

融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金（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	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
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	11
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	11
§ 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	16
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40

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	40
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	40
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	40
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	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	40
§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	42
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	42
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	43
10.8 其他重大事件	44
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
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	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	45
§ 12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	45
12.3 查阅方式	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	融通深证 100ETF
场内简称	深证 100ETF 融通
基金主代码	159219
交易代码	159219
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 4 月 24 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,388,018.00 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	2025 年 5 月 13 日

2.2 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	深证 100 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，紧密跟踪深证 100 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。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	方毅祖	冯萌
	联系电话	(0755) 26948666	(021) 52629999-213310
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95561
传真		(0755) 26935005	(021) 62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		518054	200120
法定代表人		张威	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	基金管理人处、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)
本期已实现收益	7,760,780.52
本期利润	8,625,052.50
加权平均基金份额本期利润	0.2749
本期加权平均净值利润率	20.12%
本期基金份额净值增长率	19.32%
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	4,738,542.80
期末可供分配基金份额利润	0.5649
期末基金资产净值	13,126,560.80
期末基金份额净值	1.5649
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	56.49%

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）。

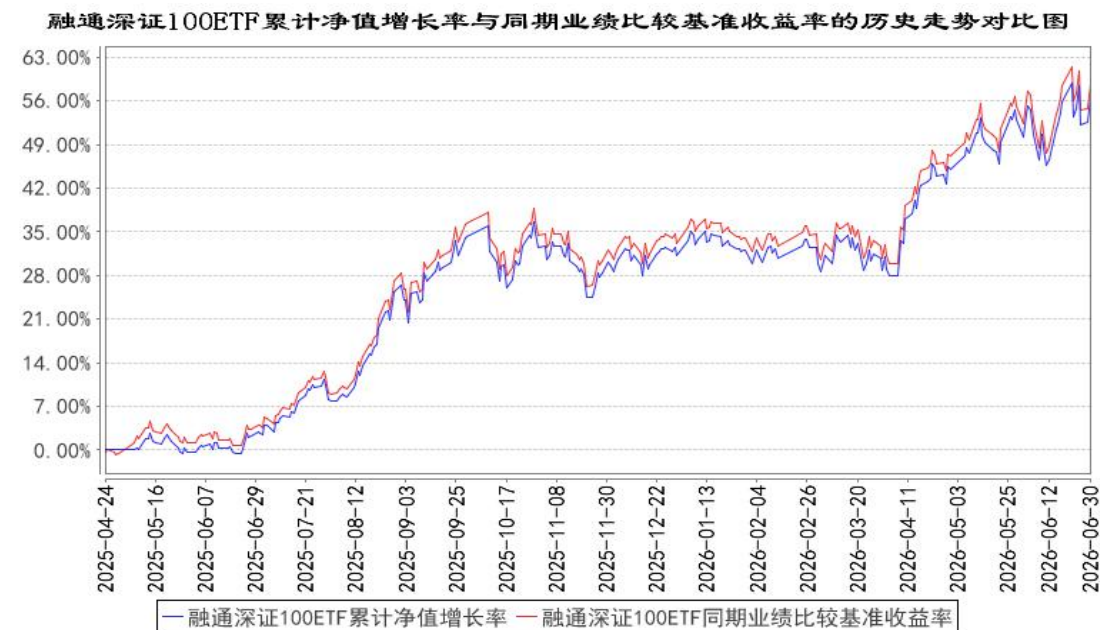
3.2 基金净值表现

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

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	21.48%	1.69%	21.31%	1.71%	0.17%	-0.02%

过去六个月	19.32%	1.44%	19.19%	1.46%	0.13%	-0.02%
过去一年	52.24%	1.36%	52.60%	1.37%	-0.36%	-0.01%
自基金合同生效起至今	56.49%	1.28%	58.69%	1.30%	-2.20%	-0.02%

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		
何天翔	本基金的基金经理、指数与量化投资部总经理	2025 年 4 月 24 日	—	18 年	何天翔先生，厦门大学经济学硕士，18 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。
熊俊杰	本基金的基金经理	2025 年 4 月 24 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。本基金运用指数化投资方式，主要采用完全复制法，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

基金操作层面，2026 年 6 月深证 100 成分股调整，根据自研的成分股调整换仓指令生产系统成功进行换仓操作，尽可能降低换仓带来的跟踪误差扩大，保证基金在成分股调整期间平稳运行。回顾 2026 年上半年，深证 100 上涨 19.19%，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。

估值方面，各类风格估值短期内依旧处在偏高位置，中长期看也处于合理偏高水平。短期来看，大中盘成长的高估程度较为严重，而价值板块（尤其是大盘价值）处在偏低估位置；长期来看，中小盘成长高估程度较为严重，大盘价值处在相对低估位置。资金方面，杠杆资金入市情绪持续火热，但需警惕杠杆资金情绪过高导致的市场波动加剧风险。风格方面，2026 年二季度，市场风格明显切向动量成长。具体看，成长表现较好，小市值、低 beta、低估值、低波动和低流动性表现相对较弱；从风格拥挤度和离散度看，成长和杠杆风格拥挤度相对较高，存在一定的风险，流动性的离散度相对较低，其他风格离散度处在相对合理水平。

总体而言，从情绪看，市场情绪持续火热，短期市场存在降温的可能性；从估值维度看，当下估值长期也到了合理偏高估水平，后续可能需要业绩持续验证来推动行情持续向上；从资金维度看，需要警惕杠杆资金情绪过高导致的市场波动加剧风险；从风格看，成长和杠杆风格相对拥挤，需要注意未来成长风格回调的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.5649 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.32%，业绩比较基准收益率为 19.19%。

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。

本基金跟踪的深证 100 指数聚焦深市大盘龙头板块，总体偏成长。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，深证 100 凭借其深市核心资产属性，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，深证 100 板块与经济基本面相关度较高，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

从 2026 年 5 月 12 日至本报告期末，本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五

千万的情形。

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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的真实、准确和完整发表意见

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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 100 交易型开放式指数证券投资基金

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	152,169.01	594,290.27
结算备付金		10,076.30	10,009.30
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	12,950,847.08	49,839,968.10
其中：股票投资		12,950,847.08	49,839,968.10
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	60,492.63	-
资产总计		13,173,585.02	50,444,267.67
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		-	-
应付管理人报酬		1,794.97	6,727.43
应付托管费		598.27	2,242.49
应付销售服务费		-	-
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	44,630.98	90,000.00
负债合计		47,024.22	98,969.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	8,388,018.00	38,388,018.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	4,738,542.80	11,957,279.75
净资产合计		13,126,560.80	50,345,297.75
负债和净资产总计		13,173,585.02	50,444,267.67

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5649 元，基金份额总额 8,388,018.00 份。

6.2 利润表

会计主体：融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

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 4 月 24 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		8,772,295.33	6,239,206.88
1. 利息收入		383.40	80,697.09
其中：存款利息收入	6.4.7.13	383.40	35,045.04
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		-	45,652.05
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,909,787.94	5,634,475.43
其中：股票投资收益	6.4.7.14	7,642,972.02	5,270,509.71
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	266,815.92	363,965.72
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	864,271.98	520,708.76
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	-2,147.99	3,325.60
减：二、营业总支出		147,242.83	102,123.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	32,257.17	31,960.35
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,752.31	10,653.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	104,233.35	59,509.16

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,625,052.50	6,137,083.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,625,052.50	6,137,083.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,625,052.50	6,137,083.88

6.3 净资产变动表

会计主体：融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

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	38,388,018.00	-	11,957,279.75	50,345,297.75
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	38,388,018.00	-	11,957,279.75	50,345,297.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-30,000,000.00	-	-7,218,736.95	-37,218,736.95
（一）、综合收益总额	-	-	8,625,052.50	8,625,052.50
（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）	-30,000,000.00	-	-15,843,789.45	-45,843,789.45
其中：1. 基金申购款	26,000,000.00	-	9,519,199.24	35,519,199.24
2. 基金赎回款	-56,000,000.00	-	-25,362,988.69	-81,362,988.69
（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	8,388,018.00	-	4,738,542.80	13,126,560.80
项目	上年度可比期间 2025 年 4 月 24 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	292,388,018.00	-	-	292,388,018.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-266,000,000.00	-	737,408.61	-265,262,591.39
（一）、综合收益总额	-	-	6,137,083.88	6,137,083.88
（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）	-266,000,000.00	-	-5,399,675.27	-271,399,675.27
其中：1. 基金申购款	26,000,000.00	-	174,717.94	26,174,717.94
2. 基金赎回款	-292,000,000.00	-	-5,574,393.21	-297,574,393.21
（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	26,388,018.00	-	737,408.61	27,125,426.61

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 100 交易型开放式指数证券投资基金（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”）证监基金字许可[2024]1882 号文《关于准予融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，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 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集，募集期为 2025 年 3 月 21 日至 2025 年 4 月 18 日。本基金为交易型开放式基金，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 291,093,000.00 元，股票认购人民币 1,268,226.00 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第 70072774_H06 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 4 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 292,388,018.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 26,792.00 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2025]448 号文审核同意，本基金 292,388,018.00 份基金份额于 2025 年 5 月 13 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证，下同）和备选成份股（含存托凭证，下同）。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、创业板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：深证 100 指数收益率。

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 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	51,022.33
等于：本金	51,017.33
加：应计利息	5.00
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	101,146.68
等于：本金	101,144.69
加：应计利息	1.99
减：坏账准备	-
合计	152,169.01

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商专用证券账户的证券交易结算资金。

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	11,485,529.05	-	12,950,847.08	1,465,318.03
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	11,485,529.05	-	12,950,847.08	1,465,318.03

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,630.98
合计	44,630.98

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	38,388,018.00	38,388,018.00
本期申购	26,000,000.00	26,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-56,000,000.00	-56,000,000.00
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	8,388,018.00	8,388,018.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,117,574.68	-2,160,294.93	11,957,279.75
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	14,117,574.68	-2,160,294.93	11,957,279.75
本期利润	7,760,780.52	864,271.98	8,625,052.50
本期基金份额交易产生的变动数	-15,401,962.76	-441,826.69	-15,843,789.45
其中：基金申购款	10,318,370.06	-799,170.82	9,519,199.24
基金赎回款	-25,720,332.82	357,344.13	-25,362,988.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,476,392.44	-1,737,849.64	4,738,542.80

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	131.71
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	184.69
结算备付金利息收入	67.00
其他	-
合计	383.40

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

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	132,235.72
股票投资收益——赎回差价收入	7,510,736.30
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	7,642,972.02

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	2,974,350.40
减：卖出股票成本总额	2,838,802.30
减：交易费用	3,312.38
买卖股票差价收入	132,235.72

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	81,362,988.69
减：现金支付赎回款总额	-1,012,348.31
减：赎回股票成本总额	74,864,600.70
减：交易费用	-
赎回差价收入	7,510,736.30

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 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	266,815.92
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	266,815.92

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	864,271.98
股票投资	864,271.98
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	864,271.98
----	------------

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	-
替代损益	-2,147.99
合计	-2,147.99

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

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	4,959.40
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	95.00
其他	59,507.37
合计	104,233.35

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
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人

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

无。

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

无。

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 4 月 24 日（基 金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	32,257.17	31,960.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,347.79	8,811.33
应支付基金管理人的净管理费	28,909.38	23,149.02

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 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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 4 月 24 日（基 金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	10,752.31	10,653.49

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 0.05% 年费率

计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

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

无。

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 4 月 24 日（基金合同生效日）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
兴业银行	51,022.33	131.71	50,841.73	22,662.67

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

无。

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

本基金是被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，紧密跟踪深证 100 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，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兴业银行或具备第三方存管资格的银行保管，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。

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同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	152,169.01	-	-	-	152,169.01
结算备付金	10,076.30	-	-	-	10,076.30
交易性金融资产	-	-	-	12,950,847.08	12,950,847.08
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	162,245.31	-	-	13,011,339.71	13,173,585.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,794.97	1,794.97
应付托管费	-	-	-	598.27	598.27
其他负债	-	-	-	44,630.98	44,630.98

负债总计	-	-	-	47,024.22	47,024.22
利率敏感度缺口	162,245.31	-	-	-12,964,315.49	13,126,560.80
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	594,290.27	-	-	-	594,290.27
结算备付金	10,009.30	-	-	-	10,009.30
交易性金融资产	-	-	-	-49,839,968.10	49,839,968.10
资产总计	604,299.57	-	-	-49,839,968.10	50,444,267.67
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	6,727.43	6,727.43
应付托管费	-	-	-	2,242.49	2,242.49
其他负债	-	-	-	90,000.00	90,000.00
负债总计	-	-	-	98,969.92	98,969.92
利率敏感度缺口	604,299.57	-	-	-49,740,998.18	50,345,297.75

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的股票，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。

本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，通过控制股票投资组合与标的指数的跟踪误差，力求实现对标的指数的有效跟踪。风险管理部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。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。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	12,950,847.08	98.66	49,839,968.10	99.00
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	12,950,847.08	98.66	49,839,968.10	99.00

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除深证 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. 深证 100 指数收益率上升 5%	648,186.83	—
	2. 深证 100 指数收益率下降 5%	-648,186.83	—

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金合同生效尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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	12,950,847.08	49,540,490.10
第二层次	—	299,478.00
第三层次	—	—
合计	12,950,847.08	49,839,968.10

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

从 2026 年 5 月 12 日至本报告期末，本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

除上述事项外，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	12,950,847.08	98.31
	其中：股票	12,950,847.08	98.31
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	162,245.31	1.23
8	其他各项资产	60,492.63	0.46
9	合计	13,173,585.02	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

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	182,783.00	1.39
B	采矿业	47,340.00	0.36
C	制造业	11,265,722.08	85.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,579.00	0.27
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	25,308.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	120,835.00	0.92
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	320,512.00	2.44
J	金融业	801,510.00	6.11
K	房地产业	49,400.00	0.38
L	租赁和商务服务业	58,080.00	0.44
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	43,778.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	12,950,847.08	98.66

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

无。

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	1,000	1,270,000.00	9.68
2	300750	宁德时代	3,060	1,202,610.60	9.16
3	300502	新易盛	1,504	912,928.00	6.95
4	002371	北方华创	520	459,971.20	3.50
5	000333	美的集团	5,700	430,521.00	3.28
6	002475	立讯精密	5,600	394,240.00	3.00
7	002384	东山精密	1,500	393,525.00	3.00
8	000725	京东方 A	38,800	336,784.00	2.57
9	300059	东方财富	15,300	311,814.00	2.38
10	300274	阳光电源	1,800	286,236.00	2.18
11	300408	三环集团	1,500	250,350.00	1.91
12	002463	沪电股份	1,600	244,480.00	1.86
13	300476	胜宏科技	700	242,501.00	1.85
14	002594	比亚迪	3,000	239,100.00	1.82
15	300394	天孚通信	736	222,772.48	1.70
16	301308	江波龙	300	211,140.00	1.61
17	000651	格力电器	5,100	191,250.00	1.46
18	000988	华工科技	1,000	184,610.00	1.41
19	000338	潍柴动力	6,000	163,500.00	1.25
20	300124	汇川技术	2,400	159,192.00	1.21
21	000858	五粮液	2,100	155,400.00	1.18
22	002415	海康威视	4,400	150,480.00	1.15
23	000063	中兴通讯	3,800	137,522.00	1.05
24	000100	TCL 科技	22,800	132,696.00	1.01
25	300433	蓝思科技	2,300	123,418.00	0.94
26	002028	思源电气	700	121,100.00	0.92
27	002142	宁波银行	4,000	118,760.00	0.90
28	000792	盐湖股份	3,900	117,741.00	0.90
29	002916	深南电路	250	114,475.00	0.87
30	300014	亿纬锂能	1,700	110,551.00	0.84
31	002050	三花智控	2,500	109,575.00	0.83
32	002353	杰瑞股份	700	106,750.00	0.81
33	000657	中钨高新	1,100	105,292.00	0.80

34	002714	牧原股份	2,900	101,471.00	0.77
35	000001	平安银行	10,000	100,500.00	0.77
36	002602	世纪华通	6,800	95,880.00	0.73
37	300760	迈瑞医疗	700	95,081.00	0.72
38	002230	科大讯飞	2,300	93,932.00	0.72
39	300033	同花顺	380	91,580.00	0.70
40	002352	顺丰控股	2,800	87,528.00	0.67
41	002460	赣锋锂业	1,300	85,020.00	0.65
42	002938	鹏鼎控股	800	84,304.00	0.64
43	000977	浪潮信息	1,200	84,000.00	0.64
44	002709	天赐材料	1,600	82,288.00	0.63
45	000776	广发证券	3,500	81,900.00	0.62
46	300498	温氏股份	6,600	81,312.00	0.62
47	000425	徐工机械	10,000	80,900.00	0.62
48	002466	天齐锂业	1,200	73,584.00	0.56
49	000938	紫光股份	2,500	72,150.00	0.55
50	002837	英维克	900	71,604.00	0.55
51	002049	紫光国微	800	71,000.00	0.54
52	000568	泸州老窖	900	69,768.00	0.53
53	002241	歌尔股份	3,000	67,590.00	0.51
54	300442	润泽科技	800	66,456.00	0.51
55	002600	领益智造	3,800	65,892.00	0.50
56	002179	中航光电	1,400	64,680.00	0.49
57	000408	藏格矿业	900	62,388.00	0.48
58	002027	分众传媒	12,000	58,080.00	0.44
59	002625	光启技术	1,900	57,608.00	0.44
60	000630	铜陵有色	9,000	57,240.00	0.44
61	000807	云铝股份	2,500	55,350.00	0.42
62	002422	科伦药业	1,400	53,928.00	0.41
63	002001	新 和 成	1,800	51,156.00	0.39
64	002648	卫星化学	2,000	46,980.00	0.36
65	300015	爱尔眼科	5,300	43,778.00	0.33
66	000166	申万宏源	9,900	43,560.00	0.33
67	000538	云南白药	900	42,633.00	0.32
68	000625	长安汽车	5,700	40,869.00	0.31
69	000157	中联重科	5,800	40,426.00	0.31
70	300418	昆仑万维	1,000	40,360.00	0.31
71	002311	海大集团	900	40,149.00	0.31
72	002236	大华股份	2,200	36,278.00	0.28
73	000975	山金国际	2,000	34,000.00	0.26
74	002493	荣盛石化	3,100	33,325.00	0.25
75	002736	国信证券	3,300	32,967.00	0.25
76	003816	中国广核	8,300	32,453.00	0.25

77	300866	安克创新	300	31,350.00	0.24
78	002601	龙佰集团	1,900	31,312.00	0.24
79	000768	中航西飞	1,500	30,720.00	0.23
80	000301	东方盛虹	2,600	29,770.00	0.23
81	000895	双汇发展	1,300	29,120.00	0.22
82	002304	洋河股份	700	26,705.00	0.20
83	001979	招商蛇口	4,000	25,720.00	0.20
84	000963	华东医药	900	25,308.00	0.19
85	002920	德赛西威	300	24,450.00	0.19
86	301269	华大九天	200	23,884.00	0.18
87	000002	万 科 A	8,000	23,680.00	0.18
88	000617	中油资本	3,100	20,429.00	0.16
89	001965	招商公路	2,200	20,152.00	0.15
90	302132	中航成飞	300	17,496.00	0.13
91	300999	金龙鱼	700	16,282.00	0.12
92	000999	华润三九	720	16,192.80	0.12
93	000596	古井贡酒	200	15,960.00	0.12
94	001280	中国铀业	200	13,340.00	0.10
95	000708	中信特钢	1,000	12,620.00	0.10
96	300765	石药创新	400	10,892.00	0.08
97	001391	国货航	1,800	7,326.00	0.06
98	300979	华利集团	200	5,950.00	0.05
99	001872	招商港口	300	5,829.00	0.04
100	001289	龙源电力	200	3,126.00	0.02

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

无。

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	300308	中际旭创	645,263.00	1.28
2	300502	新易盛	306,993.00	0.61
3	300750	宁德时代	251,719.00	0.50
4	301308	江波龙	221,557.00	0.44
5	000988	华工科技	181,668.00	0.36
6	002028	思源电气	164,333.00	0.33
7	002916	深南电路	135,143.00	0.27
8	002353	杰瑞股份	134,548.00	0.27
9	002602	世纪华通	125,639.00	0.25
10	300033	同花顺	122,658.00	0.24
11	000657	中钨高新	115,308.00	0.23
12	300476	胜宏科技	112,543.00	0.22

13	300274	阳光电源	112,323.00	0.22
14	002709	天赐材料	99,470.00	0.20
15	000807	云铝股份	89,967.00	0.18
16	000630	铜陵有色	84,081.00	0.17
17	300394	天孚通信	81,750.00	0.16
18	000858	五 粮 液	79,949.00	0.16
19	002837	英维克	75,438.00	0.15
20	300408	三环集团	70,984.00	0.14

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	300394	天孚通信	276,118.00	0.55
2	300750	宁德时代	202,248.00	0.40
3	300308	中际旭创	201,300.00	0.40
4	300866	安克创新	132,284.00	0.26
5	002371	北方华创	116,454.00	0.23
6	301269	华大九天	107,185.00	0.21
7	300661	圣邦股份	107,087.40	0.21
8	300896	爱美客	87,670.00	0.17
9	002475	立讯精密	72,342.00	0.14
10	000596	古井贡酒	68,377.00	0.14
11	000333	美的集团	65,344.00	0.13
12	002460	赣锋锂业	62,788.00	0.12
13	300628	亿联网络	51,182.00	0.10
14	300502	新易盛	50,600.00	0.10
15	000568	泸州老窖	47,860.00	0.10
16	300059	东方财富	47,466.00	0.09
17	000338	潍柴动力	47,296.00	0.09
18	300408	三环集团	40,265.00	0.08
19	002916	深南电路	38,613.00	0.08
20	300979	华利集团	38,023.00	0.08

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	4,325,977.00
卖出股票收入（成交）总额	2,974,350.40

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

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。

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

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。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	60,492.63

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

无。

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

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 (%)
251	33,418.40	5,200,286.00	62.00	3,187,732.00	38.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	100.00	0.00119

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 4 月 24 日） 基金份额总额	292,388,018.00
本报告期期初基金份额总额	38,388,018.00
本报告期基金总申购份额	26,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	56,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	8,388,018.00

§ 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

报告期内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），该事务所自基金合同生效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

报告期内，本基金的托管人在开展基金托管业务过程中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

报告期内，本基金的托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中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 (%)	
华福证券	3	7,300,327.40	100.00	1,356.91	100.00	-

注：1. 本基金使用券商交易模式。

2. 本基金选择的券商为华福证券。本基金管理人与华福证券不存在关联方关系。

3. 券商交易模式下的券商选择标准为：

(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。

4. 券商交易模式下的券商选择程序为：

(1) 本基金管理人根据上述标准对券商进行考察评价后，经公司内部审批程序确定选用的券商；

(2) 本基金管理人和被选中的券商签订经纪服务协议。

5. 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 (%)
华福证券	-	-	-	-	-	-

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
5	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
6	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

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	20260513-20260630	1,985,917.00	13,655,353.00	11,798,094.00	3,843,176.00	45.82
	2	20260512-20260513, 20260529-20260531	2,478,936.00	35,111,277.00	36,238,713.00	1,351,500.00	16.11
	3	20260101-20260528	28,800,000.00	-	28,800,000.00	-	-

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。

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）中国证监会准予融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件
- （二）《融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三）《融通深证 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- （四）《融通深证 100 交易型开放式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