融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

2026年第3季度报告

2026年9月30日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	348,211,596.43 份	
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	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	融通巨潮 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	345,422,959.23 份	2,788,637.20 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C
1.本期已实现收益	7,691,826.95	51,547.26
2.本期利润	-40,552,392.46	-291,446.32
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1165	-0.1035
4.期末基金资产净值	389,452,650.37	2,719,937.42
5.期末基金份额净值	1.127	0.975

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通巨潮 100 指数 A/B

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-9.41%	1.21%	-10.97%	1.19%	1.56%	0.02%
过去六个月	0.62%	1.17%	-2.29%	1.16%	2.91%	0.01%
过去一年	-3.59%	1.01%	-8.00%	1.01%	4.41%	0.00%
过去三年	26.49%	1.03%	13.47%	1.04%	13.02%	-0.01%
过去五年	-1.12%	1.06%	-11.18%	1.05%	10.06%	0.01%
过去七年	39.68%	1.15%	9.02%	1.11%	30.66%	0.04%
过去十年	91.19%	1.14%	42.13%	1.10%	49.06%	0.04%
自基金合同	525.98%	1.52%	400.34%	1.49%	125.64%	0.03%

生效起至今						

融通巨潮 100 指数 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-9.47%	1.20%	-10.97%	1.19%	1.50%	0.01%
过去六个月	0.41%	1.16%	-2.29%	1.16%	2.70%	0.00%
过去一年	-3.94%	1.01%	-8.00%	1.01%	4.06%	0.00%
过去三年	25.00%	1.03%	13.47%	1.04%	11.53%	-0.01%
过去五年	-3.10%	1.06%	-11.18%	1.05%	8.08%	0.01%
过去七年	35.71%	1.15%	9.02%	1.11%	26.69%	0.04%
自基金合同生效起至今	59.98%	1.17%	22.93%	1.13%	37.05%	0.04%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：本基金于 2017 年 7 月 5 日增加 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡志伟	本基金的基金经理	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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

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。本基金运用指数化投资方式，采取量化策略进行指数增强和风险管理，在控制基金相对巨潮 100 指数基金基准的跟踪误差下，力求最终为投资者带来超越基金基准的收益。

回顾 2026 年三季度，巨潮 100 下跌 11.54%，沪深 300 下跌 5.78%，中证 500 下跌 17.67%，中证 1000 下跌 17.15%，创业板指下跌 27.8%，总体呈现中大盘价值占优的行情，市场日均成交额约 2.26 万亿，相较上个季度持续缩量，两融余额高位明显回落，其占流通市值的比例亦同步回落，近 60 个交易日新成立偏股基金份额约 800 亿，同样出现明显回落，总体而言，市场情绪明显走低。

在指数增强方面，本基金持续基于多因子多策略的量化选股增强模型进行投资管理，不同的风格域构建不同的 Alpha 策略，最后将多策略整合为最终的综合策略。2026 年三季度，首先，持续基于 Level-2 数据构建各类不同的特征，通过深度学习模型挖掘增量 Alpha 因子；同时，尝试通过自下而上的方式去构建风格轮动模型，尽量获取部分风格轮动带来的 beta 收益。风险管理方面，2026 年三季度持续基于现有的较为成熟的风险控制框架进行投资管理，研究通过模型去识别哪些板块或行业在现有 Alpha 模型框架下，历史上只能获取较为稳定的负 Alpha，对此类板块或行业采取更为严格的风险控制约束。

总体而言，截止至 2026 年三季度末，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升后降，在成长上暴露先降后升。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。

4.5 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 1.127 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.41%，同期业绩比较基准收益率为-10.97%；

截至本报告期末融通巨潮 100 指数 C 基金份额净值为 0.975 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.47%，同期业绩比较基准收益率为-10.97%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	370,312,470.54	93.68
	其中：股票	370,312,470.54	93.68
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	23,183,646.98	5.87
8	其他资产	1,789,700.14	0.45
9	合计	395,285,817.66	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,430,856.80	0.62
B	采矿业	22,856,129.70	5.83
C	制造业	192,661,329.79	49.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,976,966.00	2.54
E	建筑业	1,793,114.40	0.46
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,994,410.41	1.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,166,599.67	3.36
J	金融业	92,639,199.00	23.62
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	695,468.80	0.18
M	科学研究和技术服务业	8,379,048.48	2.14
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	350,593,123.05	89.40

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	589,482.75	0.15
C	制造业	13,423,500.96	3.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,689,458.78	0.43
E	建筑业	245,944.00	0.06
F	批发和零售业	908,320.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	1,282,276.00	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	229,642.00	0.06
J	金融业	1,089,592.00	0.28
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	86,792.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	174,339.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	19,719,347.49	5.03

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	63,165	18,387,963.15	4.69
2	300308	中际旭创	20,100	16,249,644.00	4.14
3	600519	贵州茅台	12,824	16,140,542.88	4.12
4	601318	中国平安	256,900	13,690,201.00	3.49
5	600036	招商银行	300,933	12,416,495.58	3.17

6	300502	新易盛	30,780	11,973,420.00	3.05
7	601899	紫金矿业	351,130	10,460,162.70	2.67
8	000333	美的集团	109,371	8,760,617.10	2.23
9	603259	药明康德	50,072	8,379,048.48	2.14
10	600900	长江电力	261,600	7,466,064.00	1.90

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688825	长鑫科技	55,198	2,133,402.70	0.54
2	688396	华润微	23,700	1,305,870.00	0.33
3	688249	晶合集成	32,600	1,069,606.00	0.27
4	601877	正泰电器	40,600	1,012,970.00	0.26
5	601607	上海医药	56,000	908,320.00	0.23

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

无。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	14,751.63
2	应收证券清算款	1,757,509.11
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,439.40
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,789,700.14

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明

1	688825	长鑫科技	2,133,402.70	0.54	首发流通受限

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C
报告期期初基金份额总额	351,488,694.79	3,060,974.49
报告期期间基金总申购份额	1,909,479.59	206,653.77
减:报告期期间基金总赎回份额	7,975,215.15	478,991.06
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	345,422,959.23	2,788,637.20

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准融通巨潮 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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2026 年 10 月 26 日