

融通深证成份指数证券投资基金

2026 年中期报告

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

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通深证成份指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同约定，于 2026 年 8 月 13 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人 and 基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55

7.6 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	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55
7.8 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贵金属投资明细	55
7.9 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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	59
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
11.1 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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通深证成份指数证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	72,917,428.13 份	
基金合同存续期	不定期	
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

2.2 基金产品说明

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 $\times$ 95% + 银行活期存款利率 $\times$ 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	方毅祖	郭明
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真		(0755) 26935005	(010) 66105798
注册地址		深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	518054	100140
法定代表人	张威	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号 深创投广场 41 层、42 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 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
本期已实现收益	6,106,233.05	1,485,129.43
本期利润	15,753,401.74	3,974,919.07
加权平均基金份额本期利润	0.2547	0.2687
本期加权平均净值利润率	18.27%	18.95%
本期基金份额净值增长率	19.74%	19.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	30,858,326.70	2,912,780.44
期末可供分配基金份额利润	0.5433	0.1807
期末基金资产净值	87,657,554.97	25,223,946.40
期末基金份额净值	1.543	1.565
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	68.96%	85.37%

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、期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配

利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%

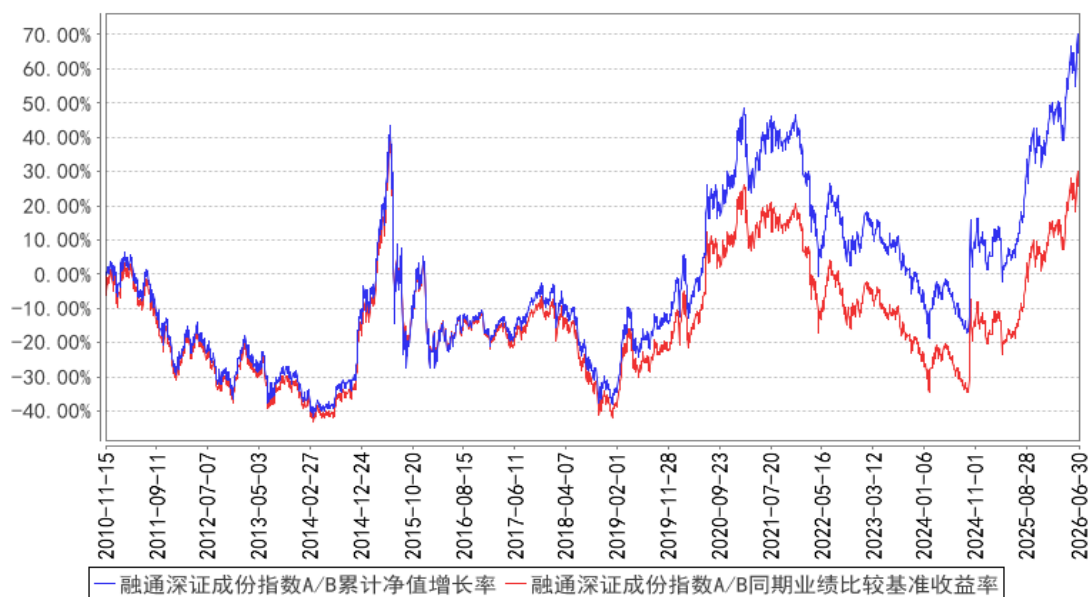
融通深证成份指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%

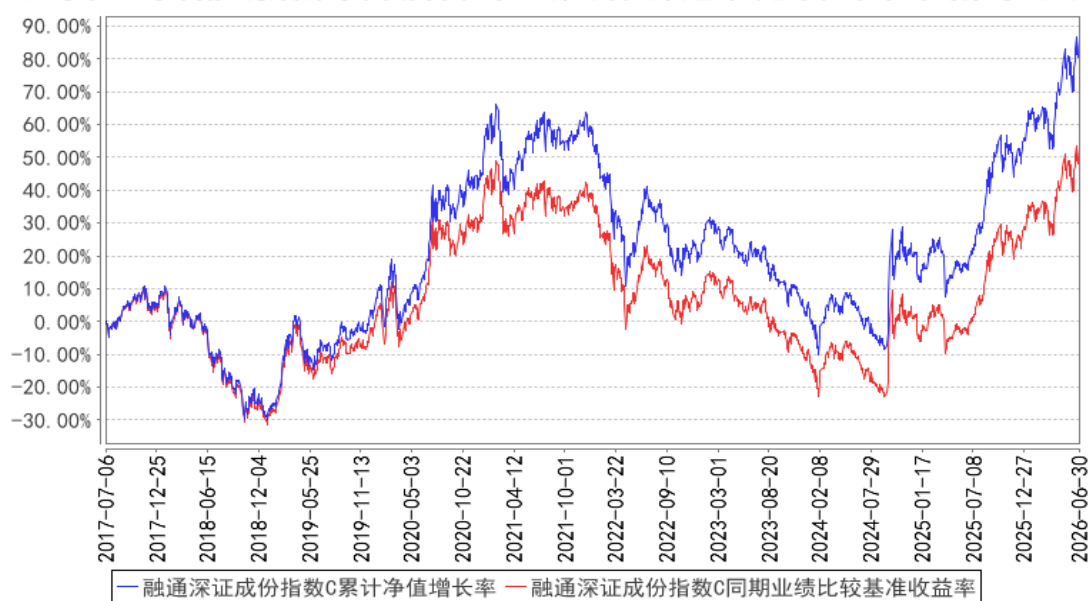
注：本基金于 2017 年 7 月 5 日增设 C 类份额，该类份额首次确认日为 2017 年 7 月 6 日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8 号文批准，于 2001 年 5 月 22 日成立，公司注册资本 12500 万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：诚通证券股份有限公司 60%、奥明资产管理有限公司（Amova Asset Management Co.,Ltd.）40%。本基金管理人拥有公募基金管理资格、特定客户（专户）资产管理资格、合格境内机构投资者资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境内机构投资者（RQDII）资格、合格境内投资企业（QDIE）资格，产品线完备，涵盖主动权益类基金、被动投资类基金、债券基金、货币基金、混合基金、QDII 基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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。

4.1.3 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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内、10 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金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。报告期内，本基金主要采取指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

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份股权重调整时，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。

4.4.2 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 19.74%，同期业绩比较基准收益率为 18.83%；

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 19.60%，同期业绩比较基准收益率为 18.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2026 年上半年，全球宏观环境呈现地缘政治扰动与流动性整体宽松并存格局。海外方面，美以伊冲突阶段性缓和，美联储降息预期持续存在，全球流动性维持偏宽松区间；中美关系整体平稳，外部不确定性边际回落。国内作为“十五五”规划开局之年，财政政策靠前发力，货币政策保持稳健偏宽松，稳增长、促创新政策持续落地。上半年经济呈现总量平稳、结构分化特征，工业生产稳步回升，制造业资本开支周期启动，AI 产业带动外需与高技术制造景气上行，内需修复节奏偏弱，经济整体维持温和复苏态势。

市场表现方面，2026 年上半年 A 股整体震荡上行，深证成指上半年上涨 19.82%，市场行情呈现极致结构分化特征。AI 产业链成为绝对主线，算力、存储、半导体持续领涨，消费、周期价值板块阶段性承压；市场风格层面，成长风格显著占优，小盘股受资金拥挤度扰动出现明显调整。上半年在产业景气驱动下，科技板块持续上涨，局部赛道估值抬升、交易拥挤度有所走高，市场波动也随之加大。

展望下半年，国内稳增长政策持续加码，上半年宏观数据验证工业与新产业韧性，地产托底政策效果逐步显现，经济复苏动能有望进一步巩固。下半年市场从科技产业景气预期进入到集中的财报验证期，行情逻辑将从题材预期转向业绩兑现，市场震荡调整概率加大，但结构性机会不会消失。外部层面地缘冲突缓和，海外流动性宽松环境不变，整体风险偏好具备支撑基础。中长期看，A 股在全球资产中估值优势突出，外资增量配置的空间充足，市场整体震荡上行的大方向未发生改变。

行业配置层面，在全球科技产业加速迭代的大背景下，科技成长依然是贯穿 2026 年的核心主线。继续坚定看好 AI 产业链，随着 Kimi、智谱、DeepSeek、豆包等国产大模型在垂直领域的商业化落地加速，投资重点除了算力基础设施，需要重点关注 AI 终端以及上游半导体相关产业链的扩散，同时关注人形机器人产业链的量产进度带来的主题性机会。其次，重点关注顺周期板块的估值修复，特别是受益于内需改善和政策托底的消费电子、创新药以及具备出海逻辑的高端制造。

展望 2026 年下半年，深证成指作为 A 股市场最重要的标尺指数之一，有望受益经济的筑底回升，当前指数具备较好的配置价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司基金估值业务原则和程序管理细则》进行，公司设立由研究相关部门、风险管理部、登记清算部、稽核审计部和法律合规部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方估值服务机构的估值数据

等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议，由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2026 年 1 月 19 日实施 2025 年第 1 次利润分配，以 2025 年 12 月 31 日的可分配收益为基准，融通深证成份指数 A/B 每 10 份基金份额派发红利 0.3200 元，融通深证成份指数 C 每 10 份基金份额派发红利 0.1000 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——融通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年度中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6. 4. 7. 1	8, 068, 814. 43	6, 647, 915. 92
结算备付金		6, 905. 24	-
存出保证金		5, 552. 20	4, 130. 57
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	105, 491, 399. 75	98, 292, 779. 59
其中：股票投资		105, 477, 999. 52	98, 292, 779. 59
基金投资		-	-
债券投资		13, 400. 23	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6. 4. 7. 3	-	-
买入返售金融资产	6. 4. 7. 4	-	-
债权投资	6. 4. 7. 5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6. 4. 7. 6	-	-
其他权益工具投资	6. 4. 7. 7	-	-
应收清算款		3, 862. 58	93, 669. 19
应收股利		-	-
应收申购款		438, 769. 47	112, 808. 57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	-
资产总计		114, 015, 303. 67	105, 151, 303. 84
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		938, 217. 61	432, 411. 37
应付管理人报酬		91, 125. 92	88, 635. 04
应付托管费		18, 225. 18	17, 726. 99
应付销售服务费		8, 076. 85	5, 974. 51
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	78,156.74	149,113.62
负债合计		1,133,802.30	693,861.53
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	72,917,428.13	79,226,656.78
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	39,964,073.24	25,230,785.53
净资产合计		112,881,501.37	104,457,442.31
负债和净资产总计		114,015,303.67	105,151,303.84

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，融通深证成份指数 A/B 类基金份额净值 1.543 元，基金份额总额 56,799,228.27 份；融通深证成份指数 C 类基金份额净值 1.565 元，基金份额总额 16,118,199.86 份；总份额合计 72,917,428.13 份。

6.2 利润表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		20,479,117.50	2,597,777.94
1. 利息收入		13,562.24	9,896.76
其中：存款利息收入	6.4.7.13	13,562.24	9,896.76
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,248,778.66	1,528,507.53
其中：股票投资收益	6.4.7.14	7,494,286.06	551,812.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,331.51	5,047.96
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	753,161.09	971,646.78
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的		-	-

收益			
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	12, 136, 958. 33	1, 027, 678. 50
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	79, 818. 27	31, 695. 15
减：二、营业总支出		750, 796. 69	649, 277. 55
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	530, 739. 70	458, 930. 02
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	106, 147. 94	91, 785. 96
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	41, 372. 05	25, 061. 69
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	72, 537. 00	73, 499. 88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19, 728, 320. 81	1, 948, 500. 39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19, 728, 320. 81	1, 948, 500. 39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		19, 728, 320. 81	1, 948, 500. 39

6.3 净资产变动表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	79, 226, 656. 78	-	25, 230, 785. 53	104, 457, 442. 31
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	79,226,656.78	-	25,230,785.53	104,457,442.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,309,228.65	-	14,733,287.71	8,424,059.06
(一)、综合收益总额	-	-	19,728,320.81	19,728,320.81
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-6,309,228.65	-	-2,793,289.06	-9,102,517.71
其中：1. 基金申购款	39,392,882.16	-	16,430,792.43	55,823,674.59
2. 基金赎回款	-45,702,110.81	-	-19,224,081.49	-64,926,192.30
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-2,201,744.04	-2,201,744.04
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	72,917,428.13	-	39,964,073.24	112,881,501.37
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	94,291,332.52	-	401,367.94	94,692,700.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	94,291,332.52	-	401,367.94	94,692,700.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,615,576.60	-	1,889,213.91	-2,726,362.69
(一)、综合收益总额	-	-	1,948,500.39	1,948,500.39

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-4,615,576.60	-	-16,792.73	-4,632,369.33
其中：1. 基金申购款	20,370,594.36	-	-48,931.59	20,321,662.77
2. 基金赎回款	-24,986,170.96	-	32,138.86	-24,954,032.10
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-42,493.75	-42,493.75
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	89,675,755.92	-	2,290,581.85	91,966,337.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

商小虎

高翔

郑刚

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

融通深证成份指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]606号《关于核准融通深证成份指数证券投资基金募集的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,848,674,651.50元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第315号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》于2010年11月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,848,841,553.44份基金份额,其中认购资金利息折合166,901.94份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人于2017年7月5日发布的《融通基金管理有限公司关于融通深证成

份指数证券投资基金增设 C 类基金份额并修订基金合同部分条款的公告》，自 2017 年 7 月 5 日起对本基金进行份额分类，原有基金份额为 A/B 类份额，增设 C 类份额。在投资者申购时收取前端申购费用的份额，称为 A 类份额；在投资者赎回时收取后端申购费用的份额，称为 B 类份额；不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费并按照持有期限收取赎回费的份额，称为 C 类份额。本基金分类后，本基金原有基金份额将自动划归为本基金 A/B 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括深证成份指数的成份股与备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金力求将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，以实现对深证成份指数的有效跟踪。本基金标的指数使用费由基金管理人融通基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资于深证成份指数成份股与及其备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：深证成份指数收益率 X95%+银行活期存款利率 X5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

本基金的主要税项列示如下：

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

(4) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	8,068,814.43
等于：本金	8,068,142.78
加：应计利息	671.65
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	8,068,814.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		67,500,841.04	-	105,477,999.52	37,977,158.48
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	13,399.94	0.29	13,400.23	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,399.94	0.29	13,400.23	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		67,514,240.98	0.29	105,491,399.75	37,977,158.48

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,267.65
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,489.09

其中：交易所市场	4,489.09
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	72,400.00
合计	78,156.74

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通深证成份指数 A/B

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	66,567,237.68	66,567,237.68
本期申购	12,285,599.63	12,285,599.63
本期赎回（以“-”号填列）	-22,053,609.04	-22,053,609.04
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	56,799,228.27	56,799,228.27

融通深证成份指数 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,659,419.10	12,659,419.10
本期申购	27,107,282.53	27,107,282.53
本期赎回（以“-”号填列）	-23,648,501.77	-23,648,501.77
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	16,118,199.86	16,118,199.86

注：申购含红利再投及转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

融通深证成份指数 A/B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	36,880,372.43	-15,678,048.00	21,202,324.43
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	36,880,372.43	-15,678,048.00	21,202,324.43
本期利润	6,106,233.05	9,647,168.69	15,753,401.74
本期基金份额交易产生的变动数	-5,531,113.00	1,509,907.72	-4,021,205.28
其中：基金申购款	6,978,288.99	-1,955,353.16	5,022,935.83
基金赎回款	-12,509,401.99	3,465,260.88	-9,044,141.11
本期已分配利润	-2,076,194.19	-	-2,076,194.19
本期末	35,379,298.29	-4,520,971.59	30,858,326.70

融通深证成份指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,156,630.69	2,871,830.41	4,028,461.10
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,156,630.69	2,871,830.41	4,028,461.10
本期利润	1,485,129.43	2,489,789.64	3,974,919.07
本期基金份额交易产生的变动数	396,570.17	831,346.05	1,227,916.22
其中：基金申购款	3,380,922.40	8,026,934.20	11,407,856.60
基金赎回款	-2,984,352.23	-7,195,588.15	-10,179,940.38
本期已分配利润	-125,549.85	-	-125,549.85
本期末	2,912,780.44	6,192,966.10	9,105,746.54

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,537.14
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	14.41
其他	10.69
合计	13,562.24

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,494,286.06
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	7,494,286.06

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	24,636,337.95
减：卖出股票成本总额	17,120,594.84
减：交易费用	21,457.05
买卖股票差价收入	7,494,286.06

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,331.18
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,331.51

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,831.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,500.00
减：应计利息总额	0.10
减：交易费用	0.12
买卖债券差价收入	1,331.18

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	753,161.09
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	753,161.09
----	------------

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	12,136,958.33
股票投资	12,136,958.33
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	12,136,958.33

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	79,177.35
基金转换费收入	640.92
合计	79,818.27

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 基金的转换费用包括转换费和补差费，其中不低于转换费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	12,892.63
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	137.00
合计	72,537.00

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司（“融通基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
诚通证券股份有限公司（“诚通证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
诚通证券	13,832,541.87	37.85	40,569,007.59	43.30

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
诚通证券	2,571.51	37.85	1,562.42	34.80
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
诚通证券	7,542.34	43.30	4,104.97	30.55

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	530,739.70	458,930.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	257,907.16	213,732.49
应支付基金管理人的净管理费	272,832.54	245,197.53

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 1.00\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	106,147.94	91,785.96

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%年费率

计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C	合计
融通基金	-	76.47	76.47
中国工商银行	-	5,688.29	5,688.29
合计	-	5,764.76	5,764.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C	合计
融通基金	-	42.83	42.83
中国工商银行	-	3,314.58	3,314.58
合计	-	3,357.41	3,357.41

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A/B 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应支付的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况
无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	8,068,814.43	13,537.14	4,903,148.96	9,807.00

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明
无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

融通深证成份指数 A/B								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配合计	备 注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 19 日	-	2026 年 1 月 19 日	0.3200	1,067,084.75	1,009,109.44	2,076,194.19	-
合计	-	-	-	0.3200	1,067,084.75	1,009,109.44	2,076,194.19	-
融通深证成份指数 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配合计	备 注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 19 日	-	2026 年 1 月 19 日	0.1000	101,654.65	23,895.20	125,549.85	-
合计	-	-	-	0.1000	101,654.65	23,895.20	125,549.85	-

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	28.00	27.78	27	756.00	750.06	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	53.26	58.74	44	2,343.44	2,584.56	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	10.11	10.11	3,179	32,139.69	32,139.69	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	首发流通受限	10.11	10.11	1,362	13,769.82	13,769.82	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	7.82	20.74	418	3,268.76	8,669.32	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	27.19	31.31	108	2,936.52	3,381.48	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	30.38	38.99	75	2,278.50	2,924.25	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	10.12	27.73	590	5,970.80	16,360.70	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	26.66	50.96	65	1,732.90	3,312.40	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	13.30	51.56	120	1,596.00	6,187.20	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	13.91	32.47	126	1,752.66	4,091.22	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	46.08	463.33	148	6,819.84	68,572.84	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	7.08	28.40	215	1,522.20	6,106.00	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	58.00	112.16	33	1,914.00	3,701.28	-
301682	宏明电	2026 年	1-6 个月	首发流	69.66	160.06	92	6,408.72	14,725.52	-

	子	3 月 18 日	(含)	通受限						
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	78.38	121.77	23	1,802.74	2,800.71	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	21.93	77.78	78	1,710.54	6,066.84	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	24.68	86.80	62	1,530.16	5,381.60	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127114	宣化转债	2026 年 6 月 26 日	1 个月内 (含)	配债流通受限	100.00	100.00	134	13,399.94	13,400.23	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为跟踪指数的股票型基金，主要投资于标的指数成份券及备选成份券，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，力争实现基

金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人奉行内控优先和全员风险管理理念，高度重视风险管理的组织保障和制度保障，建立了完备的风险管理组织及相应的制度和流程，力争在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化。

本基金管理人在董事会下设立风险控制与审计委员会，履行相应风险管理和监督职责。

在公司管理层下设立合规与风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大风险、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

公司所有员工是本岗位风险管理的直接责任人，各业务部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，基金经理是相应投资组合风险管理的第一责任人。

风险管理部对公司风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责，负责执行公司的风险管理战略和决策，拟定公司风险管理制度，并协同各业务部门制定风险管理流程、评估指标。

监察稽核相关部门负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险管理措施得到有效的贯彻执行。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01%（2025 年 12 月 31 日：本基金无债券投资）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	13,400.23	-
未评级	-	-
合计	13,400.23	-

注：1. 未评级债券为国债、政策性金融债和央行票据等。

2. 债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，

约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息外（如有），本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	8,068,814.43	-	-	-	8,068,814.43
结算备付金	6,905.24	-	-	-	6,905.24
存出保证金	5,552.20	-	-	-	5,552.20
交易性金融资产	-	-	13,400.23	105,477,999.52	105,491,399.75
应收申购款	-	-	-	438,769.47	438,769.47
应收清算款	-	-	-	3,862.58	3,862.58
资产总计	8,081,271.87	-	13,400.23	105,920,631.57	114,015,303.67
负债					
应付赎回款	-	-	-	938,217.61	938,217.61

应付管理人报酬	-	-	-	91,125.92	91,125.92
应付托管费	-	-	-	18,225.18	18,225.18
应付销售服务费	-	-	-	8,076.85	8,076.85
其他负债	-	-	-	78,156.74	78,156.74
负债总计	-	-	-	1,133,802.30	1,133,802.30
利率敏感度缺口	8,081,271.87	-	13,400.23	104,786,829.27	112,881,501.37
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,647,915.92	-	-	-	6,647,915.92
存出保证金	4,130.57	-	-	-	4,130.57
交易性金融资产	-	-	-	98,292,779.59	98,292,779.59
应收申购款	-	-	-	112,808.57	112,808.57
应收清算款	-	-	-	93,669.19	93,669.19
资产总计	6,652,046.49	-	-	98,499,257.35	105,151,303.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	432,411.37	432,411.37
应付管理人报酬	-	-	-	88,635.04	88,635.04
应付托管费	-	-	-	17,726.99	17,726.99
应付销售服务费	-	-	-	5,974.51	5,974.51
其他负债	-	-	-	149,113.62	149,113.62
负债总计	-	-	-	693,861.53	693,861.53
利率敏感度缺口	6,652,046.49	-	-	97,805,395.82	104,457,442.31

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01%（2025 年 12 月 31 日：本基金无债券投资），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金运用指数化投资方式，通过控制股票投资组合与深证成份指数的跟踪误差，力求实现对深证成份指数的有效跟踪。金融工程小组负责对基金组合的跟踪误差和风险进行评估，定期提交组合跟踪误差和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时，通知基金经理和相关部门，及时进行投资组合的调整。投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资深证成份指数成份股及其备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	105,477,999.52	93.44	98,292,779.59	94.10
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	105,477,999.52	93.44	98,292,779.59	94.10

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除深证成份指数收益率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	本期末 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
1. 深证成份指数收益率上升 5%	5, 298, 689. 08	4, 931, 185. 69
2. 深证成份指数收益率下降 5%	-5, 298, 689. 08	-4, 931, 185. 69

6. 4. 13. 4. 4 采用风险价值法管理风险

无。

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	105, 276, 474. 03	97, 847, 278. 77
第二层次	59, 309. 74	334, 154. 40
第三层次	155, 615. 98	111, 346. 42
合计	105, 491, 399. 75	98, 292, 779. 59

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	448,184.25	0.39
9	合计	114,015,303.67	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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

7.2.2 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

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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
11	300476	胜宏科技	3,500	1,212,505.00	1.07
12	300408	三环集团	6,850	1,143,265.00	1.01
13	002463	沪电股份	7,320	1,118,496.00	0.99
14	002594	比亚迪	13,832	1,102,410.40	0.98
15	300394	天孚通信	3,590	1,086,621.20	0.96
16	001309	德明利	1,000	942,900.00	0.84
17	301308	江波龙	1,300	914,940.00	0.81
18	300604	长川科技	2,600	887,692.00	0.79
19	000651	格力电器	23,302	873,825.00	0.77
20	000988	华工科技	4,600	849,206.00	0.75
21	002281	光迅科技	3,100	796,514.00	0.71
22	000338	潍柴动力	27,440	747,740.00	0.66
23	002916	深南电路	1,611	737,676.90	0.65
24	000858	五 粮 液	9,946	736,004.00	0.65
25	300124	汇川技术	10,947	726,114.51	0.64
26	002415	海康威视	20,135	688,617.00	0.61
27	002008	大族激光	4,500	675,495.00	0.60
28	000063	中兴通讯	17,277	625,254.63	0.55
29	300857	协创数据	1,816	617,258.40	0.55
30	000100	TCL 科技	104,352	607,328.64	0.54
31	300433	蓝思科技	10,660	572,015.60	0.51
32	002028	思源电气	3,300	570,900.00	0.51
33	300475	香农芯创	1,900	570,000.00	0.50
34	002142	宁波银行	18,523	549,947.87	0.49
35	000792	盐湖股份	18,000	543,420.00	0.48
36	300136	信维通信	4,495	536,028.75	0.47
37	002353	杰瑞股份	3,451	526,277.50	0.47
38	300223	北京君正	2,100	522,690.00	0.46
39	002050	三花智控	11,683	512,065.89	0.45
40	300014	亿纬锂能	7,678	499,300.34	0.44
41	300760	迈瑞医疗	3,500	475,405.00	0.42
42	002714	牧原股份	13,575	474,989.25	0.42
43	300285	国瓷材料	4,600	474,628.00	0.42
44	002156	通富微电	6,200	470,394.00	0.42
45	000001	平安银行	45,909	461,385.45	0.41
46	000657	中钨高新	4,800	459,456.00	0.41
47	300666	江丰电子	1,200	442,320.00	0.39
48	002230	科大讯飞	10,663	435,476.92	0.39

49	002851	麦格米特	2,600	434,668.00	0.39
50	300054	鼎龙股份	3,900	413,283.00	0.37
51	002436	兴森科技	8,100	412,695.00	0.37
52	002352	顺丰控股	13,100	409,506.00	0.36
53	300033	同花顺	1,620	390,420.00	0.35
54	002938	鹏鼎控股	3,700	389,906.00	0.35
55	300548	长芯博创	1,400	389,200.00	0.34
56	002460	赣锋锂业	5,910	386,514.00	0.34
57	000776	广发证券	16,360	382,824.00	0.34
58	000977	浪潮信息	5,364	375,480.00	0.33
59	300498	温氏股份	30,378	374,256.96	0.33
60	002709	天赐材料	7,252	372,970.36	0.33
61	002428	云南锗业	3,100	372,558.00	0.33
62	300757	罗博特科	600	371,400.00	0.33
63	000425	徐工机械	45,900	371,331.00	0.33
64	000021	深科技	5,700	366,339.00	0.32
65	002409	雅克科技	1,600	359,200.00	0.32
66	300567	精测电子	1,100	349,360.00	0.31
67	002080	中材科技	3,860	347,400.00	0.31
68	300661	圣邦股份	2,370	340,047.60	0.30
69	000938	紫光股份	11,675	336,940.50	0.30
70	300395	菲利华	2,500	334,325.00	0.30
71	002202	金风科技	13,988	334,313.20	0.30
72	002837	英维克	4,198	333,992.88	0.30
73	002466	天齐锂业	5,400	331,128.00	0.29
74	000568	泸州老窖	4,243	328,917.36	0.29
75	002484	江海股份	3,100	325,500.00	0.29
76	300442	润泽科技	3,900	323,973.00	0.29
77	002049	紫光国微	3,640	323,050.00	0.29
78	000636	风华高科	4,400	317,856.00	0.28
79	002185	华天科技	14,134	315,329.54	0.28
80	300346	南大光电	3,360	311,304.00	0.28
81	002241	歌尔股份	13,714	308,976.42	0.27
82	300390	天华新能	3,300	308,583.00	0.27
83	002600	领益智造	17,200	298,248.00	0.26
84	002138	顺络电子	3,900	285,090.00	0.25
85	000408	藏格矿业	4,100	284,212.00	0.25
86	002407	多氟多	5,520	277,269.60	0.25
87	301526	国际复材	5,900	275,353.00	0.24
88	002179	中航光电	5,957	275,213.40	0.24
89	300058	蓝色光标	19,560	269,145.60	0.24
90	300373	扬杰科技	1,700	267,291.00	0.24
91	300672	国科微	900	265,500.00	0.24

92	300620	光库科技	700	264,740.00	0.23
93	002027	分众传媒	54,664	264,573.76	0.23
94	002625	光启技术	8,700	263,784.00	0.23
95	000630	铜陵有色	41,000	260,760.00	0.23
96	300037	新宙邦	2,780	258,123.00	0.23
97	000807	云铝股份	11,300	250,182.00	0.22
98	300751	迈为股份	879	248,282.34	0.22
99	300570	太辰光	1,000	246,710.00	0.22
100	002273	水晶光电	6,900	244,812.00	0.22
101	301511	德福科技	1,700	244,545.00	0.22
102	000426	兴业银锡	7,200	237,312.00	0.21
103	002001	新 和 成	8,345	237,164.90	0.21
104	301217	铜冠铜箔	1,400	231,098.00	0.20
105	300450	先导智能	5,641	229,701.52	0.20
106	002422	科伦药业	5,916	227,884.32	0.20
107	002812	恩捷股份	3,400	227,494.00	0.20
108	002602	世纪华通	16,000	225,600.00	0.20
109	002648	卫星化学	9,386	220,477.14	0.20
110	301377	鼎泰高科	400	220,360.00	0.20
111	300782	卓胜微	2,004	219,598.32	0.19
112	002126	银轮股份	4,300	214,140.00	0.19
113	001389	广合科技	900	213,525.00	0.19
114	002738	中矿资源	3,600	212,364.00	0.19
115	002222	福晶科技	2,300	212,244.00	0.19
116	300316	晶盛机电	3,500	211,400.00	0.19
117	000831	中国稀土	3,800	210,862.00	0.19
118	000960	锡业股份	4,800	204,912.00	0.18
119	000166	申万宏源	45,420	199,848.00	0.18
120	300803	指南针	2,175	199,382.25	0.18
121	000066	中国长城	10,428	198,653.40	0.18
122	300015	爱尔眼科	24,015	198,363.90	0.18
123	000538	云南白药	4,159	197,011.83	0.17
124	002821	凯莱英	1,200	194,400.00	0.17
125	002129	TCL 中环	15,800	189,916.00	0.17
126	300418	昆仑万维	4,700	189,692.00	0.17
127	301358	湖南裕能	2,500	189,675.00	0.17
128	002850	科达利	1,000	189,300.00	0.17
129	002311	海大集团	4,240	189,146.40	0.17
130	002195	岩山科技	28,500	186,390.00	0.17
131	000625	长安汽车	25,909	185,767.53	0.16
132	000157	中联重科	26,441	184,293.77	0.16
133	000933	神火股份	8,500	180,200.00	0.16
134	002532	天山铝业	16,600	178,118.00	0.16

135	002240	盛新锂能	3,900	174,837.00	0.15
136	300438	鹏辉能源	2,100	173,985.00	0.15
137	002558	巨人网络	6,300	173,628.00	0.15
138	300776	帝尔激光	800	171,968.00	0.15
139	002340	格林美	26,010	171,926.10	0.15
140	002236	大华股份	10,332	170,374.68	0.15
141	300339	润和软件	4,300	165,593.00	0.15
142	002203	海亮股份	7,200	164,520.00	0.15
143	003031	中瓷电子	900	162,270.00	0.14
144	301611	珂玛科技	900	162,063.00	0.14
145	300458	全志科技	4,000	157,840.00	0.14
146	300236	上海新阳	1,200	157,800.00	0.14
147	000975	山金国际	9,272	157,624.00	0.14
148	002261	拓维信息	5,600	156,856.00	0.14
149	002517	恺英网络	9,600	156,000.00	0.14
150	300001	特锐德	4,100	155,103.00	0.14
151	002595	豪迈科技	3,325	154,945.00	0.14
152	301536	星辰科技	1,200	154,452.00	0.14
153	002472	双环传动	3,700	153,587.00	0.14
154	002456	欧菲光	16,200	153,252.00	0.14
155	301236	软通动力	3,600	152,820.00	0.14
156	300017	网宿科技	11,700	152,217.00	0.13
157	000783	长江证券	15,525	151,368.75	0.13
158	002074	国轩高科	5,500	151,305.00	0.13
159	002493	荣盛石化	14,000	150,500.00	0.13
160	002131	利欧股份	31,500	149,625.00	0.13
161	002736	国信证券	14,900	148,851.00	0.13
162	003816	中国广核	37,900	148,189.00	0.13
163	300347	泰格医药	3,050	146,400.00	0.13
164	002966	苏州银行	20,900	145,464.00	0.13
165	301200	大族数控	400	144,260.00	0.13
166	002555	三七互娱	7,600	143,412.00	0.13
167	301269	华大九天	1,200	143,304.00	0.13
168	000733	振华科技	2,500	141,600.00	0.13
169	002245	蔚蓝锂芯	7,496	140,250.16	0.12
170	002601	龙佰集团	8,500	140,080.00	0.12
171	002797	第一创业	21,120	138,758.40	0.12
172	002920	德赛西威	1,700	138,550.00	0.12
173	000301	东方盛虹	12,100	138,545.00	0.12
174	000768	中航西飞	6,760	138,444.80	0.12
175	300870	欧陆通	400	138,276.00	0.12
176	002056	横店东磁	4,500	137,160.00	0.12
177	300759	康龙化成	4,725	136,694.25	0.12

178	300456	赛微电子	3,200	135,904.00	0.12
179	000893	亚钾国际	3,300	134,937.00	0.12
180	300207	欣旺达	7,102	134,866.98	0.12
181	300454	深信服	1,400	134,680.00	0.12
182	301205	联特科技	400	133,640.00	0.12
183	002487	大金重工	2,300	133,331.00	0.12
184	000060	中金岭南	17,500	132,475.00	0.12
185	300866	安克创新	1,260	131,670.00	0.12
186	000703	恒逸石化	9,700	131,629.00	0.12
187	002304	洋河股份	3,435	131,045.25	0.12
188	300115	长盈精密	4,679	130,731.26	0.12
189	002155	湖南黄金	5,389	128,635.43	0.11
190	002465	海格通信	10,030	128,083.10	0.11
191	300088	长信科技	11,000	127,600.00	0.11
192	002432	九安医疗	1,800	127,224.00	0.11
193	000034	神州数码	4,560	126,540.00	0.11
194	000547	航天发展	6,600	126,390.00	0.11
195	300623	捷捷微电	2,800	125,972.00	0.11
196	002335	科华数据	2,935	124,590.75	0.11
197	300496	中科创达	2,000	123,580.00	0.11
198	002025	航天电器	1,621	123,552.62	0.11
199	300811	铂科新材	1,300	123,357.00	0.11
200	001267	汇绿生态	2,300	123,050.00	0.11
201	300568	星源材质	6,491	121,511.52	0.11
202	000895	双汇发展	5,417	121,340.80	0.11
203	002444	巨星科技	3,900	121,290.00	0.11
204	300474	景嘉微	2,000	120,960.00	0.11
205	000963	华东医药	4,300	120,916.00	0.11
206	002414	高德红外	9,100	120,666.00	0.11
207	002271	东方雨虹	10,143	120,397.41	0.11
208	300024	机器人	6,200	119,846.00	0.11
209	002429	兆驰股份	11,400	118,446.00	0.10
210	300763	锦浪科技	1,300	117,455.00	0.10
211	001979	招商蛇口	18,263	117,431.09	0.10
212	300748	金力永磁	3,800	117,230.00	0.10
213	002756	永兴材料	2,050	116,112.00	0.10
214	000878	云南铜业	7,300	115,924.00	0.10
215	301626	苏州天脉	300	115,188.00	0.10
216	002402	和而泰	4,400	113,652.00	0.10
217	000423	东阿阿胶	2,500	113,400.00	0.10
218	002128	电投能源	4,900	113,288.00	0.10
219	300724	捷佳伟创	1,600	112,960.00	0.10
220	000661	长春高新	1,694	112,820.40	0.10

221	002747	埃斯顿	3,000	111,990.00	0.10
222	002252	上海莱士	25,800	111,972.00	0.10
223	300073	当升科技	2,300	110,492.00	0.10
224	000002	万科A	36,400	107,744.00	0.10
225	002078	太阳纸业	8,600	107,414.00	0.10
226	002653	海思科	1,600	106,144.00	0.09
227	300142	沃森生物	8,100	105,219.00	0.09
228	300432	富临精工	5,200	104,468.00	0.09
229	300919	中伟新材	2,380	104,125.00	0.09
230	002831	裕同科技	2,924	103,977.44	0.09
231	002497	雅化集团	5,100	103,887.00	0.09
232	002378	章源钨业	3,100	103,788.00	0.09
233	000728	国元证券	13,790	103,287.10	0.09
234	300012	华测检测	7,400	102,564.00	0.09
235	300747	锐科激光	1,900	100,871.00	0.09
236	002617	露笑科技	9,700	99,813.00	0.09
237	300953	震裕科技	740	98,938.00	0.09
238	300558	贝达药业	1,500	97,605.00	0.09
239	000519	中兵红箭	4,600	96,922.00	0.09
240	002130	沃尔核材	5,100	96,696.00	0.09
241	300679	电连技术	1,600	95,984.00	0.09
242	000969	安泰科技	3,900	95,706.00	0.08
243	300677	英科医疗	2,400	94,008.00	0.08
244	302132	中航成飞	1,600	93,312.00	0.08
245	300383	光环新网	7,400	92,056.00	0.08
246	300628	亿联网络	2,710	91,652.20	0.08
247	300102	乾照光电	3,500	91,140.00	0.08
248	300699	光威复材	3,141	89,989.65	0.08
249	002223	鱼跃医疗	3,500	89,810.00	0.08
250	001965	招商公路	9,800	89,768.00	0.08
251	000617	中油资本	13,600	89,624.00	0.08
252	002294	信立泰	2,800	89,292.00	0.08
253	000786	北新建材	4,896	88,568.64	0.08
254	300487	蓝晓科技	1,500	88,275.00	0.08
255	300832	新产业	2,100	88,200.00	0.08
256	000032	深桑达A	3,500	87,325.00	0.08
257	002624	完美世界	7,000	86,940.00	0.08
258	001203	大中矿业	2,900	86,855.00	0.08
259	300972	万辰集团	500	86,705.00	0.08
260	300255	常山药业	3,700	86,654.00	0.08
261	002044	美年健康	17,000	85,510.00	0.08
262	000766	通化金马	4,400	85,360.00	0.08
263	301171	易点天下	2,500	84,900.00	0.08

264	002318	久立特材	3,500	83,650.00	0.07
265	002673	西部证券	12,848	83,383.52	0.07
266	001696	宗申动力	4,000	83,240.00	0.07
267	300251	光线传媒	7,500	83,175.00	0.07
268	000958	电投产融	14,700	82,908.00	0.07
269	002064	华峰化学	8,700	82,563.00	0.07
270	300627	华测导航	2,900	82,360.00	0.07
271	301550	斯菱智驱	900	82,287.00	0.07
272	000688	国城矿业	2,400	82,152.00	0.07
273	000623	吉林敖东	4,600	81,558.00	0.07
274	000559	万向钱潮	6,300	81,459.00	0.07
275	000999	华润三九	3,600	80,964.00	0.07
276	300364	中文在线	3,400	80,206.00	0.07
277	002506	协鑫集成	24,800	78,864.00	0.07
278	000887	中鼎股份	4,400	78,716.00	0.07
279	002065	东华软件	11,000	78,540.00	0.07
280	002180	奔图科技	4,800	78,528.00	0.07
281	000400	许继电气	3,600	78,120.00	0.07
282	002176	江特电机	7,800	78,078.00	0.07
283	000683	博源化工	13,500	77,760.00	0.07
284	000750	国海证券	21,100	77,648.00	0.07
285	000039	中集集团	9,550	77,450.50	0.07
286	002015	协鑫能科	4,700	76,704.00	0.07
287	002085	万丰奥威	6,900	76,521.00	0.07
288	002151	北斗星通	2,400	76,200.00	0.07
289	002683	广东宏大	2,600	76,154.00	0.07
290	300726	宏达电子	900	76,113.00	0.07
291	300002	神州泰岳	9,700	75,757.00	0.07
292	000155	川能动力	6,300	75,474.00	0.07
293	300999	金龙鱼	3,242	75,408.92	0.07
294	000983	山西焦煤	13,000	75,400.00	0.07
295	000050	深天马 A	7,600	75,316.00	0.07
296	002518	科士达	1,400	75,026.00	0.07
297	002739	儒意电影	7,800	74,880.00	0.07
298	002459	晶澳科技	9,208	74,584.80	0.07
299	002405	四维图新	11,500	74,405.00	0.07
300	000415	渤海租赁	18,200	74,074.00	0.07
301	002266	浙富控股	14,600	73,876.00	0.07
302	000967	盈峰环境	7,000	73,710.00	0.07
303	300003	乐普医疗	6,200	73,470.00	0.07
304	002841	视源股份	2,100	72,513.00	0.06
305	301165	锐捷网络	896	72,083.20	0.06
306	000970	中科三环	4,700	71,393.00	0.06

307	002430	杭氧股份	2,300	71,208.00	0.06
308	301095	广立微	600	70,830.00	0.06
309	300896	爱美客	800	69,760.00	0.06
310	000876	新希望	11,000	68,970.00	0.06
311	000738	航发控制	3,751	68,605.79	0.06
312	300122	智飞生物	5,800	67,802.00	0.06
313	002603	以岭药业	4,500	67,500.00	0.06
314	300773	拉卡拉	4,380	67,014.00	0.06
315	000997	新大陆	4,100	66,830.00	0.06
316	002237	恒邦股份	4,500	66,105.00	0.06
317	002152	广电运通	6,975	65,425.50	0.06
318	001287	中电港	2,100	65,415.00	0.06
319	000875	电投绿能	12,700	65,405.00	0.06
320	300296	利亚德	11,600	64,960.00	0.06
321	000951	中国重汽	3,300	64,383.00	0.06
322	002389	航天彩虹	3,600	63,972.00	0.06
323	000596	古井贡酒	800	63,840.00	0.06
324	000729	燕京啤酒	6,300	63,819.00	0.06
325	000591	太阳能	13,800	63,480.00	0.06
326	000737	北方铜业	4,800	63,456.00	0.06
327	300253	卫宁健康	9,385	63,161.05	0.06
328	002249	大洋电机	8,300	62,250.00	0.06
329	000686	东北证券	7,400	62,160.00	0.06
330	002048	宁波华翔	2,700	62,100.00	0.06
331	002926	华西证券	7,600	62,092.00	0.06
332	002007	华兰生物	5,085	61,986.15	0.05
333	000422	湖北宜化	4,400	61,820.00	0.05
334	000062	深圳华强	1,900	60,458.00	0.05
335	002410	广联达	7,400	60,384.00	0.05
336	000921	海信家电	2,200	60,104.00	0.05
337	002939	长城证券	7,200	60,048.00	0.05
338	001280	中国铀业	900	60,030.00	0.05
339	000830	鲁西化工	5,000	60,000.00	0.05
340	301029	怡合达	2,200	59,422.00	0.05
341	300573	兴齐眼药	1,457	59,387.32	0.05
342	000528	柳工	7,800	58,890.00	0.05
343	000973	佛塑科技	4,100	58,835.00	0.05
344	002958	青农商行	21,400	58,636.00	0.05
345	000932	华菱钢铁	16,780	58,226.60	0.05
346	002262	恩华药业	3,100	58,125.00	0.05
347	000682	东方电子	4,600	58,098.00	0.05
348	000708	中信特钢	4,570	57,673.40	0.05
349	300765	石药创新	2,100	57,183.00	0.05

350	300182	捷成股份	12,000	57,000.00	0.05
351	301219	腾远钴业	1,040	56,992.00	0.05
352	000799	酒鬼酒	1,300	56,810.00	0.05
353	000513	丽珠集团	1,958	56,566.62	0.05
354	002270	华明装备	3,000	56,550.00	0.05
355	002895	川恒股份	1,900	55,480.00	0.05
356	300229	拓尔思	4,000	55,280.00	0.05
357	300459	汤姆猫	16,300	55,257.00	0.05
358	300777	中简科技	2,100	55,188.00	0.05
359	301297	富乐德	900	55,116.00	0.05
360	000739	普洛药业	3,300	54,978.00	0.05
361	000582	北部湾港	5,100	54,723.00	0.05
362	003022	联泓新科	2,100	54,390.00	0.05
363	002607	中公教育	30,200	54,360.00	0.05
364	000009	中国宝安	8,600	53,578.00	0.05
365	300779	惠城环保	1,060	53,212.00	0.05
366	002312	川发龙蟒	5,800	53,186.00	0.05
367	002500	山西证券	10,200	52,632.00	0.05
368	300676	华大基因	1,500	52,590.00	0.05
369	300468	四方精创	2,500	52,525.00	0.05
370	300735	光弘科技	2,300	52,302.00	0.05
371	300413	芒果超媒	3,540	51,790.20	0.05
372	002299	圣农发展	3,400	51,544.00	0.05
373	301316	慧博云通	1,300	51,194.00	0.05
374	002468	申通快递	3,500	50,960.00	0.05
375	002139	拓邦股份	5,300	50,456.00	0.04
376	000987	越秀资本	6,400	50,048.00	0.04
377	002568	百润股份	2,952	49,947.84	0.04
378	002948	青岛银行	9,800	49,784.00	0.04
379	301275	汉朔科技	1,100	49,390.00	0.04
380	002544	普天科技	2,700	49,194.00	0.04
381	300718	长盛轴承	800	48,776.00	0.04
382	002545	东方铁塔	3,000	48,660.00	0.04
383	300775	三角防务	2,200	48,488.00	0.04
384	000723	美锦能源	14,400	48,240.00	0.04
385	300674	宇信科技	3,200	48,160.00	0.04
386	002439	启明星辰	3,800	48,070.00	0.04
387	002507	涪陵榨菜	4,420	47,736.00	0.04
388	000581	威孚高科	2,800	47,656.00	0.04
389	000598	兴蓉环境	7,400	47,508.00	0.04
390	000778	新兴铸管	12,800	47,488.00	0.04
391	000628	高新发展	1,000	47,400.00	0.04
392	300100	双林股份	1,700	47,226.00	0.04

393	300638	广和通	2,540	47,015.40	0.04
394	000998	隆平高科	6,200	46,748.00	0.04
395	002385	大北农	16,850	46,506.00	0.04
396	300144	宋城演艺	8,000	46,480.00	0.04
397	300457	赢合科技	2,200	46,376.00	0.04
398	300034	钢研高纳	2,700	46,278.00	0.04
399	301345	涛涛车业	200	46,200.00	0.04
400	002244	滨江集团	6,000	45,600.00	0.04
401	300009	安科生物	5,700	44,745.00	0.04
402	002583	海能达	5,800	44,602.00	0.04
403	000935	四川双马	1,700	44,353.00	0.04
404	300146	汤臣倍健	4,900	44,296.00	0.04
405	002120	韵达股份	6,900	43,884.00	0.04
406	003021	兆威机电	500	43,675.00	0.04
407	002984	森麒麟	3,320	43,392.40	0.04
408	000801	四川九洲	3,300	42,702.00	0.04
409	002698	博实股份	3,500	42,245.00	0.04
410	000027	深圳能源	6,800	42,160.00	0.04
411	000563	陕国投 A	15,000	41,400.00	0.04
412	002531	天顺风能	4,900	41,307.00	0.04
413	002268	电科网安	3,200	41,280.00	0.04
414	000429	粤高速 A	3,000	40,950.00	0.04
415	300601	康泰生物	3,600	40,824.00	0.04
416	000099	中信海直	2,800	40,768.00	0.04
417	001286	陕西能源	4,000	40,560.00	0.04
418	002670	国盛证券	3,600	39,600.00	0.04
419	002701	奥瑞金	9,220	39,277.20	0.03
420	000825	太钢不锈	11,200	38,192.00	0.03
421	000902	新洋丰	3,300	38,148.00	0.03
422	002508	老板电器	2,600	38,012.00	0.03
423	000883	湖北能源	8,700	37,584.00	0.03
424	002019	亿帆医药	4,000	37,400.00	0.03
425	002373	千方科技	5,200	37,336.00	0.03
426	300357	我武生物	1,600	37,312.00	0.03
427	300529	健帆生物	2,410	37,114.00	0.03
428	000543	皖能电力	4,900	37,093.00	0.03
429	000555	神州信息	3,600	37,080.00	0.03
430	000709	河钢股份	19,100	37,054.00	0.03
431	002091	江苏国泰	5,100	36,873.00	0.03
432	002773	康弘药业	1,800	36,810.00	0.03
433	301606	绿联科技	600	36,612.00	0.03
434	000800	一汽解放	6,100	36,295.00	0.03
435	002925	盈趣科技	1,470	36,250.20	0.03

436	300682	朗新科技	3,600	35,640.00	0.03
437	000029	深深房 A	1,600	35,280.00	0.03
438	300070	碧水源	10,900	34,771.00	0.03
439	300957	贝泰妮	1,100	34,661.00	0.03
440	300761	立华股份	2,100	34,461.00	0.03
441	000088	盐田港	8,400	34,356.00	0.03
442	300660	江苏雷利	1,230	34,267.80	0.03
443	002408	齐翔腾达	7,300	34,237.00	0.03
444	002368	太极股份	2,400	33,576.00	0.03
445	002153	石基信息	4,600	33,258.00	0.03
446	003035	南网能源	5,700	33,174.00	0.03
447	300979	华利集团	1,100	32,725.00	0.03
448	000791	甘肃能源	4,300	32,680.00	0.03
449	001391	国货航	8,000	32,560.00	0.03
450	002906	华阳集团	1,300	32,448.00	0.03
451	002416	爱施德	3,600	32,256.00	0.03
452	002032	苏泊尔	800	31,680.00	0.03
453	000539	粤电力 A	4,600	31,326.00	0.03
454	000156	华数传媒	4,900	30,919.00	0.03
455	300910	瑞丰新材	1,100	30,844.00	0.03
456	301589	诺瓦星云	200	29,796.00	0.03
457	000089	深圳机场	4,900	29,547.00	0.03
458	002372	伟星新材	3,600	29,484.00	0.03
459	000966	长源电力	7,500	29,400.00	0.03
460	301238	瑞泰新材	1,200	29,280.00	0.03
461	000069	华侨城 A	17,844	29,264.16	0.03
462	300428	立中集团	1,600	29,088.00	0.03
463	002010	传化智联	6,400	28,608.00	0.03
464	301301	川宁生物	3,600	28,584.00	0.03
465	301039	中集车辆	4,000	28,200.00	0.02
466	300888	稳健医疗	1,000	27,990.00	0.02
467	000877	天山股份	7,500	27,225.00	0.02
468	000537	绿发电力	3,700	27,047.00	0.02
469	002608	江苏国信	3,900	26,910.00	0.02
470	002847	盐津铺子	600	26,760.00	0.02
471	002690	美亚光电	1,800	25,794.00	0.02
472	000959	首钢股份	7,300	25,623.00	0.02
473	000937	冀中能源	6,210	24,715.80	0.02
474	002755	奥赛康	1,800	24,516.00	0.02
475	002096	易普力	2,700	23,706.00	0.02
476	001872	招商港口	1,200	23,316.00	0.02
477	002978	安宁股份	900	23,067.00	0.02
478	002265	建设工业	1,300	22,620.00	0.02

479	002320	海峡股份	3,600	22,572.00	0.02
480	002563	森马服饰	4,300	21,672.00	0.02
481	002945	华林证券	1,600	21,488.00	0.02
482	301155	海力风电	500	21,450.00	0.02
483	000785	居然智家	10,400	20,800.00	0.02
484	301656	联合动力	1,200	20,676.00	0.02
485	000898	鞍钢股份	11,000	20,570.00	0.02
486	301498	乖宝宠物	500	20,295.00	0.02
487	002060	广东建工	6,600	19,998.00	0.02
488	002901	大博医疗	400	16,712.00	0.01
489	002461	珠江啤酒	2,100	15,897.00	0.01
490	001213	中铁特货	4,700	15,745.00	0.01
491	301267	华夏眼科	1,000	14,590.00	0.01
492	001289	龙源电力	800	12,504.00	0.01
493	001386	马可波罗	600	8,496.00	0.01
494	001221	悍高集团	200	8,044.00	0.01

7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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
6	301531	春光集团	120	6,187.20	0.01
7	301669	高特电子	215	6,106.00	0.01
8	301687	新广益	78	6,066.84	0.01
9	301696	三瑞智能	62	5,381.60	0.00
10	301599	理奇智能	126	4,091.22	0.00
11	301680	固德电材	33	3,701.28	0.00
12	001365	天海电子	108	3,381.48	0.00
13	301513	尚水智能	65	3,312.40	0.00
14	001393	维通利	75	2,924.25	0.00
15	301683	慧谷新材	23	2,800.71	0.00
16	001237	惠康科技	44	2,584.56	0.00
17	001220	世盟股份	27	750.06	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	938,140.00	0.90

2	300308	中际旭创	433,830.00	0.42
3	000333	美的集团	398,151.00	0.38
4	002428	云南锗业	301,325.94	0.29
5	300059	东方财富	297,772.00	0.29
6	300502	新易盛	287,016.00	0.27
7	002475	立讯精密	283,524.00	0.27
8	301511	德福科技	265,247.00	0.25
9	002602	世纪华通	242,590.00	0.23
10	002594	比亚迪	237,429.00	0.23
11	301217	铜冠铜箔	234,671.00	0.22
12	300620	光库科技	219,117.00	0.21
13	000725	京东方 A	163,763.00	0.16
14	301308	江波龙	155,484.00	0.15
15	000858	五 粮 液	153,393.00	0.15
16	000651	格力电器	144,239.00	0.14
17	002384	东山精密	134,996.00	0.13
18	000338	潍柴动力	134,119.00	0.13
19	301205	联特科技	127,376.00	0.12
20	300274	阳光电源	120,995.00	0.12

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,717,102.00	1.64
2	300308	中际旭创	1,390,002.00	1.33
3	300502	新易盛	952,796.00	0.91
4	000333	美的集团	707,891.60	0.68
5	002475	立讯精密	527,745.00	0.51
6	300059	东方财富	504,594.00	0.48
7	002594	比亚迪	422,863.00	0.40
8	002384	东山精密	380,744.00	0.36
9	300274	阳光电源	324,708.00	0.31
10	000725	京东方 A	282,321.00	0.27
11	000651	格力电器	274,960.00	0.26
12	000858	五 粮 液	266,431.00	0.26
13	300476	胜宏科技	248,211.00	0.24
14	000338	潍柴动力	230,712.00	0.22
15	300124	汇川技术	212,140.00	0.20
16	002463	沪电股份	198,824.00	0.19
17	000063	中兴通讯	197,278.00	0.19
18	002415	海康威视	192,601.00	0.18
19	002714	牧原股份	178,486.00	0.17

20	000425	徐工机械	176,394.00	0.17
----	--------	------	------------	------

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	12,168,856.44
卖出股票收入（成交）总额	24,636,337.95

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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

7.6 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

金额单位：人民币元

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

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 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贵金属投资明细

无。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,552.20
2	应收清算款	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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	448,184.25

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	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

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份 额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
融通深证成份指数 A/B	5,881	9,658.09	-	-	56,799,228.27	100.00
融通深证成份指数 C	4,615	3,492.57	-	-	16,118,199.86	100.00
合计	10,496	6,947.16	-	-	72,917,428.13	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从 业人员持有本基金	融通深证成份指数 A/B	6,368.27	0.01121
	融通深证成份指数 C	47.34	0.00029
	合计	6,415.61	0.00880

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研发部门 负责人持有本开放式 基金	融通深证成份指数 A/B	0
	融通深证成份指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	融通深证成份指数 A/B	0
	融通深证成份指数 C	0
	合计	0

§ 9 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
基金合同生效日 (2010 年 11 月 15)	1,848,841,553.44	-

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	66,567,237.68	12,659,419.10
本报告期基金总申购份额	12,285,599.63	27,107,282.53
减: 本报告期基金总赎回份额	22,053,609.04	23,648,501.77
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	56,799,228.27	16,118,199.86

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内, 本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内, 本基金的基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内, 无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内, 本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙), 该事务所自 2024 年 11 月 12 日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内, 本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内, 本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
诚通证券	2	13,832,541.87	37.85	2,571.51	37.85	-
国泰海通证券	1	12,680,627.46	34.70	2,357.00	34.69	-
华福证券	2	4,449,306.80	12.17	827.37	12.18	-
华泰证券	1	2,078,516.00	5.69	386.47	5.69	-
中信建投	1	2,003,090.00	5.48	372.43	5.48	-
中金公司	1	1,438,931.81	3.94	267.47	3.94	-
长江证券	1	61,892.25	0.17	11.50	0.17	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	1	-	-	-	-	-

注：1. 租用证券公司交易单元的标准为：

- （1）财务状况良好，最近一年经审计的净资产原则上不低于 20 亿元；
- （2）经营行为规范，最近一年内不存在可能影响证券研究服务和经纪业务稳定性的重大行

政处罚或者刑事处罚；

(3) 不存在对拟提供交易、研究服务已经造成或者可能造成不良影响的诉讼、仲裁或其他重大事项；

(4) 合规风控能力和交易等服务能力较强；

(5) 拥有良好的公司声誉；

(6) 交易、研究等服务能力较强，具有全面综合的研究服务能力，或在具体领域具有突出的特色研究服务，或能够提供较好的交易服务，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；

(7) 券商分类监管评级原则上不得为 D 及以下。

2. 租用证券公司交易单元的程序为：

(1) 评价拟引进券商。发起部门组织拟引进券商填写《合作券商审慎调查表》。相关部门对拟引进券商评价。

(2) 上报批准。发起部门将相关部门一致同意的拟引进合作券商情况、评价意见和《合作券商审慎调查表》形成内部审批流程，经相关负责人审批同意后，与券商签署相关协议。

3. 交易单元变更情况

本报告期内交易单元无变更。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
诚通证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	17,731.40	100.00	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通基金管理有限公司关于取消监事暨监事离任公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 9 日
2	融通深证成份指数证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资、转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 15 日
3	融通深证成份指数证券投资基金第六次分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 15 日
4	融通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
5	2025 年度融通基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 30 日
6	融通基金关于旗下部分开放式基金在深圳市排排网基金销售有限责任公司开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 14 日
7	融通基金管理有限公司关于暂停中证金牛（北京）基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 30 日
8	融通基金管理有限公司关于终止与中证金牛（北京）基金销售有限公司相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 5 日
9	融通基金关于旗下部分开放式基金参加中国人	中国证监会指	2026 年 6 月 15 日

	寿保险股份有限公司前端申购费率优惠活动及开通相关业务的公告	定报刊及网站	
10	融通基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 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 8 月 28 日