

融通通利系列证券投资基金之
融通深证 100 指数证券投资基金
2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通深证 100 指数证券投资基金（以下简称“本基金”）2025 年中期报告。

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，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据《融通通利系列证券投资基金基金合同》规定，于 2025 年 8 月 26 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2025 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	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
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	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

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	44
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	44
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	44
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	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通深证 100 指数证券投资基金	
基金简称	融通深证 100 指数	
基金主代码	161604	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003 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	
报告期末基金份额总额	3,309,773,165.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C
下属分级基金的交易代码	161604	004876
下属分级基金的前端交易代码	161604	—
下属分级基金的后端交易代码	161654	—
报告期末下属分级基金的份额总额	3,293,855,800.39 份	15,917,365.11 份

2.2 基金产品说明

投资目标	运用指数化投资方式，通过控制股票投资组合与深证 100 指数的跟踪误差，力求实现对深证 100 指数的有效跟踪，谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场的发展，实现基金资产的长期增长，为投资者带来稳定回报。
投资策略	以非债券资产 90%以上的资金对深证 100 指数的成份股进行股票指数化投资。股票指数化投资部分不得低于基金资产的 50%，采用复制法跟踪深证 100 指数，对于因流动性等原因导致无法完全复制深证 100 指数的情况，将采用剩余组合替换等方法避免跟踪误差扩大。
业绩比较基准	深证 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	涂卫东	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金中期报告备置地点	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	融通基金管理有限公司	深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C
本期已实现收益	-10,736,028.95	-92,082.71
本期利润	-71,250,694.73	-404,574.95
加权平均基金份额本期利润	-0.0213	-0.0245
本期加权平均净值利润率	-1.64%	-1.94%
本期基金份额净值增长率	-1.57%	-1.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,020,345,068.29	4,273,798.91
期末可供分配基金份额利润	0.3098	0.2685
期末基金资产净值	4,314,200,868.68	20,191,164.02
期末基金份额净值	1.310	1.268
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	379.79%	12.71%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通深证 100 指数 A/B

阶段	份额净	份额净值	业绩比较	业绩比较基	①—③	②—④
----	-----	------	------	-------	-----	-----

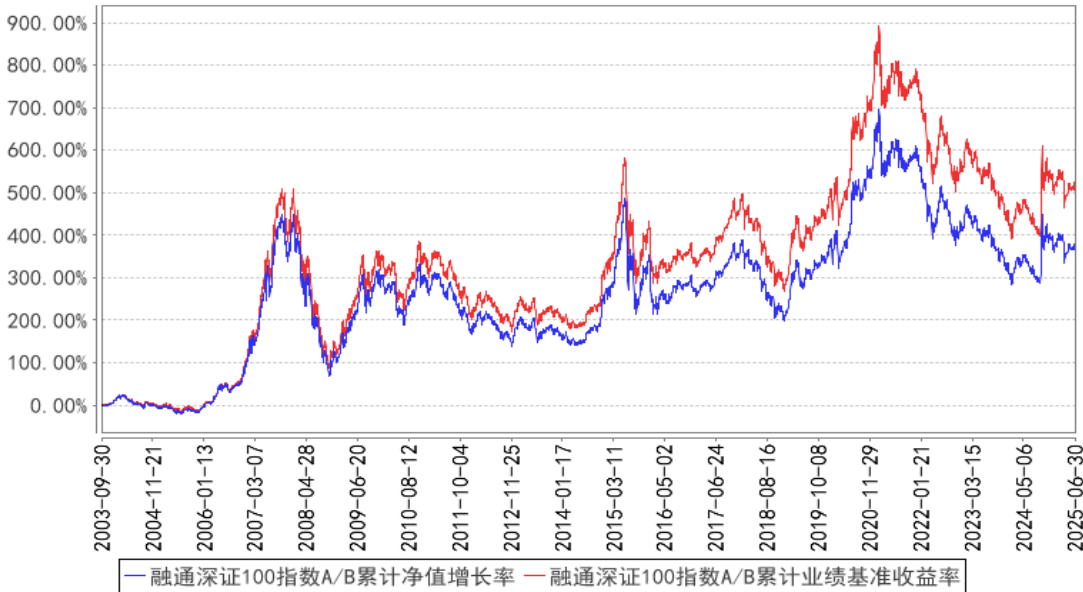
	值增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
过去一个月	3.15%	0.72%	3.22%	0.72%	-0.07%	0.00%
过去三个月	-0.76%	1.33%	-0.53%	1.33%	-0.23%	0.00%
过去六个月	-1.57%	1.21%	-1.15%	1.23%	-0.42%	-0.02%
过去一年	13.98%	1.68%	15.15%	1.69%	-1.17%	-0.01%
过去三年	-21.23%	1.30%	-19.10%	1.31%	-2.13%	-0.01%
自基金合同生效起至今	379.79%	1.64%	524.17%	1.61%	-144.38%	0.03%

融通深证 100 指数 C

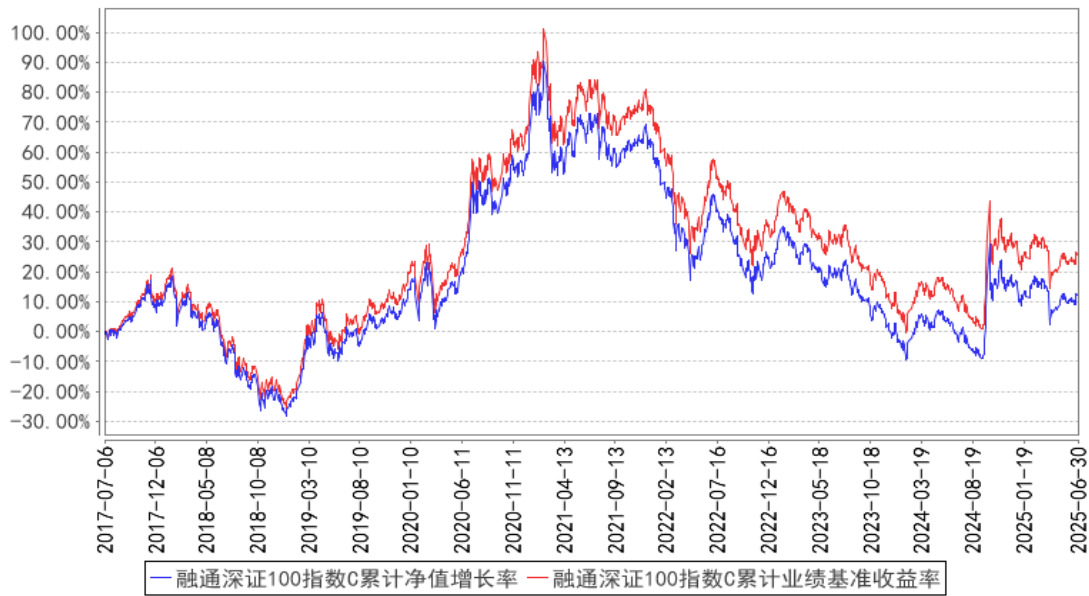
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.09%	0.73%	3.22%	0.72%	-0.13%	0.01%
过去三个月	-0.94%	1.33%	-0.53%	1.33%	-0.41%	0.00%
过去六个月	-1.85%	1.22%	-1.15%	1.23%	-0.70%	-0.01%
过去一年	13.48%	1.68%	15.15%	1.69%	-1.67%	-0.01%
过去三年	-22.16%	1.30%	-19.10%	1.31%	-3.06%	-0.01%
自基金合同生效起至今	12.71%	1.40%	26.49%	1.39%	-13.78%	0.01%

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

融通深证100指数A/B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



融通深证100指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金业绩比较基准项目分段计算，其中：2005年8月21日之前(含此日)采用“深证100指数×75%+银行间债券综合指数×25%”，2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%”。

2、本基金于2017年7月5日增加C类份额，C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%、日兴资产管理有限公司（Nikko 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	说明
----	----	-----------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
何天翔	本基金的基金经理、指数与量化投资部总经理	2014 年 10 月 25 日	-	17 年	何天翔先生，厦门大学经济学硕士，17 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。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

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

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金标的指数深证 100R 指数收益率为-1.27%，呈现区间震荡形态，其中 4 月初波动较大。报告期内市场整体呈现震荡形态，其中沪深 300 指数收益率 0.03%，中证 500 指数收益率 3.31%。市场交易活跃度较去年四季度有所降低，但仍保持在较高水平。

行业方面，有色、银行、军工、传媒、通信等行业指数涨幅靠前，煤炭、食品饮料、房地产、石油石化、建筑装饰等行业指数跌幅较大。

深证 100 指数由深圳交易所 100 只市值大，流动性好的 A 股股票编制而成，为深市核心指数之一，消费和科技的占比较高，报告期末前五大权重行业分别为电力设备、电子、家用电器、医药生物、非银金融。

本基金核心投资策略是在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化，运用指数化投资策略，通过控制股票投资权重与深证 100 指数成份股自然权重的偏离，有效控制跟踪误差，为投资者提供投资深证 100 指数的一个有效工具。我们通过算法交易系统、跟踪误差分析系统、以及自建的指数基金日报表系统，有效控制跟踪误差，严控指数组合投资风险。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.03%，年化跟踪误差为 0.31%，符合基金合同约定，本报告期内跟踪误差分析如下：

- 1、通过算法交易系统等方式，应对申赎等行为带来的仓位和现金偏离，使得跟踪误差尽量小。
- 2、通过积极参与新股投资，剔除或低配少量的评估风险较大的成分股，以力求增加正向收益。
- 3、通过自建的指数基金日报表系统，及时对组合进行再平衡投资，以控制组合的跟踪误差。
- 4、本报告期内，无长期停牌成分股，不涉及相关投资操作和跟踪误差影响。
- 5、本报告期内，成分股定期调整一次，调入和调出成分股数量各 3 只，权重占比约 1%，换

手率较低，投资运作上，根据流动性和市场波动分批次调整完成此次定期调整，跟踪误差控制良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通深证 100 指数 A/B 基金份额净值为 1.310 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.57%，同期业绩比较基准收益率为-1.15%；

截至本报告期末融通深证 100 指数 C 基金份额净值为 1.268 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.85%，同期业绩比较基准收益率为-1.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，国民经济迎难而上、稳中向好。初步核算，上半年 GDP 同比增长 5.3%，分产业看，第一产业增加值同比增长 3.7%，第二产业增加值同比增长 5.3%，第三产业增加值同比增长 5.5%。分季度看，一季度 GDP 同比增长 5.4%，二季度增长 5.2%。上半年全国规模以上工业增加值同比增长 6.4%，工业生产较快增长，装备制造业和高技术制造业增势良好。上半年进出口总额同比增长 2.9%，其中，出口增长 7.2%，进口下降 2.7%。上半年 CPI 同比下降 0.1%，PPI 同比下降 2.8%。总的来看，上半年更加积极有为的宏观政策发力显效，经济运行延续稳中向好发展态势，展现出强大韧性和活力。外部不稳定不确定因素较多，国内有效需求不足，经济回升向好基础仍需加力巩固。

当前证券市场整体估值和盈利增长预期基本匹配，根据 wind 数据显示，2025 年 6 月底，沪深 300 指数 TTM 市盈率 13 倍左右，处于成立以来 50%分位左右，2025 年一致预期净利润增速 8%左右；中证 500 指数 TTM 市盈率 29 倍左右，处于成立以来 47%分位左右，2025 年一致预期净利润增速 38%左右。总的来说，当前整体市场估值合理，预期增速不低。

再看深证 100 指数，近年来深证 100 指数的估值逐步提升，估值中枢也同时提升，根据 wind 数据显示，2025 年 6 月底，其 TTM 市盈率 22 倍左右，处于成立以来 55%左右的分位数水平，估值合理，深证 100 指数 2025 年一致预期净利润增长率为 33%左右，市场预期成长性较好。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司基金估值业务原则和程序管理细则》进行，公司设立由研究相关部门、风险管理部、登记清算部、稽核审计部和法律合规部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方估值服务机构的估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及

时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2025 年 1 月 15 日实施 2024 年第 1 次利润分配，以 2024 年 12 月 31 日的可分配收益为基准，融通深证 100 指数 A/B 每 10 份基金份额派发红利 0.0300 元，融通深证 100 指数 C 每 10 份基金份额派发红利 0.0300 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——融通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，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 2025 年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：融通通利系列证券投资基金之融通深证 100 指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
-----	-----	------------------------	--------------------------

资 产:			
货币资金	6.4.7.1	242,505,380.60	235,514,015.78
结算备付金		35,182.46	-
存出保证金		55,134.74	25,608.04
交易性金融资产	6.4.7.2	4,100,655,191.09	4,312,640,199.68
其中: 股票投资		4,100,655,191.09	4,299,391,753.65
基金投资		-	-
债券投资		-	13,248,446.03
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		31,331.66	-
应收股利		-	-
应收申购款		428,036.26	815,767.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,343,710,256.81	4,548,995,590.57
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		4,743,070.95	4,790,419.72
应付管理人报酬		3,496,862.41	3,906,920.97
应付托管费		699,372.47	781,384.20
应付销售服务费		6,636.09	7,543.35
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	372,282.19	485,044.01
负债合计		9,318,224.11	9,971,312.25

净资产：			
实收基金	6.4.7.10	3,309,773,165.50	3,401,974,044.11
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,024,618,867.20	1,137,050,234.21
净资产合计		4,334,392,032.70	4,539,024,278.32
负债和净资产总计		4,343,710,256.81	4,548,995,590.57

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日,基金份额总额 3,309,773,165.50 份，其中融通深证 100 指数 A/B 类基金份额 3,293,855,800.39 份，基金份额净值 1.310 元，融通深证 100 指数 C 类基金份额 15,917,365.11 份，基金份额净值 1.268 元。

6.2 利润表

会计主体：融通通利系列证券投资基金之融通深证 100 指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日
一、营业总收入		-45,589,879.74	-98,911,518.53
1. 利息收入		416,568.20	404,833.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	416,568.20	404,833.26
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）		14,695,990.73	-16,453,016.56
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-39,847,721.70	-69,765,936.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-65,146.03	-
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	54,608,858.46	53,312,919.51
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	-60,827,158.02	-82,937,627.09
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	124,719.35	74,291.86
减：二、营业总支出		26,065,389.94	24,061,588.32

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	21,605,545.01	19,921,530.20
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,321,108.98	3,984,306.07
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	41,263.68	32,175.61
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	97,472.27	123,576.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-71,655,269.68	-122,973,106.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-71,655,269.68	-122,973,106.85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-71,655,269.68	-122,973,106.85

6.3 净资产变动表

会计主体：融通通利系列证券投资基金之融通深证 100 指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	3,401,974,044.11	-	1,137,050,234.21	4,539,024,278.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,401,974,044.11	-	1,137,050,234.21	4,539,024,278.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-92,200,878.61	-	-112,431,367.01	-204,632,245.62
（一）、综合收益总额	-	-	-71,655,269.68	-71,655,269.68
（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）	-92,200,878.61	-	-30,562,682.13	-122,763,560.74
其中：1. 基金申购款	136,001,926.08	-	39,539,581.50	175,541,507.58
2. 基金赎回款	-228,202,804.69	-	-70,102,263.63	-298,305,068.32
（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	-	-	-10,213,415.20	-10,213,415.20

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	3,309,773,165.50	-	1,024,618,867.20	4,334,392,032.70
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	3,384,344,620.04	-	646,475,443.88	4,030,820,063.92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,384,344,620.04	-	646,475,443.88	4,030,820,063.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	33,052,635.49	-	-127,880,614.45	-94,827,978.96
(一)、综合收益总额	-	-	-122,973,106.85	-122,973,106.85
(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)	33,052,635.49	-	5,278,177.26	38,330,812.75
其中：1. 基金申购款	187,259,067.03	-	31,330,720.60	218,589,787.63
2. 基金赎回款	-154,206,431.54	-	-26,052,543.34	-180,258,974.88
(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)	-	-	-10,185,684.86	-10,185,684.86
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,417,397,255.53	-	518,594,829.43	3,935,992,084.96

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：

商小虎王智鲲刘美丽

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 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)是融通通利系列证券投资基金(以下简称“本系列基金”)之子基金，本系列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[2003]第 94 号《关于同意融通通利系列证券投资基金设立的批复》核准，由融通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》

等有关规定(后由《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法规替代)和《融通通利系列证券投资基金基金契约》(后更名为《融通通利系列证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 9 月 30 日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,本基金首次设立,包括认购资金利息共募集人民币 477,689,377.16 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 138 号验资报告予以验证,其中认购资金为人民币 477,610,977.87 元,认购资金产生利息为人民币 78,399.29 元。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《关于融通深证 100 指数证券投资基金增设 H 类基金份额类别并修改基金合同的公告》以及更新的《融通通利系列证券投资基金更新招募说明书》的有关规定,自 2016 年 7 月 14 日起,本基金根据销售对象的不同,将基金份额分为不同的类别。在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的份额,称为 A 类基金份额;在中国香港地区销售的、为中国香港投资者设立的份额,称为 H 类基金份额。本基金 A 类基金份额、H 类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务,本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《关于融通深证 100 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并修订基金合同部分条款的公告》以及更新的《融通通利系列证券投资基金更新招募说明书》的有关规定,自 2017 年 7 月 5 日起,本基金根据销售服务费或申购费收取方式的不同以及销售对象的不同将基金份额分为不同的类别。在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的,在投资者申购时收取前端申购费用,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额,称为 A 类基金份额;在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的,在投资者赎回时收取后端申购费用,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额,称为 B 类基金份额;在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的,不收取前/后端申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的份额,称为 C 类基金份额;在中国香港地区销售的、为中国香港投资者设立的份额,称为 H 类基金份额。本基金 A/B 类基金份额、C 类基金份额、H 类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务,本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。截至 2025 年 6 月 30 日,本基金尚未正式开通 H 类基金份额申赎业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通利系列证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为深证 100 指数成份股和债券,以基金非债券资产 90%以上的资金对深证 100 指数的成份股进行股票指数化投资,其中股票指数化投资部分不得低于基金资产的 50%,相对于深证 100 指数的日跟踪误差不超过 0.5%。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。此外本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。本基金业绩比较基准为：深证 100 指数收益率 $\times$ 95%+银行同业存款利率 $\times$ 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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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》、《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

（1）增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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 号文《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 号文《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 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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，（如有）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 号文《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，（如有）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 号文《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 号文《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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	242,505,380.60
等于：本金	242,483,953.29
加：应计利息	21,427.31
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	242,505,380.60

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,232,555,392.42	-	4,100,655,191.09	868,099,798.67
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		3,232,555,392.42	-	4,100,655,191.09	868,099,798.67

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	7,141.71
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	22,372.21
其中：交易所市场	22,372.21
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	92,768.27
合计	372,282.19

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通深证 100 指数 A/B

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,384,914,971.03	3,384,914,971.03
本期申购	129,320,679.75	129,320,679.75
本期赎回（以“-”号填列）	-220,379,850.39	-220,379,850.39
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	3,293,855,800.39	3,293,855,800.39

融通深证 100 指数 C

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,059,073.08	17,059,073.08
本期申购	6,681,246.33	6,681,246.33
本期赎回（以“-”号填列）	-7,822,954.30	-7,822,954.30
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	15,917,365.11	15,917,365.11

注：申购含红利再投及转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

融通深证 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	1,860,784,525.00	-728,767,164.59	1,132,017,360.41
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,860,784,525.00	-728,767,164.59	1,132,017,360.41
本期利润	-10,736,028.95	-60,514,665.78	-71,250,694.73
本期基金份额交易产生的变动数	-50,082,933.37	19,824,152.89	-30,258,780.48
其中：基金申购款	71,272,631.79	-33,448,948.39	37,823,683.40
基金赎回款	-121,355,565.16	53,273,101.28	-68,082,463.88
本期已分配利润	-10,162,816.91	-	-10,162,816.91
本期末	1,789,802,745.77	-769,457,677.48	1,020,345,068.29

融通深证 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	8,013,411.20	-2,980,537.40	5,032,873.80
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	8,013,411.20	-2,980,537.40	5,032,873.80
本期利润	-92,082.71	-312,492.24	-404,574.95
本期基金份额交易产生的变动数	-532,434.53	228,532.88	-303,901.65
其中：基金申购款	3,140,163.43	-1,424,265.33	1,715,898.10
基金赎回款	-3,672,597.96	1,652,798.21	-2,019,799.75
本期已分配利润	-50,598.29	-	-50,598.29
本期末	7,338,295.67	-3,064,496.76	4,273,798.91

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	415,966.60
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	301.88
其他	299.72
合计	416,568.20

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-39,847,721.70
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	-39,847,721.70

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	163,253,436.09
减：卖出股票成本总额	202,962,673.70
减：交易费用	138,484.09
买卖股票差价收入	-39,847,721.70

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	16,753.97
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-81,900.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-65,146.03

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	13,254,800.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,081,900.00
减：应计利息总额	254,800.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-81,900.00

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 资产支持证券投资基金收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资基金收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资基金收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资基金收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资基金收益——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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	54,608,858.46
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	54,608,858.46

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-60,827,158.02
股票投资	-60,898,658.02
债券投资	71,500.00
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	-60,827,158.02

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	112,266.26
基金转换费收入	12,453.09
合计	124,719.35

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. 基金转换费用包括转换费和补差费，其中本基金与本基金管理人旗下除融通通利系列证券投资基金外的其他基金的转换，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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	28,760.90
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	204.00
账户维护费	9,000.00
合计	97,472.27

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 关联方关系

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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		2024 年 1 月 1 日至 2024 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	41,339,119.84	18.18	-	-

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			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
诚通证券	7,684.80	18.18	6,208.23	27.75
关联方名称	上年度可比期间			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	-	-

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	21,605,545.01	19,921,530.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,175,416.13	9,418,531.68
应支付基金管理人的净管理费	11,430,128.88	10,502,998.52

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

$$H=E\times 1.00\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,321,108.98	3,984,306.07

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

$$H=E\times 0.20\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C	合计
融通基金	-	2,235.59	2,235.59
中国工商银行	-	7,371.11	7,371.11
合计	-	9,606.70	9,606.70
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C	合计
融通基金	-	4,586.49	4,586.49
中国工商银行	-	731.89	731.89
合计	-	5,318.38	5,318.38

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A/B 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金

份额的销售服务费年费率为 0.40%。计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应支付的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	242,505,380.60	415,966.60	232,439,540.62	402,845.79

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

融通深证 100 指数 A/B								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配合计	备注
		场内	场外					

1	2025 年 1 月 15 日	-	2025 年 1 月 15 日	0.030	3,739,079.77	6,423,737.14	10,162,816.91	-
合计	-	-	-	0.030	3,739,079.77	6,423,737.14	10,162,816.91	-
融通深证 100 指数 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2025 年 1 月 15 日	-	2025 年 1 月 15 日	0.030	38,697.74	11,900.55	50,598.29	-
合计	-	-	-	0.030	38,697.74	11,900.55	50,598.29	-

6.4.12 期末（2025 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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	1-6 个月（含）	首发流 通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	1-6 个月（含）	首发流 通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	1-6 个月（含）	首发流 通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	首发流 通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1-6 个月（含）	首发流 通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	1-6 个月（含）	首发流 通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	1-6 个月（含）	首发流 通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	1-6 个月（含）	首发流 通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	1-6 个月（含）	首发流 通受限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	1-6 个月（含）	首发流 通受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	1-6 个月（含）	首发流 通受限	41.90	77.87	130	5,447.00	10,123.10	-
301479	弘景光电	2025 年 5 月 28 日	1-6 个月（含）	送股流 通受限	-	77.87	52	-	4,049.24	-
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	1-6 个月（含）	首发流 通受限	39.92	45.22	241	9,620.72	10,898.02	-

301501	恒鑫生活	2025 年 6 月 6 日	1-6 个月(含)	送股流通受限	-	45.22	109	-	4,928.98	-
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-

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风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和个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同责任，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 2025 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2024 年 12 月 31 日：本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券)。

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 2025 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	242,505,380.60	-	-	-	242,505,380.60
结算备付金	35,182.46	-	-	-	35,182.46
存出保证金	55,134.74	-	-	-	55,134.74
交易性金融资产	-	-	-	4,100,655,191.09	4,100,655,191.09
应收申购款	-	-	-	428,036.26	428,036.26
应收清算款	-	-	-	31,331.66	31,331.66
资产总计	242,595,697.80	-	-	4,101,114,559.01	4,343,710,256.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,743,070.95	4,743,070.95
应付管理人报酬	-	-	-	3,496,862.41	3,496,862.41
应付托管费	-	-	-	699,372.47	699,372.47
应付销售服务费	-	-	-	6,636.09	6,636.09
其他负债	-	-	-	372,282.19	372,282.19
负债总计	-	-	-	9,318,224.11	9,318,224.11
利率敏感度缺口	242,595,697.80	-	-	4,091,796,334.90	4,334,392,032.70
上年度末 2024 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	235,514,015.78	-	-	-	235,514,015.78
存出保证金	25,608.04	-	-	-	25,608.04
交易性金融资产	13,248,446.03	-	-	4,299,391,753.65	4,312,640,199.68
应收申购款	-	-	-	815,767.07	815,767.07
资产总计	248,788,069.85	-	-	4,300,207,520.72	4,548,995,590.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,790,419.72	4,790,419.72
应付管理人报酬	-	-	-	3,906,920.97	3,906,920.97

应付托管费	-	-	-	781,384.20	781,384.20
应付销售服务费	-	-	-	7,543.35	7,543.35
其他负债	-	-	-	485,044.01	485,044.01
负债总计	-	-	-	9,971,312.25	9,971,312.25
利率敏感度缺口	248,788,069.85	-	-	-4,290,236,208.47	4,539,024,278.32

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 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.29%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2024 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。

本基金运用指数化投资方式，通过控制股票投资组合与深证 100 指数的跟踪误差，力求实现对深证 100 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。本基金投资组合中股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	4,100,655,191.09	94.61	4,299,391,753.65	94.72
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	4,100,655,191.09	94.61	4,299,391,753.65	94.72

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 （2025 年 6 月 30 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日）
	1. 深证 100 指数收益率上升 5%	203,996,514.15	213,650,688.96
	2. 深证 100 指数收益率下降 5%	-203,996,514.15	-213,650,688.96

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	4,100,412,258.86	4,277,654,542.51

第二层次	15,385.54	34,636,252.03
第三层次	227,546.69	349,405.14
合计	4,100,655,191.09	4,312,640,199.68

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	4,100,655,191.09	94.40
	其中：股票	4,100,655,191.09	94.40
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	242,540,563.06	5.58
8	其他各项资产	514,502.66	0.01
9	合计	4,343,710,256.81	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	128,883,707.69	2.97
B	采矿业	25,936,930.00	0.60
C	制造业	3,120,500,083.51	71.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,437,624.00	0.40
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,059,000.72	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	85,294,222.24	1.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	111,764,247.17	2.58
J	金融业	443,516,698.95	10.23
K	房地产业	31,420,822.14	0.72
L	租赁和商务服务业	48,758,765.90	1.12
M	科学研究和技术服务业	32,184,656.70	0.74
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	34,655,499.84	0.80
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,100,412,258.86	94.60

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	229,111.53	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	11,576.70	0.00
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	242,932.23	0.01

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	300750	宁德时代	1,646,046	415,165,722.12	9.58
2	000333	美的集团	3,158,520	228,045,144.00	5.26
3	300059	东方财富	8,082,073	186,938,348.49	4.31
4	002594	比亚迪	547,745	181,802,042.95	4.19
5	000858	五粮液	1,170,996	139,231,424.40	3.21
6	000651	格力电器	2,797,522	125,664,688.24	2.90
7	002475	立讯精密	3,027,322	105,017,800.18	2.42
8	000725	京东方 A	20,731,603	82,719,095.97	1.91
9	300308	中际旭创	561,445	81,892,367.70	1.89
10	002371	北方华创	183,600	81,189,756.00	1.87
11	300760	迈瑞医疗	347,712	78,148,272.00	1.80
12	300124	汇川技术	1,209,445	78,093,863.65	1.80
13	002714	牧原股份	1,645,645	69,133,546.45	1.59
14	002352	顺丰控股	1,410,874	68,794,216.24	1.59
15	002415	海康威视	2,455,640	68,094,897.20	1.57
16	300502	新易盛	530,600	67,396,812.00	1.55
17	000063	中兴通讯	2,046,440	66,488,835.60	1.53
18	000001	平安银行	5,448,078	65,758,301.46	1.52
19	300274	阳光电源	934,420	63,325,643.40	1.46
20	002142	宁波银行	2,257,492	61,764,981.12	1.42
21	300498	温氏股份	3,498,253	59,750,161.24	1.38
22	002230	科大讯飞	1,196,331	57,280,328.28	1.32
23	000568	泸州老窖	481,990	54,657,666.00	1.26
24	000100	TCL 科技	11,812,004	51,145,977.32	1.18
25	000338	潍柴动力	3,281,936	50,476,175.68	1.16
26	002027	分众传媒	6,679,283	48,758,765.90	1.12
27	000425	徐工机械	5,068,500	39,382,245.00	0.91
28	300014	亿纬锂能	842,127	38,577,837.87	0.89
29	002241	歌尔股份	1,651,443	38,511,650.76	0.89
30	000792	盐湖股份	2,178,681	37,211,871.48	0.86
31	000625	长安汽车	2,830,839	36,121,505.64	0.83

32	000977	浪潮信息	688,100	35,010,528.00	0.81
33	300033	同花顺	128,100	34,972,581.00	0.81
34	002463	沪电股份	820,921	34,954,816.18	0.81
35	002050	三花智控	1,322,414	34,885,281.32	0.80
36	300015	爱尔眼科	2,776,883	34,655,499.84	0.80
37	002311	海大集团	518,100	30,355,479.00	0.70
38	000166	申万宏源	6,001,669	30,128,378.38	0.70
39	000776	广发证券	1,779,866	29,919,547.46	0.69
40	002179	中航光电	728,506	29,402,502.16	0.68
41	000538	云南白药	506,626	28,264,664.54	0.65
42	300408	三环集团	840,180	28,062,012.00	0.65
43	002049	紫光国微	420,279	27,679,574.94	0.64
44	000938	紫光股份	1,152,659	27,652,289.41	0.64
45	300433	蓝思科技	1,230,218	27,433,861.40	0.63
46	002028	思源电气	365,000	26,612,150.00	0.61
47	002422	科伦药业	722,400	25,948,608.00	0.60
48	002460	赣锋锂业	736,590	24,874,644.30	0.57
49	000768	中航西飞	833,112	22,777,282.08	0.53
50	002466	天齐锂业	708,000	22,684,320.00	0.52
51	002736	国信证券	1,905,052	21,946,199.04	0.51
52	002001	新 和 成	1,026,790	21,839,823.30	0.50
53	000157	中联重科	2,917,988	21,097,053.24	0.49
54	000975	山金国际	1,108,300	20,991,202.00	0.48
55	000661	长春高新	211,456	20,972,206.08	0.48
56	300394	天孚通信	254,940	20,354,409.60	0.47
57	002236	大华股份	1,273,662	20,225,752.56	0.47
58	002252	上海莱士	2,931,400	20,138,718.00	0.46
59	000963	华东医药	497,002	20,059,000.72	0.46
60	001979	招商蛇口	2,279,652	19,992,548.04	0.46
61	002648	卫星化学	1,146,100	19,861,913.00	0.46
62	002304	洋河股份	297,850	19,226,217.50	0.44
63	300661	圣邦股份	259,748	18,901,861.96	0.44
64	002916	深南电路	168,064	18,118,979.84	0.42
65	300347	泰格医药	339,585	18,106,672.20	0.42
66	003816	中国广核	4,625,200	16,835,728.00	0.39
67	002920	德赛西威	162,675	16,613,997.75	0.38
68	300782	卓胜微	231,362	16,512,305.94	0.38
69	000895	双汇发展	676,203	16,506,115.23	0.38
70	002601	龙佰集团	1,015,503	16,461,303.63	0.38
71	002493	荣盛石化	1,979,550	16,390,674.00	0.38
72	000786	北新建材	615,200	16,290,496.00	0.38
73	301269	华大九天	127,200	15,757,536.00	0.36
74	302132	中航成飞	178,000	15,653,320.00	0.36

75	300896	爱美客	88,176	15,414,046.56	0.36
76	300122	智飞生物	784,319	15,364,809.21	0.35
77	300418	昆仑万维	445,763	14,991,009.69	0.35
78	300442	润泽科技	302,000	14,958,060.00	0.35
79	001965	招商公路	1,214,300	14,571,600.00	0.34
80	300759	康龙化成	573,675	14,077,984.50	0.32
81	002600	领益智造	1,610,000	13,829,900.00	0.32
82	000301	东方盛虹	1,660,181	13,829,307.73	0.32
83	000596	古井贡酒	93,331	12,427,022.65	0.29
84	002938	鹏鼎控股	381,400	12,216,242.00	0.28
85	002459	晶澳科技	1,217,692	12,152,566.16	0.28
86	000617	中油资本	1,655,940	12,088,362.00	0.28
87	000999	华润三九	379,366	11,866,568.48	0.27
88	300832	新产业	202,800	11,502,816.00	0.27
89	000002	万 科 A	1,780,105	11,428,274.10	0.26
90	300628	亿联网络	312,860	10,875,013.60	0.25
91	300316	晶盛机电	384,200	10,431,030.00	0.24
92	300999	金龙鱼	323,214	9,544,509.42	0.22
93	000876	新 希 望	976,624	9,160,733.12	0.21
94	300413	芒果超媒	402,260	8,777,313.20	0.20
95	000708	中信特钢	553,898	6,513,840.48	0.15
96	300979	华利集团	99,814	5,247,221.98	0.12
97	000983	山西焦煤	772,770	4,945,728.00	0.11
98	001872	招商港口	97,100	1,928,406.00	0.04
99	001289	龙源电力	37,200	601,896.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301458	钧崑电子	701	23,911.11	0.00
2	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
3	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
4	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
5	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
6	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
7	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
8	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
9	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
10	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
11	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
12	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
13	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
14	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
15	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00

16	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
17	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
18	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
19	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
20	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
21	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
22	001335	信凯科技	80	2,244.00	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	302132	中航成飞	14,387,891.00	0.32
2	002600	领益智造	13,474,110.00	0.30
3	300442	润泽科技	13,329,674.00	0.29
4	002028	思源电气	10,749,197.00	0.24
5	300394	天孚通信	6,844,440.00	0.15
6	000975	山金国际	2,931,884.00	0.06
7	001965	招商公路	2,428,399.00	0.05
8	301275	汉朔科技	108,982.50	0.00
9	301501	恒鑫生活	96,087.44	0.00
10	301458	钧崴电子	72,852.00	0.00
11	301590	优优绿能	65,318.40	0.00
12	301479	弘景光电	54,302.40	0.00
13	301658	首航新能	51,554.20	0.00
14	301678	新恒汇	48,857.60	0.00
15	301173	毓恬冠佳	48,840.92	0.00
16	301602	超研股份	44,086.00	0.00
17	301636	泽润新能	42,085.38	0.00
18	301601	惠通科技	40,320.60	0.00
19	301665	泰禾股份	40,278.94	0.00
20	301662	宏工科技	38,011.40	0.00

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	002129	TCL 中环	15,198,165.00	0.33
2	002709	天赐材料	14,701,731.54	0.32
3	002180	纳思达	13,104,702.00	0.29
4	300750	宁德时代	10,978,809.00	0.24
5	002304	洋河股份	8,972,868.00	0.20
6	002594	比亚迪	7,694,201.00	0.17
7	000983	山西焦煤	5,529,286.00	0.12

8	300124	汇川技术	5,278,733.00	0.12
9	000063	中兴通讯	3,975,597.00	0.09
10	002475	立讯精密	3,504,763.00	0.08
11	000651	格力电器	3,160,225.00	0.07
12	000001	平安银行	3,001,051.00	0.07
13	000338	潍柴动力	2,942,986.00	0.06
14	002230	科大讯飞	2,910,372.00	0.06
15	300308	中际旭创	2,848,707.00	0.06
16	002352	顺丰控股	2,847,200.00	0.06
17	300498	温氏股份	2,743,387.00	0.06
18	000776	广发证券	2,689,293.00	0.06
19	002049	紫光国微	2,585,188.00	0.06
20	000157	中联重科	2,569,285.00	0.06

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	65,124,769.16
卖出股票收入（成交）总额	163,253,436.09

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

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规定的备选股票库

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	55,134.74
2	应收清算款	31,331.66
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	428,036.26
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	514,502.66

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	301458	钧崑电子	23,911.11	0.00	首发流通受限
2	301275	汉朔科技	22,307.43	0.00	首发流通受限
3	301678	新恒汇	17,014.28	0.00	首发流通受限
4	301602	超研股份	16,318.40	0.00	首发流通受限
5	301501	恒鑫生活	15,827.00	0.00	首发流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
融通深证 100 指数 A/B	230,428	14,294.51	30,740,912.07	0.93	3,263,114,888.32	99.07
融通深证 100 指数 C	2,763	5,760.90	—	—	15,917,365.11	100.00
合计	233,191	14,193.40	30,740,912.07	0.93	3,279,032,253.43	99.07

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通深证 100 指数 A/B	1,486,158.91	0.04512
	融通深证 100 指数 C	1,601.44	0.01006
	合计	1,487,760.35	0.04495

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	融通深证 100 指数 A/B	50~100
	融通深证 100 指数 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	融通深证 100 指数 A/B	10~50
	融通深证 100 指数 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C
基金合同生效日（2003 年 9 月 30 日）基金份额总额	477,689,377.16	—
本报告期期初基金份额总额	3,384,914,971.03	17,059,073.08
本报告期基金总申购份额	129,320,679.75	6,681,246.33
减：本报告期基金总赎回份额	220,379,850.39	7,822,954.30
本报告期基金拆分变动份额	—	—

本报告期期末基金份额总额	3,293,855,800.39	15,917,365.11
--------------	------------------	---------------

§ 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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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(%)	
国泰海通证券	2	185,549,187.86	81.60	34,493.98	81.60	—
诚通证券	2	41,339,119.84	18.18	7,684.80	18.18	—
中信证券	1	164,023.17	0.07	30.49	0.07	—
中信建投	1	155,535.84	0.07	28.90	0.07	—
天风证券	1	148,861.38	0.07	27.66	0.07	—

华泰证券	1	42,303.00	0.02	7.87	0.02	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	1	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司交易单元的标准为：

（1）券商财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易等服务能力较强，同时拥有良好的公司声誉。

（2）券商研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的人员，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。

（3）严禁将券商选择、交易单元租用、交易量分配等与基金销售规模、保有规模挂钩，严禁以任何形式向券商承诺基金证券交易量及佣金或利用交易佣金与券商进行利益交换。

（4）公司销售业务人员不得参与券商选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

（5）公司不得使用交易佣金向第三方转移支付费用，包括但不限于使用外部专家咨询、金融终端、研报平台、数据库等产生的费用。

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，本基金新增华源证券和中信建投证券交易单元各 1 个，国泰君安证券和海通证券合并变更为国泰海通证券。

10.7.2 基金租用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 (%)
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通通利系列证券投资基金之融通深证 100 指数证券投资基金第二十八次	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 10 日

	分红公告		
2	融通基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 2 月 28 日
3	融通基金关于旗下部分开放式基金在中国工商银行股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 1 日
4	融通基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 14 日
5	关于旗下部分开放式基金新增国泰君安证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 17 日
6	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	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 31 日
7	融通基金关于旗下部分开放式基金新增中国邮政储蓄银行股份有限公司“邮你同赢”平台为销售机构及开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 3 日
8	融通基金管理有限公司关于系统升级期间暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 16 日
9	融通基金管理有限公司关于提醒投资者警惕虚假网站和 APP 的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 26 日
10	融通基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 5 日
11	融通基金关于旗下部分开放式基金新增华西证券股份有限公司为销售机构及开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 16 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通利系列证券投资基金设立的文件
- （二）《融通通利系列证券投资基金基金合同》

- (三)《融通通利系列证券投资基金托管协议》
- (四)《融通通利系列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

2025 年 8 月 28 日