融通中证诚通央企科技创新交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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：国泰海通证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰海通证券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

2.1 基金基本情况

基金简称	融通中证诚通央企科技创新 ETF 发起式联接
基金主代码	023655
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 4 月 29 日
报告期末基金份额总额	18,947,355.89 份
投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争将基金资产净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 本基金投资策略主要包括资产配置策略、目标 ETF 投资策略、成份股及备选成份股投资策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、股指期货交易策略、国债期货交易策略、股票期权投资策略、融资和转融通证券出借业务投资策略等部分。
业绩比较基准	中证诚通央企科技创新指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。同时，本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证诚通央企科技创新指数，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	融通中证诚通央企科技创新 ETF 发起式联接 A	融通中证诚通央企科技创新 ETF 发起式联接 C
下属分级基金的交易代码	023655	023656
报告期末下属分级基金的份额总额	13,974,826.48 份	4,972,529.41 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	融通中证诚通央企科技创新交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159335
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 8 月 22 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 9 月 5 日
基金管理人名称	融通基金管理有限公司
基金托管人名称	国泰海通证券股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，主要采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来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。本基金投资策略主要包含股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、股指期货交易策略、国债期货交易策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略等部分。
业绩比较基准	中证诚通央企科技创新指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，紧密跟踪中证诚通央企科技创新指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

§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）

	融通中证诚通央企科技创新 ETF 发起式联接 A	融通中证诚通央企科技创新 ETF 发起式联接 C
1.本期已实现收益	261,419.65	51,073.24
2.本期利润	-2,413,473.99	-577,576.38
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1745	-0.1568
4.期末基金资产净值	16,595,629.83	5,879,658.50
5.期末基金份额净值	1.1875	1.1824

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

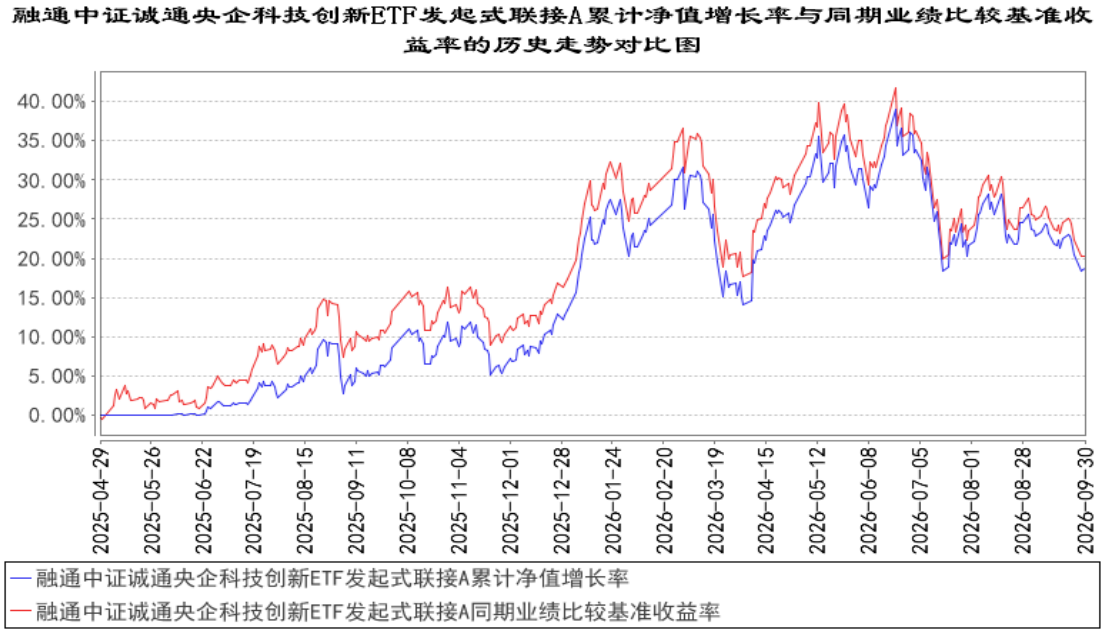
融通中证诚通央企科技创新 ETF 发起式联接 A

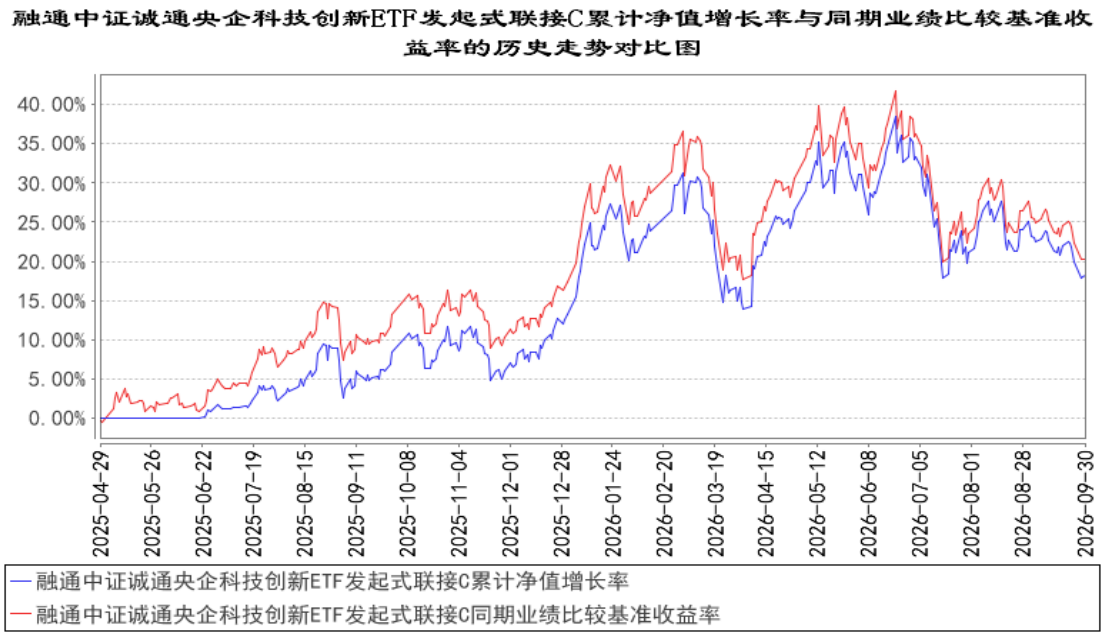
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-12.77%	1.33%	-13.05%	1.37%	0.28%	-0.04%
过去六个月	2.94%	1.43%	1.16%	1.48%	1.78%	-0.05%
过去一年	9.35%	1.36%	6.33%	1.40%	3.02%	-0.04%
自基金合同生效起至今	18.75%	1.19%	20.34%	1.26%	-1.59%	-0.07%

融通中证诚通央企科技创新 ETF 发起式联接 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	-12.83%	1.33%	-13.05%	1.37%	0.22%	-0.04%
过去六个月	2.79%	1.43%	1.16%	1.48%	1.63%	-0.05%
过去一年	9.03%	1.36%	6.33%	1.40%	2.70%	-0.04%
自基金合同生效起至今	18.24%	1.19%	20.34%	1.26%	-2.10%	-0.07%

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：本基金的建仓期为自合同生效日起 6 个月，至建仓期结束，各项资产配置比例符合合同约定。

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		
何天翔	本基金的	2025 年 4 月 29	-	18 年	何天翔先生，厦门大学经济学硕士，18

	基金经理、指数与量化投资部总经理	日			年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2008 年 7 月至 2010 年 3 月就职于华泰联合证券有限责任公司任金融工程分析师。2010 年 3 月加入融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、专户投资经理、指数与量化投资部总监、融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理、融通中证军工指数分级证券投资基金基金经理、融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通通瑞债券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，现任指数与量化投资部总经理、融通深证 100 指数证券投资基金基金经理、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通中证人工智能主题指数证券投资基金(LOF)基金经理、融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通中证诚通央企科技创新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、融通中证诚通央企科技创新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、融通上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。
吕寒	本基金的基金经理、指数与量化投资部副总经理	2025 年 4 月 29 日	-	8 年	吕寒先生，经济学博士，8 年证券基金行业从业经历，具有基金从业资格。2018 年 7 月至 2020 年 3 月就职于金鹰基金管理有限公司担任指数及量化投资部研究员。2020 年 3 月加入融通基金管理有限公司，曾任指数与量化投资部量化研究员。现任指数与量化投资部副总经理、融通创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通创业板指数增强型证券投资基金基金经理、融通中证诚通央企科技创新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 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、融通中证诚通央企科技创新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 ESG 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

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

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

随着“十五五”开局之年政策部署密集落地，国资国企改革迈入新一轮全面深化的关键阶段。三季度以来，系列重要会议与政策文件相继出台，围绕价值创造、创新引领、产业升级、改革赋能等方向系统谋划。国资央企依托持续的战略赋能与跨体系协同的资源配置硬实力，叠加在战略性新兴产业和未来产业领域的技术攻坚先发优势，已超越传统功能定位，形成多重战略角色的深度融合——既是托底宏观经济大盘、保障产业链自主安全可控的“战略基石”，更是驱动产业体系整体跃升、加速形成新质生产力的“核心引擎”。

中证诚通央企科技创新指数由中国诚通集团定制，从国务院国资委下属央企上市公司中选取业务涉及半导体、电子、电力设备、非金属材料、机械制造等行业的 50 只上市公司证券作为指数样本，以反映该类上市公司证券的整体表现。前五大权重行业分别为电子、国防军工、通信、电

力设备及新能源、有色金属。

在严控投资风险的前提下，将追求持有人“长期利益最大化”作为核心管理思想，并将这一原则深度贯穿于基金投研决策、组合构建、日常运作及风险管控的全流程，在投研执行层面，本基金严格采用指数化投资策略，在保障组合流动性的同时，通过最大限度降低跟踪误差，确保基金净值表现与标的指数走势的高度一致性。本基金运用指数化投资策略，主要仓位买入融通中证诚通央企科技创新 ETF，为投资者提供投资中证诚通央企科技创新指数的场外基金工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通中证诚通央企科技创新 ETF 发起式联接 A 基金份额净值为 1.1875 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.77%，同期业绩比较基准收益率为-13.05%；

截至本报告期末融通中证诚通央企科技创新 ETF 发起式联接 C 基金份额净值为 1.1824 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.83%，同期业绩比较基准收益率为-13.05%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	20,780,543.47	92.11
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,662,314.41	7.37
8	其他资产	117,455.86	0.52
9	合计	22,560,313.74	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	融通中证诚通央企	股票型	交易型开放式	融通基金管理有限	20,780,543.47	92.46

	科技创新交易型开放式指数证券投资基金			公司		

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.4 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

5.4.1 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股票投资明细

无。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

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十名资产支持证券投资明细

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贵金属投资明细

无。

5.9 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。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地参与股指期货交易。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货交易时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货交易是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在参与国债期货交易时，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11.3 本期国债期货投资评价

无。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	117,455.86
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	117,455.86

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.12.6 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	融通中证诚通央企科技创新 ETF 发起式联接 A	融通中证诚通央企科技创新 ETF 发起式联接 C
报告期期初基金份额总额	14,152,045.80	3,147,567.58
报告期期间基金总申购份额	1,452,896.91	4,376,075.14
减:报告期期间基金总赎回份额	1,630,116.23	2,551,113.31
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	13,974,826.48	4,972,529.41

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	融通中证诚通央企科技创新 ETF 发起式联接 A	融通中证诚通央企科技创新 ETF 发起式联接 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,004,277.77	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,004,277.77	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	52.80	-

注：申购含红利再投及转换入份额；赎回含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,004,277.77	52.80	10,004,277.77	52.80	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-

其他	-	-	-	-	-
合计	10,004,277.77	52.80	10,004,277.77	52.80	-

注：本基金合同生效日为 2025 年 4 月 29 日，本基金发起份额持有期限自合同生效日起不少于三年。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20260701-20260930	10,004,277.77	-	-	10,004,277.77	52.80
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予融通中证诚通央企科技创新交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的文件

（二）《融通中证诚通央企科技创新交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》

（三）《融通中证诚通央企科技创新交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》

（四）《融通中证诚通央企科技创新交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》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

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

10.3 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