建投证券、上海证券交易所、嘉实资本管理有限公司、兴证证券资产管理有限公司工作。2020 年 8 月加入财通证券资产管理有限公司，曾任指数量化部总经理、量化及多资产投资部总经理，现任多元资产投资部总经理。

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
辛晨晨	公募基金	1	16,556,888.74	2024-04-29
	私募资产管理计划	2	9,906,536.43	2025-12-09
	其他组合	-	-	-
	合计	3	26,463,425.17	-

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 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》、《财通资管中证 1000 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 2026 年三季度，权益市场风格发生反转，日均成交量快速萎缩，以双创为代表的成长风格显著回撤，科创综指和创业板综指分别录得-27.98%和-21.18%的跌幅，其他宽基指数也回撤明显，中证 500、中证 1000 和沪深 300 分别下跌-17.67%、-17.15%、-12.49%，而微盘和红利类策略表现占优。策略组合层面，三季度超额回撤主要原因是市场风格在 7 月和 8 月分别发生较大反转，快速的风格轮动和缩量导致短期内模型受到市场风险冲击。以申万一级行业为例，采掘、农林牧渔、银行和医药生物四大行业显

著占优，分别收获 19.29%、15.10%、14.56%、10.12%的涨幅，市场整体价值低波类风格占优。展望四季度，随着制造业景气度逐步回升，经济动能有所修复，但内需与信贷内生动能依旧偏弱，基本面修复的斜率仍需进一步观察。海外方面，美联储货币政策路径、全球流动性变化及地缘政治风险仍可能影响市场风险偏好，传统量化基本面因子有望维持超额修复，由于市场成交量萎缩较快，量价类因子超额持续性波动较大。

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 1000 指数增强 A 份额净值为 1.3218 元，本报告期财通资管中证 1000 指数增强 A 份额净值增长率为-23.74%，同期业绩比较基准收益率为-16.31%；截至本报告期末财通资管中证 1000 指数增强 C 份额净值为 1.3088 元，本报告期财通资管中证 1000 指数增强 C 份额净值增长率为-23.81%，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

1、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的情形。

2、自 2024 年 5 月 7 日至 2026 年 9 月 30 日，本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形后，本基金在基金迷你期间产生的信息披露费、审计费、基金份额持有人大会费和银行间账户维护费等各类固定费用由基金管理人承担。

§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	15,447,375.66	92.01
	其中：股票	15,447,375.66	92.01
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	1,182,252.63	7.04
8	其他资产	159,398.72	0.95
9	合计	16,789,027.01	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	42,977.00	0.26
B	采矿业	311,918.00	1.88
C	制造业	10,023,146.86	60.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	706,562.00	4.27
E	建筑业	281,524.00	1.70
F	批发和零售业	984,772.80	5.95
G	交通运输、仓储和邮政业	542,890.00	3.28
H	住宿和餐饮业	17,616.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,154,795.00	6.97
J	金融业	558,828.00	3.38
K	房地产业	52,490.00	0.32
L	租赁和商务服务业	69,687.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	344,457.00	2.08
N	水利、环境和公共设施管理业	286,438.00	1.73
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	50,514.00	0.31
S	综合	18,760.00	0.11
	合计	15,447,375.66	93.30

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	600428	中远海特	17,200	184,212.00	1.11
2	301563	云汉芯城	1,500	158,145.00	0.96
3	600323	瀚蓝环境	4,400	129,712.00	0.78
4	600388	紫金龙净	7,700	129,360.00	0.78
5	002948	青岛银行	20,300	124,845.00	0.75
6	603083	剑桥科技	600	123,270.00	0.74
7	301565	中仑新材	6,000	115,320.00	0.70
8	603127	昭衍新药	2,300	113,390.00	0.68
9	000049	德赛电池	5,000	112,000.00	0.68
10	000636	风华高科	2,200	109,142.00	0.66

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

本基金参与股指期货的交易以套期保值为主要目的，本着谨慎原则，适度参与股指期货交易。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

本基金参与国债期货的交易以套期保值为主要目的，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，青岛银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行青岛市分行、国家金融监督管理总局青岛监管局的处罚。

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	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	159,398.72
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	159,398.72

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

项目	财通资管中证 1000 指数增强 A	财通资管中证 1000 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	4,001,425.23	3,151,151.65
报告期期间基金总申购份额	345,973.47	12,678,624.78
减：报告期期间基金总赎回份额	2,953,236.94	4,587,648.13

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	1,394,161.76	11,242,128.30

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

单位：份

项目	财通资管中证 1000 指数增强 A	财通资管中证 1000 指数增强 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	0.00
报告期期间买入/申购总份额	-	7,355,104.44
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	7,355,104.44
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	58.21

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2026 年 07 月 22 日	7,355,104.44	10,000,000.00	-
合计			7,355,104.44	10,000,000.00	

注：基金管理人 2026 年 07 月 22 日的交易，适用费率参照基金招募说明书以及 2026 年 02 月 24 日发布的《关于财通证券资产管理有限公司旗下公募基金在直销渠道开展认（申）购费率优惠活动的公告》的收费标准。

§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
机构	1	20260701-20260811	3,221,061.60	-	2,517,000.00	704,061.60	5.57%

	2	20260722-20260930	-	7,355,104.44	-	7,355,104.44	58.21%
个人	1	20260701-20260721	1,665,385.60	-	-	1,665,385.60	13.18%
产品特有风险							
本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额 20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性风险，从而影响基金的投资运作和收益水平。管理人将在基金运作中加强流动性管理，保持合适的流动性水平，对申购赎回进行合理的应对，防范流动性风险，保障持有人利益。							

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 1000 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 1000 指数增强型证券投资基金托管协议

4、财通资管中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同

5、财通资管中证 1000 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 10 月 27 日