

融通深证成份指数证券投资基金

2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 20 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 7 月 13 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	融通深证成份指数	
基金主代码	161612	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 11 月 15 日	
报告期末基金份额总额	72,917,428.13 份	
投资目标	本基金采取完全复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内，以实现深证成份指数的有效跟踪。	
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制指数的投资策略，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在 0.35%以内、年化跟踪误差控制在 4%的投资目标。	
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%	
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于高风险高收益的基金品种，其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C
下属分级基金的交易代码	161612	004875
下属分级基金的前端交易代码	161612	-

下属分级基金的后端交易代码	161662	-
报告期末下属分级基金的份额总额	56,799,228.27 份	16,118,199.86 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 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）	
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C
1. 本期已实现收益	4,082,504.76	1,077,905.98
2. 本期利润	15,753,039.18	4,256,983.09
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2653	0.2663
4. 期末基金资产净值	87,657,554.97	25,223,946.40
5. 期末基金份额净值	1.543	1.565

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、本报告所列示的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。

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

融通深证成份指数 A/B

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	20.45%	1.61%	19.19%	1.63%	1.26%	-0.02%
过去六个月	19.74%	1.45%	18.83%	1.46%	0.91%	-0.01%
过去一年	54.09%	1.32%	51.70%	1.33%	2.39%	-0.01%
过去三年	54.60%	1.39%	44.80%	1.42%	9.80%	-0.03%
过去五年	17.29%	1.32%	7.23%	1.33%	10.06%	-0.01%
过去七年	108.84%	1.35%	73.25%	1.35%	35.59%	0.00%
过去十年	101.04%	1.32%	53.14%	1.32%	47.90%	0.00%
自基金合同生效起至今	68.96%	1.49%	28.94%	1.47%	40.02%	0.02%

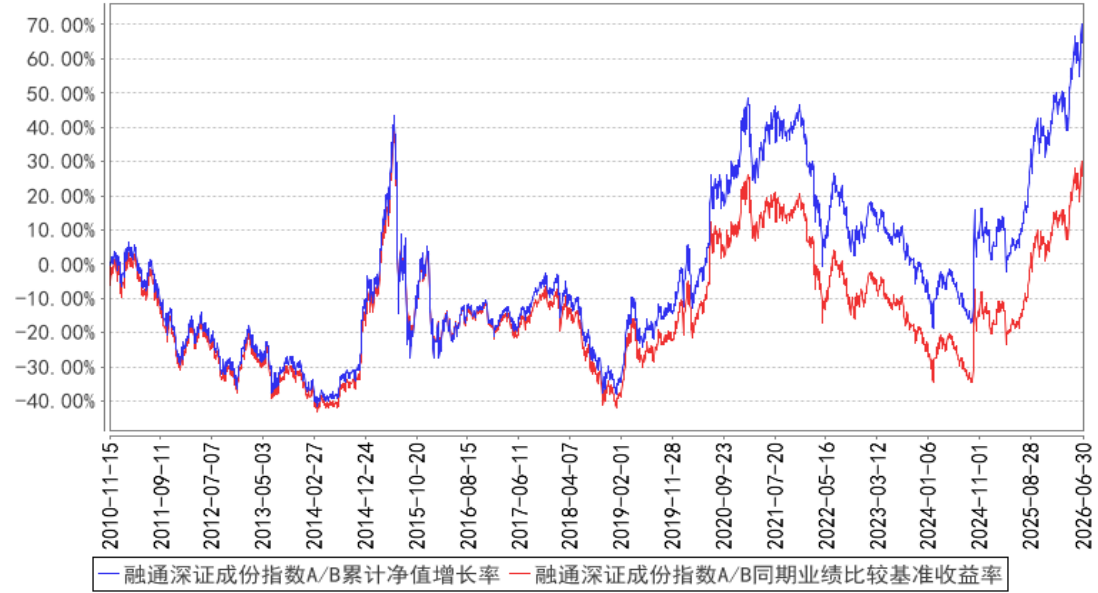
融通深证成份指数 C

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	20.29%	1.61%	19.19%	1.63%	1.10%	-0.02%
过去六个月	19.60%	1.45%	18.83%	1.46%	0.77%	-0.01%
过去一年	53.49%	1.32%	51.70%	1.33%	1.79%	-0.01%
过去三年	52.87%	1.39%	44.80%	1.42%	8.07%	-0.03%
过去五年	15.04%	1.32%	7.23%	1.33%	7.81%	-0.01%
过去七年	103.25%	1.36%	73.25%	1.35%	30.00%	0.01%
自基金合同生效起至今	85.37%	1.37%	52.06%	1.36%	33.31%	0.01%

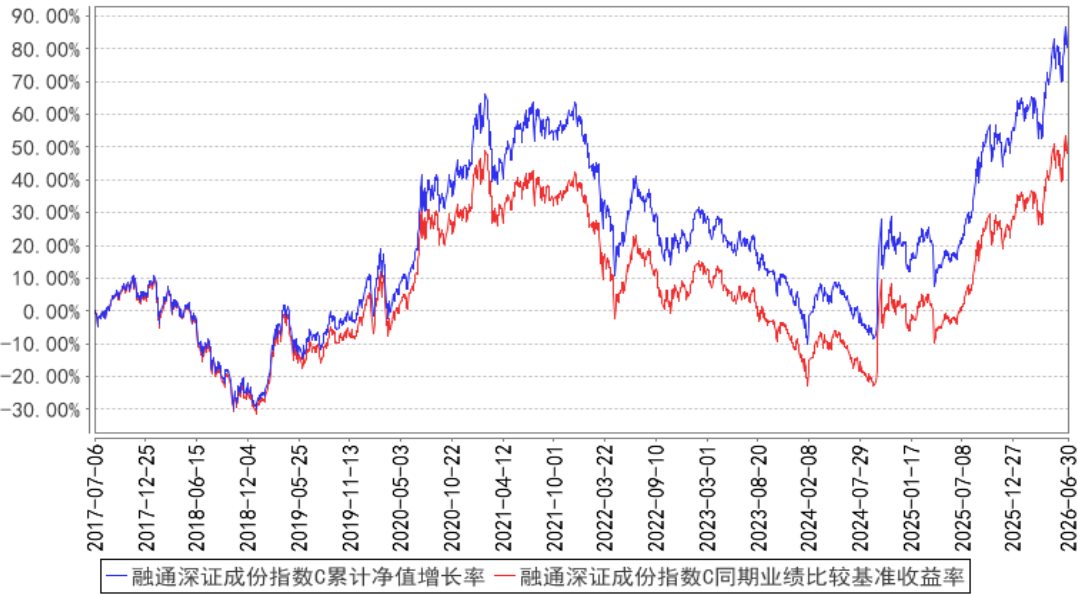
注：本基金于 2017 年 7 月 5 日增设 C 类份额，该类份额首次确认日为 2017 年 7 月 6 日。

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

融通深证成份指数A/B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



融通深证成份指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2017 年 7 月 5 日增设 C 类份额，C 类份额首次确认日为 2017 年 7 月 6 日，故本基金 C 类份额的统计区间为 2017 年 7 月 6 日至本报告期末。

3.3 其他指标

无。

§ 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		
蔡志伟	本基金的基金经理	2016 年 11 月 19 日	—	15 年	蔡志伟先生，计算机应用技术硕士，金融风险管理师（FRM），15 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2006 年 7 月至 2008 年 8 月就职于汇丰软件开发(广东)有限公司任高级软件工程师。2011 年 6 月加入融通基金管理有限公司，历任风险管理专员、金融工程研究员、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)基金经理、融通深证成份指数证券投资基金基金经理、融通创业板指数增强型证券投资基金基金经理、融通创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通中证诚通央企 ESG 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通创业板交易型开放式

					指数证券投资基金发起式联接基金基金经理、融通中证诚通央企红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通中证诚通央企红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、融通中证诚通央企 ESG 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券、基金业务相关工作的时间为计算标准。

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

无。

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，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，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，并制定了相应的制度和流程，在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为深证成指，深证成指为深市标尺指数，选取深交所市场市值大、流动性好的 500 家公司作为样本，指数历史悠久，代表性充分，充分刻画深交所多层次市场特色，反映深市整体运行情况。深证成指代表中国新兴成长性企业，已成为中国证券市场最重要的标尺指数之一。

2026 年第二季度，报告期内 A 股市场总体呈现震荡上行，深证成指上涨 20.24%。展望三季度，2026 年作为“十五五”开局之年，稳增长政策持续加码落地，财政政策靠前发力、专项债发行提

速，货币政策保持稳健偏宽松基调。1-5 月宏观数据显示工业生产稳步回升，制造业资本开支周期启动，AI 产业加速向内传导提振外需与工业景气，稳地产政策成效逐步显现，经济复苏态势进一步巩固。

A 股市场层面，二季度市场在 AI 产业景气延续与海外流动性扰动下呈现“结构性强势、市场震荡”格局，科技成长主线内部分化加大。算力、存储、半导体等 AI 相关板块持续领涨，消费与周期类价值板块整体阶段性承压，市场以成长风格绝对主导。当前沪深 300 整体估值仍处合理区间，但局部科技板块估值偏高，交易拥挤度显著上升，短期内预计将有所震荡调整。预计 7-8 月市场将进入中报“盈利验证期”，市场大概率仍将延续“业绩驱动”结构性方向，更加聚焦于有真实业绩支撑的景气赛道。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持采用指数化投资策略，在基金申赎变动和指数成分股权重调整时，采用指数复制和数量化投资技术降低冲击成本和减少跟踪误差，力求紧密跟踪标的指数。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通深证成份指数 A/B 基金份额净值为 1.543 元，本报告期基金份额净值增长率为 20.45%，同期业绩比较基准收益率为 19.19%；

截至本报告期末融通深证成份指数 C 基金份额净值为 1.565 元，本报告期基金份额净值增长率为 20.29%，同期业绩比较基准收益率为 19.19%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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	105,477,999.52	92.51
	其中：股票	105,477,999.52	92.51
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	13,400.23	0.01
	其中：债券	13,400.23	0.01
	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	8,075,719.67	7.08
8	其他资产	448,184.25	0.39
9	合计	114,015,303.67	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	930,455.21	0.82
B	采矿业	1,065,233.23	0.94
C	制造业	88,289,132.10	78.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	876,932.00	0.78
E	建筑业	154,723.00	0.14
F	批发和零售业	1,099,163.00	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	888,655.00	0.79
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,402,696.17	3.90
J	金融业	5,097,588.56	4.52
K	房地产业	335,319.25	0.30
L	租赁和商务服务业	806,826.36	0.71
M	科学研究和技术服务业	526,538.25	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	108,647.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	54,360.00	0.05
Q	卫生和社会工作	298,463.90	0.26
R	文化、体育和娱乐业	341,741.00	0.30
S	综合	—	—
	合计	105,276,474.03	93.26

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	8,669.32	0.01
C	制造业	146,196.60	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,909.51	0.04
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	750.06	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
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	201,525.49	0.18

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	300308	中际旭创	4,688	5,953,760.00	5.27
2	300750	宁德时代	14,060	5,525,720.60	4.90
3	300502	新易盛	6,648	4,035,336.00	3.57
4	002371	北方华创	2,435	2,153,903.60	1.91
5	000333	美的集团	26,303	1,986,665.59	1.76
6	002475	立讯精密	25,357	1,785,132.80	1.58
7	002384	东山精密	6,750	1,770,862.50	1.57
8	000725	京东方 A	177,498	1,540,682.64	1.36
9	300059	东方财富	69,869	1,423,930.22	1.26
10	300274	阳光电源	8,044	1,279,156.88	1.13

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

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	301666	大普微	148	68,572.84	0.06
2	001248	华润新能源	4,541	45,909.51	0.04
3	001399	惠科股份	590	16,360.70	0.01
4	301682	宏明电子	92	14,725.52	0.01
5	001257	盛龙股份	418	8,669.32	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	13,400.23	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,400.23	0.01

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127114	宜化转债	134	13,400.23	0.01

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

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

无。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,552.20
2	应收证券清算款	3,862.58
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	438,769.47
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	448,184.25

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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

无。

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301666	大普微	68,572.84	0.06	首发流通受限
2	001248	华润新能源	45,909.51	0.04	首发流通受限
3	001399	惠科股份	16,360.70	0.01	首发流通受限
4	301682	宏明电子	14,725.52	0.01	首发流通受限
5	001257	盛龙股份	8,669.32	0.01	首发流通受限

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C
报告期期初基金份额总额	61,301,903.58	16,573,418.14
报告期期间基金总申购份额	6,607,967.31	14,791,947.20
减:报告期期间基金总赎回份额	11,110,642.62	15,247,165.48
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	56,799,228.27	16,118,199.86

§ 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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 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

无。

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

- （一）中国证监会批准融通深证成份指数证券投资基金设立的文件
- （二）《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》
- （三）《融通深证成份指数证券投资基金托管协议》
- （四）《融通深证成份指数证券投资基金招募说明书》及其更新
- （五）融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- （六）报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登录本基金管理人网站
<http://www.rtfund.com> 查阅。

融通基金管理有限公司

2026 年 7 月 20 日