融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

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巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)（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 基金管理人和基金托管人 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遵规守信情况的说明 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 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
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 13

§5 托管人报告 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13

6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 17

§7 投资组合报告 39

7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
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 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 46

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 46
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 46
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 46
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 46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 47
7.12 投资组合报告附注 47

§8 基金份额持有人信息 48

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 48
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 48

§9 开放式基金份额变动 48

§10 重大事件揭示 49

10.1 基金份额持有人大会决议 49
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 49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 49
10.4 基金投资策略的改变 49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 49
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 49
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 50
10.8 其他重大事件 51

§11 影响投资者决策的其他重要信息 51

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 51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 51

§12 备查文件目录 52

12.1 备查文件目录 52
12.2 存放地点 52
12.3 查阅方式 52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)	
基金简称	融通巨潮 100 指数（LOF）	
基金主代码	161607	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2005 年 5 月 12 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	354,549,669.28 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2005 年 6 月 16 日	
下属分级基金的基金简称	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C
下属分级基金的场内简称	巨潮 100LOF	-
下属分级基金的交易代码	161607	004874
下属分级基金的前端交易代码	161607	-
下属分级基金的后端交易代码	161657	-
报告期末下属分级基金的份额总额	351,488,694.79 份	3,060,974.49 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金。在控制股票投资组合相对巨潮 100 目标指数跟踪误差的基础上，力求获得超越巨潮 100 目标指数的投资收益，追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果，实现基金财产的长期增长，为投资者带来稳定的回报。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在控制股票投资组合相对目标指数偏离风险的基础上，力争获得超越目标指数的投资收益。基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离目标指数的风险，本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制 0.5%。
业绩比较基准	巨潮 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平

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	中国证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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)	
	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C
本期已实现收益	25,118,384.84	177,896.46
本期利润	21,247,413.00	150,121.34
加权平均基金份额本期利润	0.0573	0.0473
本期加权平均净值利润率	4.84%	4.62%
本期基金份额净值增长率	5.07%	4.77%
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	18,441,892.27	87,380.05
期末可供分配基金份额利润	0.0525	0.0285
期末基金资产净值	437,214,264.54	3,297,162.76
期末基金份额净值	1.244	1.077
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	590.95%	76.73%

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

融通巨潮 100 指数 A/B

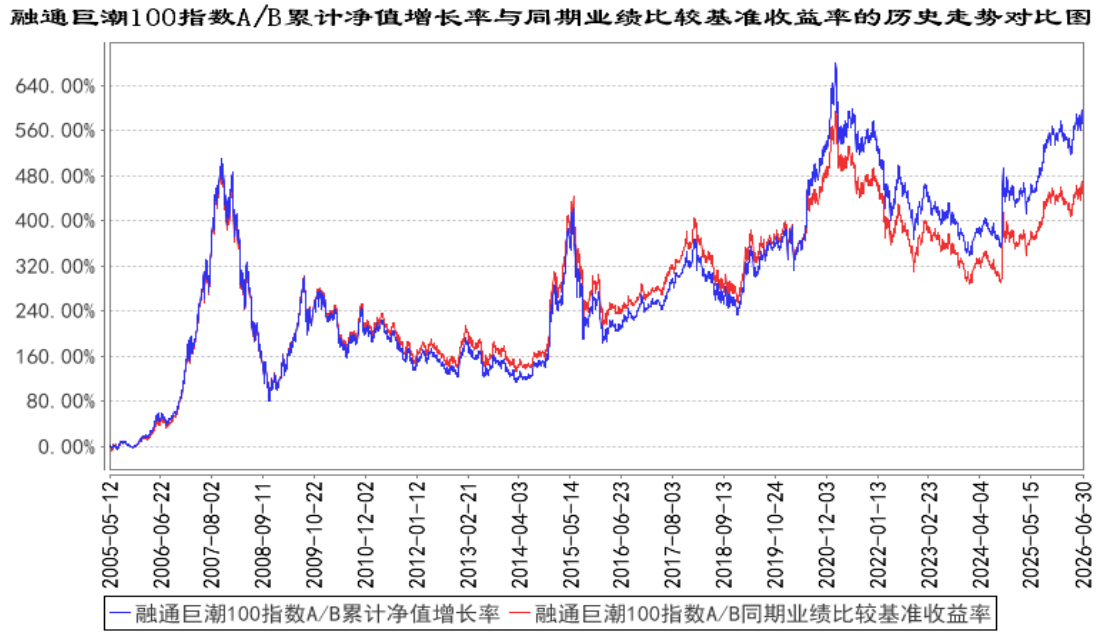
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	11.07%	1.11%	9.75%	1.12%	1.32%	-0.01%
过去六个月	5.07%	0.99%	3.40%	1.00%	1.67%	-0.01%
过去一年	22.32%	0.89%	17.78%	0.90%	4.54%	-0.01%
过去三年	36.25%	1.01%	24.14%	1.02%	12.11%	-0.01%
过去五年	-0.57%	1.08%	-8.59%	1.06%	8.02%	0.02%
过去七年	59.13%	1.14%	22.47%	1.10%	36.66%	0.04%
过去十年	119.07%	1.13%	63.52%	1.09%	55.55%	0.04%
自基金合同生效起至今	590.95%	1.52%	461.99%	1.49%	128.96%	0.03%

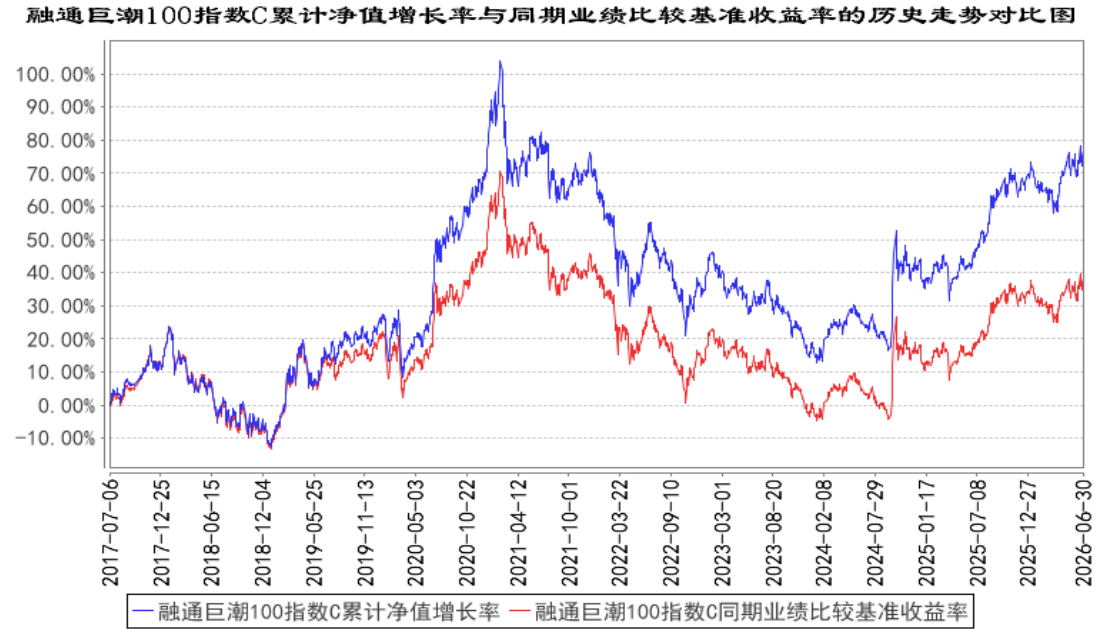
融通巨潮 100 指数 C

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	10.92%	1.11%	9.75%	1.12%	1.17%	-0.01%
过去六个月	4.77%	0.99%	3.40%	1.00%	1.37%	-0.01%
过去一年	21.83%	0.89%	17.78%	0.90%	4.05%	-0.01%
过去三年	34.62%	1.01%	24.14%	1.02%	10.48%	-0.01%
过去五年	-2.55%	1.08%	-8.59%	1.06%	6.04%	0.02%
过去七年	54.65%	1.14%	22.47%	1.10%	32.18%	0.04%
自基金合同生效起至今	76.73%	1.17%	38.08%	1.13%	38.65%	0.04%

注：本基金于 2017 年 7 月 5 日增设 C 类份额，该类份额的首次确认日为 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





注：本基金于 2017 年 7 月 5 日增设 C 类份额，该类份额的首次确认日为 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	2015 年 2 月 11 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。
熊俊杰	本基金的基金经理	2023 年 10 月 17 日	-	8 年	熊俊杰先生，理学硕士，8 年证券基金行业从业经历，具有基金从业资格。2017 年 10 月至 2018 年 11 月在招商期货有限公司

					资产管理部工作,2018 年 12 月至 2023 年 7 月在新华基金管理股份有限公司先后担任研究员、投资经理、基金经理助理,2023 年 7 月加入融通基金管理有限公司。现任融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)基金经理、融通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、融通深证 100 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、融通上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。

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 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

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想，并将此原

则贯彻于基金的运作之中。本基金运用量化投资策略进行指数增强和风险管理，在控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差下，力求最终为投资者带来超越业绩比较基准的收益。

回顾 2026 年上半年，巨潮 100 上涨 3.54%，沪深 300 上涨 7.55%，中证 500 上涨 20.97%，中证 1000 上涨 15.99%，创业板指上涨 35.58%，总体呈现中大盘成长占优的行情，大盘价值板块表现相对稳健。市场日均成交额约 2.7 万亿，相较 2025 年下半年明显放量；两融余额显著攀升，其占流通市值的比例亦同步提升；近 60 个交易日新成立偏股基金份额约 2300 亿，较前期略有回落。总体而言，市场情绪持续走高。

在指数增强方面，本基金持续深耕多因子多策略的量化选股增强模型，通过在不同风格域中构建不同的增强策略，最后再将多策略整合为综合增强策略。2026 年上半年，首先，持续基于 Level-2 数据挖掘高频量价因子，丰富模型的 Alpha 来源；同时，利用 AI 大模型挖掘一些与现有因子低相关的特色因子，进一步拓宽模型的 Alpha 获取广度。风险管理方面，2026 年上半年持续采用现有较为成熟的风险管理框架，同时，也利用 AI 大模型去捕捉市场的特色风险项，对现有的风险管理框架进行拓展。总体而言，截至 2026 年上半年末，组合总体风格较为均衡，变动不大。从风格暴露上看，在满足风险约束的前提下，组合在 Barra 风格因子上的暴露均较低；相对来看，在低估值上的暴露先降后升，在成长因子上的暴露先升后降。未来，本基金还是会基于量化模型得到最终持仓，Alpha 模型和风险管理模型也会结合具体情况持续优化升级。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通巨潮 100 指数 A/B 基金份额净值为 1.244 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.07%，同期业绩比较基准收益率为 3.40%；

截至本报告期末融通巨潮 100 指数 C 基金份额净值为 1.077 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.77%，同期业绩比较基准收益率为 3.40%。

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，国内宏观经济在“十五五”规划开局及各项稳增长政策的协同发力下，延续了温和复苏的态势。内需潜力在政策引导下逐步释放，新质生产力相关领域表现活跃，经济结构持续优化。A 股市场在经历 2025 年底的蓄势盘整后，总体呈现震荡分化格局，以人工智能、半导体、高端制造为代表的科技成长板块在产业政策催化下成为核心主线。然而，外部环境在上半年发生了预期之外的剧烈反转。年初，市场普遍预期美联储将延续降息周期，但在 AI 资本开支过热、中东地缘冲突推升油价等多重因素交织下，美国通胀黏性超预期，核心 PCE 物价指数持续反弹。6 月美联储议息会议虽维持利率不变，但点阵图彻底删除了年内降息预期，甚至显示多名委员支持加息。这一“由鸽转鹰”的剧烈预期修正，导致美债收益率大幅飙升，美元指数走强，

对全球风险偏好及新兴市场流动性形成了阶段性压制。

展望 2026 年下半年，内部来看，适度宽松的货币政策和积极有为的财政政策仍将保驾护航，政策空间保持灵活。“十五五”规划元年的各项产业细则有望加速落地，经济基本面有望持续企稳向好，上市公司盈利端有望迎来进一步改善，为 A 股市场提供坚实的内部支撑。外部来看，美联储的货币政策走向成为最大外部变量。当前市场或已充分定价美联储年内重启加息的预期，全球流动性环境面临收紧压力。高企的美债收益率和强势美元可能持续对全球风险偏好形成压制，外资流入新兴市场的节奏或受到一定扰动。但考虑到国内经济基本面的韧性以及货币政策“以我为主”的独立性，A 股受外部冲击的影响预计相对可控，更多表现为情绪面和资金面的阶段性波折。

从风格配置来看，第一，在海外流动性预期收紧、国内经济温和复苏的背景下，市场核心驱动力正逐渐从前期的估值修复转向盈利驱动。与经济基本面强相关、具备真实盈利兑现能力的行业龙头有望占优；同时，小微盘风格前期交易拥挤，在内外部博弈加剧下存在较高的调整风险。第二，尽管外部高利率环境对高估值成长股形成一定压制，但“十五五”规划下的科技产业升级（如 AI 应用、半导体国产替代、商业航天）具备独立的产业景气周期，那些掌握核心技术、具备全球化竞争力的中大盘科技龙头仍能享受成长溢价。总体而言，大小盘维度，中大盘或将占优；成长价值维度，或将更趋于均衡，但具备业绩支撑的硬科技成长或仍是未来的主线。

本基金跟踪的巨潮 100 指数聚焦大盘板块，成长价值均衡配置。中短期而言，在外部流动性扰动加剧、市场风格偏向盈利确定性的环境下，巨潮 100 凭借其大盘核心资产属性和较高的股息率，具备较强的抗风险能力与配置价值；长期而言，随着“十五五”规划持续发力及经济逐渐改善，巨潮 100 板块与经济基本面深度关联，长期配置价值高，或将持续受益于长线价值型资金的配置需求。

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

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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：融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)

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	24,714,589.88	27,225,982.33
结算备付金		393,066.49	165,119.85
存出保证金		20,466.93	21,330.64
交易性金融资产	6.4.7.2	416,637,485.95	444,953,390.53
其中：股票投资		416,637,485.95	444,953,390.53
基金投资		-	-

债券投资		-	-
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		94,792.10	122,144.35
应收股利		-	-
应收申购款		67,730.91	25,157.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		441,928,132.26	472,513,125.02
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		781,581.88	1,380,321.41
应付管理人报酬		429,551.18	480,790.36
应付托管费		71,591.86	80,131.74
应付销售服务费		1,102.31	1,083.91
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	132,877.73	187,174.55
负债合计		1,416,704.96	2,129,501.97
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	354,549,669.28	397,648,077.29
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	85,961,758.02	72,735,545.76
净资产合计		440,511,427.30	470,383,623.05
负债和净资产总计		441,928,132.26	472,513,125.02

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，融通巨潮 100 指数（LOF）A/B 类基金份额净值 1.244 元，

基金份额总额 351,488,694.79 份；融通巨潮 100 指数（LOF）C 类基金份额净值 1.077 元，基金份额 3,060,974.49 份；总份额合计 354,549,669.28 份。

6.2 利润表

会计主体：融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)

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		24,559,845.03	12,642,335.42
1.利息收入		44,291.24	47,297.91
其中：存款利息收入	6.4.7.13	44,291.24	47,297.91
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）		28,404,083.55	13,137,118.35
其中：股票投资收益	6.4.7.14	23,397,225.75	5,935,997.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
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	5,006,857.80	7,201,120.80
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	-3,898,746.96	-560,599.50
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	10,217.20	18,518.66
减：二、营业总支出		3,162,310.69	3,386,783.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,630,063.52	2,821,796.16
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	438,343.89	470,299.37

3．销售服务费	6.4.10.2.3	6,423.00	7,195.31
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	87,480.28	87,492.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,397,534.34	9,255,552.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,397,534.34	9,255,552.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		21,397,534.34	9,255,552.30

6.3 净资产变动表

会计主体：融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)

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	397,648,077.29	-	72,735,545.76	470,383,623.05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	397,648,077.29	-	72,735,545.76	470,383,623.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-43,098,408.01	-	13,226,212.26	-29,872,195.75
（一）、综合收益总额	-	-	21,397,534.34	21,397,534.34
（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）	-43,098,408.01	-	-8,171,322.08	-51,269,730.09
其中：1.基金申购款	6,987,006.63	-	982,932.36	7,969,938.99
2.基金赎回款	-50,085,414.64	-	-9,154,254.44	-59,239,669.08
（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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转	-	-	-	-

留存收益				
四、本期期末净资产	354,549,669.28	-	85,961,758.02	440,511,427.30

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	490,617,961.45	-	-2,171,229.18	488,446,732.27
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	490,617,961.45	-	-2,171,229.18	488,446,732.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17,069,349.16	-	9,501,065.31	-7,568,283.85
（一）、综合收益总额	-	-	9,255,552.30	9,255,552.30
（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）	-17,069,349.16	-	245,513.01	-16,823,836.15
其中：1.基金申购款	8,606,261.52	-	-221,979.76	8,384,281.76
2.基金赎回款	-25,675,610.68	-	467,492.77	-25,208,117.91
（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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	473,548,612.29	-	7,329,836.13	480,878,448.42

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

融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)(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”)证监基金字[2005]第 18 号《关于同意融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)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《融通巨潮 100 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，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 513,273,618.60 元，认购资金产生的利息折

份额为 253,579.83 份基金份额，基金合同生效日基金份额总额为 513,527,198.43 份，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(2005)第 65 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《融通巨潮 100 指数证券投资基金基金合同》于 2005 年 5 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 513,527,198.43 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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2005]第 56 号文审核同意，本基金 188,512,868.00 份基金份额于 2005 年 6 月 16 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

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巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)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 类基金份额；在投资者赎回时收取后端申购费用的份额，称为 B 类基金份额；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 类基金份额。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《融通巨潮 100 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金为增强型指数基金，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票(含存托凭证)、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票投资部分主要投资于目标指数的成份股票，包括巨潮 100 指数的成份股和预期将要被选入巨潮 100 指数的股票，本基金还可适当投资一级市场的股票(包括新股与增发)。非成份股的投资比例控制在基金资产净值的 10%以内，但成份股更换期因指数成份股调整而进行的非成份股投资不在此比例限制范围之内。为控制基金偏离目标指数的风险，本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制在 0.5%以内。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。本基金投资于股票的资产比例范围为基金资产净值的 90%-95%，保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的资产比例合计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：巨潮 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

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于本报告截止日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。

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 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	24,714,589.88
等于：本金	24,712,410.45
加：应计利息	2,179.43
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	24,714,589.88

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		342,299,202.11	-	416,637,485.95	74,338,283.84
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		342,299,202.11	-	416,637,485.95	74,338,283.84

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	66.77
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	49,959.68
其中：交易所市场	49,959.68
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	82,851.28
合计	132,877.73

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通巨潮 100 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	394,578,071.74	394,578,071.74
本期申购	5,130,002.04	5,130,002.04
本期赎回（以“-”号填列）	-48,219,378.99	-48,219,378.99
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	351,488,694.79	351,488,694.79

融通巨潮 100 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	3,070,005.55	3,070,005.55
本期申购	1,857,004.59	1,857,004.59
本期赎回（以“-”号填列）	-1,866,035.65	-1,866,035.65
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	3,060,974.49	3,060,974.49

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

融通巨潮 100 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	-6,343,932.82	78,994,862.54	72,650,929.72
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-6,343,932.82	78,994,862.54	72,650,929.72
本期利润	25,118,384.84	-3,870,971.84	21,247,413.00
本期基金份额交易产生的变动数	-332,559.75	-7,840,213.22	-8,172,772.97
其中：基金申购款	36,928.58	899,673.45	936,602.03
基金赎回款	-369,488.33	-8,739,886.67	-9,109,375.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,441,892.27	67,283,677.48	85,725,569.75

融通巨潮 100 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	-88,134.76	172,750.80	84,616.04
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-88,134.76	172,750.80	84,616.04
本期利润	177,896.46	-27,775.12	150,121.34
本期基金份额交易产生的变动数	-2,381.65	3,832.54	1,450.89
其中：基金申购款	-16,915.97	63,246.30	46,330.33
基金赎回款	14,534.32	-59,413.76	-44,879.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	87,380.05	148,808.22	236,188.27

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	43,901.49
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	355.40
其他	34.35
合计	44,291.24

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	23,397,225.75
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	23,397,225.75

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	233,234,107.80
减：卖出股票成本总额	209,616,187.69
减：交易费用	220,694.36
买卖股票差价收入	23,397,225.75

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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	5,006,857.80
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	5,006,857.80

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	-3,898,746.96
股票投资	-3,898,746.96
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	-3,898,746.96

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	9,932.08
基金转换费收入	285.12
合计	10,217.20

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	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	129.00
账户维护费	9,000.00
合计	87,480.28

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、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	251,035,045.00	60.30	230,255,545.45	87.79

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	46,667.67	60.31	27,613.63	55.27
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	42,802.53	87.79	30,241.23	84.24

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	2,630,063.52	2,821,796.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,257,019.24	1,257,320.47
应支付基金管理人的净管理费	1,373,044.28	1,564,475.69

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 1.20%年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.20%/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	438,343.89	470,299.37

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×0.20%/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		
	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C	合计
融通基金	-	82.96	82.96
中国工商银行	-	1,751.00	1,751.00
合计	-	1,833.96	1,833.96
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		
	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C	合计
融通基金	-	358.30	358.30
中国工商银行	-	1,573.17	1,573.17
合计	-	1,931.47	1,931.47

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×0.40%/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	24,714,589.88	43,901.49	28,551,492.36	47,082.83

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

无。

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	57	1,596.00	1,583.46	-
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	184	9,799.84	10,808.16	-
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	5,449	55,089.39	55,089.39	-
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	12,717	128,568.87	128,568.87	-
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	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
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	454	12,344.26	14,214.74	-
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	315	9,569.70	12,281.85	-
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	2,336	23,640.32	64,777.28	-
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	138	3,679.08	7,032.48	-
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	290	3,857.00	14,952.40	-
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	433	6,023.03	14,059.51	-
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	636	29,306.88	294,677.88	-
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	546	3,865.68	15,506.40	-
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	117	6,786.00	13,122.72	-

301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	69.66	160.06	381	26,540.46	60,982.86	-
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	96	7,524.48	11,689.92	-
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	195	4,276.35	15,167.10	-
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	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	11.18	17.59	416	4,650.88	7,317.44	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	17.70	84.32	286	5,062.20	24,115.52	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	6 个月以上	首发流通受限	29.06	48.56	4,543	132,019.58	220,608.08	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月以上	首发流通受限	22.68	42.16	3,756	85,186.08	158,352.96	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	6 个月以上	首发流通受限	83.06	126.45	1,333	110,718.98	168,557.85	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	6 个月以上	首发流通受限	114.28	676.94	1,673	191,190.44	1,132,520.62	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	44.56	468.67	170	7,575.20	79,673.90	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	6 个月以上	首发流通受限	104.66	768.89	1,232	128,941.12	947,272.48	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	81.88	1,584.33	107	8,761.16	169,523.31	-
688811	有研复材	2026 年 4	1-6 个月	首发流	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

		月 1 日	（含）	通受限						
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	9.47	70.14	1,267	11,998.49	88,867.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	19.68	141.49	612	12,044.16	86,591.88	-

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的各类重大风险，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，本基金无债券投资（2025 年 12 月 31 日：同）。

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	24,714,589.88	-	-	-	24,714,589.88
结算备付金	393,066.49	-	-	-	393,066.49
存出保证金	20,466.93	-	-	-	20,466.93

交易性金融资产	-	-	-	416,637,485.95	416,637,485.95
应收申购款	-	-	-	67,730.91	67,730.91
应收清算款	-	-	-	94,792.10	94,792.10
资产总计	25,128,123.30	-	-	416,800,008.96	441,928,132.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	781,581.88	781,581.88
应付管理人报酬	-	-	-	429,551.18	429,551.18
应付托管费	-	-	-	71,591.86	71,591.86
应付销售服务费	-	-	-	1,102.31	1,102.31
其他负债	-	-	-	132,877.73	132,877.73
负债总计	-	-	-	1,416,704.96	1,416,704.96
利率敏感度缺口	25,128,123.30	-	-	415,383,304.00	440,511,427.30
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	27,225,982.33	-	-	-	27,225,982.33
结算备付金	165,119.85	-	-	-	165,119.85
存出保证金	21,330.64	-	-	-	21,330.64
交易性金融资产	-	-	-	444,953,390.53	444,953,390.53
应收申购款	-	-	-	25,157.32	25,157.32
应收清算款	-	-	-	122,144.35	122,144.35
资产总计	27,412,432.82	-	-	445,100,692.20	472,513,125.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,380,321.41	1,380,321.41
应付管理人报酬	-	-	-	480,790.36	480,790.36
应付托管费	-	-	-	80,131.74	80,131.74
应付销售服务费	-	-	-	1,083.91	1,083.91
其他负债	-	-	-	187,174.55	187,174.55
负债总计	-	-	-	2,129,501.97	2,129,501.97
利率敏感度缺口	27,412,432.82	-	-	442,971,190.23	470,383,623.05

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，本基金未持有交易性债券投资(2025 年 12 月 31 日：同)，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。本基金持有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。

本基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。金融工程小组负责对基金组合的跟踪误差和偏离风险进行评估，定期提交组合跟踪误差归因分析报告和风险监控报告。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。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。本基金投资于股票的资产比例范围为基金资产净值的 90%-95%；保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的资产比例合计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。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	416,637,485.95	94.58	444,953,390.53	94.59
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	416,637,485.95	94.58	444,953,390.53	94.59

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除巨潮 100 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.巨潮 100 指数收益率上升 5%	20,658,207.11	22,273,130.95
	2.巨潮 100 指数收益率下降 5%	-20,658,207.11	-22,273,130.95

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	412,523,041.39	441,561,721.71
第二层次	183,658.26	811,743.00
第三层次	3,930,786.30	2,579,925.82
合计	416,637,485.95	444,953,390.53

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	416,637,485.95	94.28
	其中：股票	416,637,485.95	94.28
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	25,107,656.37	5.68
8	其他各项资产	182,989.94	0.04
9	合计	441,928,132.26	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	2,350,068.36	0.53
B	采矿业	19,385,090.20	4.40
C	制造业	246,548,418.05	55.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,179,368.00	2.08
E	建筑业	2,375,542.40	0.54
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,305,555.98	1.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,685,601.15	3.79

J	金融业	88,996,127.73	20.20
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	688,562.20	0.16
M	科学研究和技术服务业	7,043,779.72	1.60
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	399,558,113.79	90.70

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	228,166.40	0.05
B	采矿业	1,028,129.82	0.23
C	制造业	11,620,282.22	2.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,207,101.26	0.50
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	837,760.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	514,543.46	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	172,952.00	0.04
J	金融业	470,437.00	0.11
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	17,079,372.16	3.88

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	20,600	26,162,000.00	5.94
2	300750	宁德时代	61,765	24,274,262.65	5.51
3	300502	新易盛	30,080	18,258,560.00	4.14
4	600519	贵州茅台	12,924	15,321,272.76	3.48
5	601318	中国平安	259,500	12,388,530.00	2.81
6	688256	寒武纪	7,307	11,658,683.85	2.65
7	600036	招商银行	313,033	11,112,671.50	2.52
8	603986	兆易创新	13,600	11,084,000.00	2.52
9	601899	紫金矿业	370,730	9,320,152.20	2.12
10	002371	北方华创	9,450	8,359,092.00	1.90
11	000333	美的集团	109,971	8,306,109.63	1.89
12	688041	海光信息	21,808	8,075,502.40	1.83
13	002475	立讯精密	112,629	7,929,081.60	1.80
14	688012	中微公司	15,520	7,271,120.00	1.65
15	600900	长江电力	270,900	7,170,723.00	1.63
16	002384	东山精密	27,300	7,162,155.00	1.63
17	600030	中信证券	248,685	7,144,720.05	1.62
18	603259	药明康德	56,572	7,043,779.72	1.60
19	688981	中芯国际	43,869	6,967,274.58	1.58
20	688008	澜起科技	22,327	6,919,137.30	1.57
21	000725	京东方 A	788,900	6,847,652.00	1.55
22	300059	东方财富	305,245	6,220,893.10	1.41
23	601166	兴业银行	373,147	6,179,314.32	1.40
24	601288	农业银行	949,800	5,765,286.00	1.31
25	601328	交通银行	868,200	5,582,526.00	1.27
26	300274	阳光电源	34,940	5,556,158.80	1.26
27	601138	工业富联	76,400	5,512,260.00	1.25
28	300476	胜宏科技	14,500	5,023,235.00	1.14
29	002594	比亚迪	56,300	4,487,110.00	1.02
30	600276	恒瑞医药	86,000	4,475,440.00	1.02
31	000651	格力电器	119,175	4,469,062.50	1.01
32	601211	国泰海通	230,300	4,191,460.00	0.95
33	300394	天孚通信	12,580	3,807,714.40	0.86
34	600309	万华化学	52,609	3,598,981.69	0.82
35	002415	海康威视	103,493	3,539,460.60	0.80
36	601688	华泰证券	161,927	3,338,934.74	0.76
37	600919	江苏银行	305,600	3,294,368.00	0.75
38	300124	汇川技术	49,400	3,276,702.00	0.74
39	600150	中国船舶	89,700	3,030,963.00	0.69
40	600887	伊利股份	121,362	2,907,833.52	0.66
41	000858	五粮液	38,365	2,839,010.00	0.64
42	000063	中兴通讯	77,800	2,815,582.00	0.64
43	603993	洛阳钼业	156,000	2,737,800.00	0.62

44	002142	宁波银行	86,775	2,576,349.75	0.58
45	601658	邮储银行	509,300	2,510,849.00	0.57
46	601668	中国建筑	547,360	2,375,542.40	0.54
47	002714	牧原股份	67,164	2,350,068.36	0.53
48	601988	中国银行	402,600	2,302,872.00	0.52
49	601857	中国石油	252,400	2,190,832.00	0.50
50	000001	平安银行	217,200	2,182,860.00	0.50
51	600690	海尔智家	106,328	2,170,154.48	0.49
52	600000	浦发银行	251,900	2,168,859.00	0.49
53	601816	京沪高铁	464,300	2,103,279.00	0.48
54	601088	中国神华	53,800	2,100,352.00	0.48
55	300760	迈瑞医疗	15,354	2,085,533.82	0.47
56	600031	三一重工	119,700	2,068,416.00	0.47
57	603501	豪威集团	21,610	2,049,708.50	0.47
58	601919	中远海控	148,900	1,974,414.00	0.45
59	002916	深南电路	4,300	1,968,970.00	0.45
60	600999	招商证券	85,513	1,804,324.30	0.41
61	601939	建设银行	185,900	1,790,217.00	0.41
62	601601	中国太保	62,096	1,770,977.92	0.40
63	600016	民生银行	516,300	1,662,486.00	0.38
64	002050	三花智控	37,800	1,656,774.00	0.38
65	000792	盐湖股份	53,800	1,624,222.00	0.37
66	600028	中国石化	360,400	1,607,384.00	0.36
67	600406	国电南瑞	68,060	1,555,171.00	0.35
68	000568	泸州老窖	20,022	1,552,105.44	0.35
69	601012	隆基绿能	117,308	1,539,080.96	0.35
70	601600	中国铝业	178,600	1,468,092.00	0.33
71	600050	中国联通	366,600	1,466,400.00	0.33
72	002352	顺丰控股	46,023	1,438,678.98	0.33
73	601225	陕西煤业	70,200	1,428,570.00	0.32
74	601728	中国电信	271,200	1,407,528.00	0.32
75	601766	中国中车	260,675	1,355,510.00	0.31
76	600104	上汽集团	136,500	1,332,240.00	0.30
77	600019	宝钢股份	223,800	1,215,234.00	0.28
78	300033	同花顺	4,940	1,190,540.00	0.27
79	601818	光大银行	384,900	1,112,361.00	0.25
80	601985	中国核电	121,100	1,093,533.00	0.25
81	600346	恒力石化	58,600	1,037,806.00	0.24
82	601998	中信银行	134,200	930,006.00	0.21
83	600989	宝丰能源	42,700	868,091.00	0.20
84	601127	赛力斯	13,700	839,125.00	0.19
85	601628	中国人寿	23,523	831,538.05	0.19
86	600760	中航沈飞	19,500	801,450.00	0.18

87	601633	长城汽车	52,900	798,261.00	0.18
88	600018	上港集团	167,200	789,184.00	0.18
89	600809	山西汾酒	7,186	785,932.82	0.18
90	601888	中国中免	12,820	688,562.20	0.16
91	688111	金山办公	2,806	597,818.30	0.14
92	603288	海天味业	17,560	582,289.60	0.13
93	601319	中国人保	77,600	524,576.00	0.12
94	003816	中国广核	121,800	476,238.00	0.11
95	601066	中信建投	14,400	418,608.00	0.10
96	300999	金龙鱼	12,800	297,728.00	0.07
97	600025	华能水电	27,100	240,919.00	0.05
98	600930	华电新能	41,500	197,955.00	0.04
99	302132	中航成飞	3,000	174,960.00	0.04

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	688795	摩尔线程	1,673	1,132,520.62	0.26
2	600027	华电国际	224,200	997,690.00	0.23
3	688802	沐曦股份	1,232	947,272.48	0.22
4	001309	德明利	900	848,610.00	0.19
5	601607	上海医药	54,400	837,760.00	0.19
6	603659	璞泰来	25,000	723,250.00	0.16
7	601877	正泰电器	21,300	533,991.00	0.12
8	002128	电投能源	22,200	513,264.00	0.12
9	001965	招商公路	56,000	512,960.00	0.12
10	600011	华能国际	60,000	455,400.00	0.10
11	600584	长电科技	4,200	434,910.00	0.10
12	600460	士兰微	7,900	431,814.00	0.10
13	600522	中天科技	6,700	406,556.00	0.09
14	002202	金风科技	16,900	403,910.00	0.09
15	600905	三峡能源	105,900	392,889.00	0.09
16	002241	歌尔股份	16,800	378,504.00	0.09
17	002304	洋河股份	9,000	343,350.00	0.08
18	603083	剑桥科技	1,300	331,331.00	0.08
19	600600	青岛啤酒	6,100	318,603.00	0.07
20	600498	烽火通信	4,300	316,480.00	0.07
21	600580	卧龙电驱	9,300	307,830.00	0.07
22	301666	大普微	636	294,677.88	0.07
23	601699	潞安环能	18,000	257,040.00	0.06
24	601009	南京银行	23,900	236,371.00	0.05
25	300628	亿联网络	6,900	233,358.00	0.05
26	300498	温氏股份	18,520	228,166.40	0.05
27	300136	信维通信	1,900	226,575.00	0.05

28	601898	中煤能源	18,200	221,676.00	0.05
29	688765	禾元生物	4,543	220,608.08	0.05
30	002156	通富微电	2,800	212,436.00	0.05
31	002484	江海股份	1,900	199,500.00	0.05
32	001248	华润新能源	18,166	183,658.26	0.04
33	600845	宝信软件	10,400	172,952.00	0.04
34	688808	联讯仪器	107	169,523.31	0.04
35	688790	昂瑞微	1,333	168,557.85	0.04
36	000157	中联重科	23,600	164,492.00	0.04
37	688781	视涯科技	3,756	158,352.96	0.04
38	002938	鹏鼎控股	1,500	158,070.00	0.04
39	601995	中金公司	4,000	144,600.00	0.03
40	300373	扬杰科技	900	141,507.00	0.03
41	002056	横店东磁	4,400	134,112.00	0.03
42	002074	国轩高科	4,300	118,293.00	0.03
43	600642	申能股份	12,400	108,252.00	0.02
44	600183	生益科技	600	104,040.00	0.02
45	600219	南山铝业	23,400	93,366.00	0.02
46	300014	亿纬锂能	1,400	91,042.00	0.02
47	601788	光大证券	6,200	89,466.00	0.02
48	688818	电科蓝天	1,267	88,867.38	0.02
49	688820	盛合晶微	612	86,591.88	0.02
50	688797	臻宝科技	170	79,673.90	0.02
51	603296	华勤技术	960	71,299.20	0.02
52	600886	国投电力	5,200	69,212.00	0.02
53	001399	惠科股份	2,336	64,777.28	0.01
54	301682	宏明电子	381	60,982.86	0.01
55	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
56	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
57	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
58	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
59	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
60	603459	红板科技	286	24,115.52	0.01
61	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
62	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
63	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
64	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
65	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
66	001365	天海电子	454	14,214.74	0.00
67	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
68	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
69	001393	维通利	315	12,281.85	0.00
70	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00

71	001237	惠康科技	184	10,808.16	0.00
72	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
73	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
74	601112	振石股份	416	7,317.44	0.00
75	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
76	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
77	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
78	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
79	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
80	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
81	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	603986	兆易创新	7,346,804.00	1.56
2	002384	东山精密	7,108,739.00	1.51
3	688008	澜起科技	5,674,673.17	1.21
4	688012	中微公司	5,070,194.25	1.08
5	300394	天孚通信	4,092,633.80	0.87
6	688256	寒武纪	4,033,728.16	0.86
7	300750	宁德时代	3,607,984.00	0.77
8	601600	中国铝业	2,764,954.00	0.59
9	601328	交通银行	2,359,831.00	0.50
10	601211	国泰海通	2,003,273.00	0.43
11	002916	深南电路	1,901,307.00	0.40
12	300033	同花顺	1,877,475.20	0.40
13	601108	财通证券	1,801,499.00	0.38
14	600030	中信证券	1,784,021.00	0.38
15	300999	金龙鱼	1,770,247.00	0.38
16	600998	九州通	1,751,391.00	0.37
17	603501	豪威集团	1,738,491.00	0.37
18	601919	中远海控	1,736,695.00	0.37
19	601633	长城汽车	1,704,063.00	0.36
20	000792	盐湖股份	1,692,215.00	0.36

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	9,477,693.00	2.01

2	688256	寒武纪	5,577,935.82	1.19
3	300308	中际旭创	5,423,572.00	1.15
4	600519	贵州茅台	4,948,682.00	1.05
5	300502	新易盛	4,049,061.00	0.86
6	601318	中国平安	3,557,573.00	0.76
7	601211	国泰海通	3,097,208.00	0.66
8	601390	中国中铁	2,812,697.00	0.60
9	601939	建设银行	2,809,069.00	0.60
10	000333	美的集团	2,785,624.00	0.59
11	601288	农业银行	2,648,737.00	0.56
12	601108	财通证券	2,614,892.00	0.56
13	601006	大秦铁路	2,575,109.00	0.55
14	002230	科大讯飞	2,574,392.00	0.55
15	600036	招商银行	2,563,679.00	0.55
16	600998	九州通	2,550,584.00	0.54
17	300498	温氏股份	2,485,959.00	0.53
18	300033	同花顺	2,362,524.00	0.50
19	601899	紫金矿业	2,327,924.00	0.49
20	600900	长江电力	2,297,884.00	0.49

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	185,199,030.07
卖出股票收入（成交）总额	233,234,107.80

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

无。

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

无。

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

1．本基金投资的前十名证券中的招商银行，其发行主体为招商银行股份有限公司。根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，受到金融监管总局的处罚。

投资决策说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	20,466.93
2	应收清算款	94,792.10
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	67,730.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	182,989.94

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	688795	摩尔线程	1,132,520.62	0.26	首发流通受限
2	688802	沐曦股份	947,272.48	0.22	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（%）
融通巨潮 100 指数 A/B	23,651	14,861.47	237,674.56	0.07	351,251,020.23	99.93
融通巨潮 100 指数 C	506	6,049.36	-	-	3,060,974.49	100.00
合计	24,157	14,676.89	237,674.56	0.07	354,311,994.72	99.93

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	融通巨潮 100 指数 A/B	30,644.23	0.00872
	融通巨潮 100 指数 C	128,231.87	4.18925
	合计	158,876.10	0.04481

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	融通巨潮 100 指数 A/B	0
	融通巨潮 100 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通巨潮 100 指数 A/B	0~10
	融通巨潮 100 指数 C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C

基金合同生效日（2005 年 5 月 12 日）基金份额总额	513,527,198.43	-
本报告期期初基金份额总额	394,578,071.74	3,070,005.55
本报告期基金总申购份额	5,130,002.04	1,857,004.59
减：本报告期基金总赎回份额	48,219,378.99	1,866,035.65
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	351,488,694.79	3,060,974.49

§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	251,035,045.00	60.30	46,667.67	60.31	-
国泰海通证券	1	165,241,008.69	39.70	30,714.51	39.69	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	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	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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
3	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
4	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
5	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
6	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
7	融通基金关于旗下部分开放式基金参加中国人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	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 15 日
8	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巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)设立的文件

（二）《融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》

（三）《融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)托管协议》

（四）《融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)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