# 融通深证成份指数证券投资基金

# 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 26 日

## §1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 融通深证成份指数 | |
| 基金主代码 | 161612 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2010 年 11 月 15 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 79,134,431.03 份 | |
| 投资目标 | 本基金采取完全复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内，以实现对深证成份指数的有效跟踪。 | |
| 投资策略 | 本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制指数的投资策略，按照成份股在标的指数中的基准权重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，力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在 0.35%以内、年化跟踪误差控制在 4%的投资目标。 | |
| 业绩比较基准 | 深证成份指数收益率×95%+银行活期存款利率×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型指数基金，属于高风险高收益的基金品种，其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 融通基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 融通深证成份指数 A/B | 融通深证成份指数 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 161612 | 004875 |
| 下属分级基金的前端交易代码 | 161612 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 下属分级基金的后端交易代码 | 161662 | - |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 59,193,328.40 份 | 19,941,102.63 份 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日） | |
|---|---|---|
| | 融通深证成份指数 A/B | 融通深证成份指数 C |
| 1.本期已实现收益 | 1,139,044.10 | 329,555.45 |
| 2.本期利润 | -16,894,778.22 | -5,090,046.06 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.2871 | -0.2774 |
| 4.期末基金资产净值 | 74,017,719.60 | 25,259,968.41 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.250 | 1.267 |

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

融通深证成份指数 A/B

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -18.99% | 1.85% | -19.50% | 1.88% | 0.51% | -0.03% |
| 过去六个月 | -2.42% | 1.76% | -4.06% | 1.79% | 1.64% | -0.03% |
| 过去一年 | -2.70% | 1.53% | -4.33% | 1.55% | 1.63% | -0.02% |
| 过去三年 | 35.31% | 1.48% | 26.56% | 1.51% | 8.75% | -0.03% |
| 过去五年 | -0.99% | 1.36% | -8.83% | 1.38% | 7.84% | -0.02% |
| 过去七年 | 63.06% | 1.39% | 35.66% | 1.39% | 27.40% | 0.00% |
| 过去十年 | 59.59% | 1.35% | 22.38% | 1.34% | 37.21% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 36.89% | 1.50% | 3.79% | 1.47% | 33.10% | 0.03% |

融通深证成份指数 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -19.04% | 1.85% | -19.50% | 1.88% | 0.46% | -0.03% |
| 过去六个月 | -2.61% | 1.76% | -4.06% | 1.79% | 1.45% | -0.03% |
| 过去一年 | -3.02% | 1.53% | -4.33% | 1.55% | 1.31% | -0.02% |
| 过去三年 | 33.74% | 1.48% | 26.56% | 1.51% | 7.18% | -0.03% |
| 过去五年 | -2.90% | 1.36% | -8.83% | 1.38% | 5.93% | -0.02% |
| 过去七年 | 58.71% | 1.39% | 35.66% | 1.39% | 23.05% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 50.08% | 1.38% | 22.40% | 1.38% | 27.68% | 0.00% |

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

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






注：本基金于 2017 年 7 月 5 日增设 C 类份额，C 类份额首次确认日为 2017 年 7 月 6 日，故本基金 C 类份额的统计区间为 2017 年 7 月 6 日至本报告期末。

### 3.3 其他指标

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 蔡志伟 | 本基金的基金经理 | 2016 年 11 月 19 日 | - | 15 年 | 蔡志伟先生，计算机应用技术硕士，金融风险管理师（FRM），15 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2006 年 7 月至 2008 年 8 月就职于汇丰软件开发(广东)有限公司任高级软件工程师。2011 年 6 月加入融通基金管理有限公司，历任风险管理专员、金融工程研究员、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)基金经理、融通深证成份指数证券投资基金基金经理、融通创业板指数增强型证券投资基金基金经理、融通创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通中证诚通央企 ESG 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通创业板交易型开放式 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 指数证券投资基金发起式联接基金基金经理、融通中证诚通央企红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通中证诚通央企红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、融通中证诚通央企 ESG 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。 |

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**

本基金跟踪的标的指数为深证成指，深证成指为深市标尺指数，选取深交所市场市值大、流动性好的 500 家公司作为样本，指数历史悠久，代表性充分，充分刻画深交所多层次市场特色，反映深市整体运行情况。深证成指代表中国新兴成长性企业，已成为中国证券市场最重要的标尺指数之一。

2026 年第三季度，报告期内 A 股市场总体呈现大幅震荡调整，深证成指季度下跌 20.47%，主要受全球科技股去杠杆、前期 AI 交易拥挤集中出清影响；行业层面，银行、煤炭、石油石化三季

度领涨，电子、通信跌幅较大。

展望第四季度，宏观层面，8 月规模以上工业增加值同比增长 5.2%，较 7 月加快 0.7 个百分点，1-8 月累计增长 5.3%；9 月制造业 PMI 回升至 50.1%，景气水平总体回升。但 1-8 月社会消费品零售总额仅增长 1.1%，内需恢复仍偏弱。9 月末国务院常务会议部署一批务实管用的增量政策，用好地方政府债务结存限额；央行三季度例会重申适度宽松、加大逆周期调节，降准降息等总量工具仍有望适时跟进，政策底进一步夯实。

A 股市场层面，经过第三季度充分调整，科技板块杠杆资金和拥挤交易已大部分出清，指数继续大幅下行空间有限，高股息权重与中长期入市资金形成托底。四季度或将迎来三季报业绩验证、年底中央经济工作会议政策定调等窗口，市场大概率从上半年的“科技独舞”转向区间震荡、行业均衡格局，投资方向围绕“红利底仓”与“科技创新”两条主线，哑铃型组合有望获得更稳健回报。

从板块和行业层面来看，深证成指行业分布均衡，既涵盖电子、计算机、医药生物等科技成长方向，也包含家电、汽车、食品饮料等制造与消费龙头，能够充分受益于市场风格再平衡。科技方向重点关注 AI 产业景气下沉带来的端侧算力芯片、AI 应用、半导体产业链机会，以及人形机器人量产主题；顺周期方向关注创新药、汽车整车、家电等受益于内需政策和出海逻辑板块的估值修复，同时重视银行等高股息资产的底仓配置价值。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持采用指数化投资策略，在基金申赎变动和指数成分股权重调整时，采用指数复制和数量化投资技术降低冲击成本和减少跟踪误差，力求紧密跟踪标的指数。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通深证成份指数 A/B 基金份额净值为 1.250 元，本报告期基金份额净值增长率为-18.99%，同期业绩比较基准收益率为-19.50%；

截至本报告期末融通深证成份指数 C 基金份额净值为 1.267 元，本报告期基金份额净值增长率为-19.04%，同期业绩比较基准收益率为-19.50%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 92,177,030.36 | 91.98 |
| | 其中：股票 | 92,177,030.36 | 91.98 |
| 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 | 7,839,459.35 | 7.82 |
| 8 | 其他资产 | 200,464.29 | 0.20 |
| 9 | 合计 | 100,216,954.00 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,313,421.11 | 1.32 |
| B | 采矿业 | 1,124,764.52 | 1.13 |
| C | 制造业 | 73,292,487.49 | 73.83 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 947,667.00 | 0.95 |
| E | 建筑业 | 123,858.00 | 0.12 |
| F | 批发和零售业 | 767,645.60 | 0.77 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 989,027.00 | 1.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,732,914.56 | 4.77 |
| J | 金融业 | 5,693,139.47 | 5.73 |
| K | 房地产业 | 490,645.22 | 0.49 |
| L | 租赁和商务服务业 | 888,427.92 | 0.89 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 669,278.25 | 0.67 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 119,850.00 | 0.12 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 64,935.00 | 0.07 |
| Q | 卫生和社会工作 | 330,661.70 | 0.33 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 370,931.00 | 0.37 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 91,919,653.84 | 92.59 |

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 8,556.46 | 0.01 |
| C | 制造业 | 219,128.20 | 0.22 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 29,691.86 | 0.03 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| 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 | - | - |
| 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 | 257,376.52 | 0.26 |

**5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合**

无。

**5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细**

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 16,360 | 4,762,559.60 | 4.80 |
| 2 | 300308 | 中际旭创 | 5,188 | 4,194,186.72 | 4.22 |
| 3 | 300502 | 新易盛 | 8,048 | 3,130,672.00 | 3.15 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 32,003 | 2,563,440.30 | 2.58 |
| 5 | 002475 | 立讯精密 | 31,357 | 1,549,976.51 | 1.56 |
| 6 | 002371 | 北方华创 | 2,435 | 1,499,886.95 | 1.51 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 82,869 | 1,474,239.51 | 1.48 |
| 8 | 002384 | 东山精密 | 8,250 | 1,381,050.00 | 1.39 |
| 9 | 002594 | 比亚迪 | 15,932 | 1,327,294.92 | 1.34 |
| 10 | 000725 | 京东方 A | 211,398 | 1,209,196.56 | 1.22 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 301666 | 大普微 | 148 | 49,008.72 | 0.05 |
| 2 | 001246 | 力勤资源 | 566 | 34,290.94 | 0.03 |
| 3 | 001248 | 华润新能源 | 3,179 | 29,691.86 | 0.03 |
| 4 | 301660 | 粤芯半导体 | 2,363 | 28,379.63 | 0.03 |
| 5 | 301569 | 联亚药业 | 2,901 | 20,307.00 | 0.02 |

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

无。

**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

无。

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

无。

**5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

无。

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

无。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

无。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**5.10.1 本期国债期货投资政策**

无。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

无。

**5.10.3 本期国债期货投资评价**

无。

## 5.11 投资组合报告附注

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

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

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

无。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 8,351.81 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 192,112.48 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 200,464.29 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 301666 | 大普微 | 49,008.72 | 0.05 | 首发流通受限 |
| 2 | 001248 | 华润新能源 | 29,691.86 | 0.03 | 首发流通受限 |
| 3 | 301660 | 粤芯半导体 | 28,379.63 | 0.03 | 首发流通受限 |
| 4 | 301569 | 联亚药业 | 20,307.00 | 0.02 | 首发流通受限 |
| 5 | 001246 | 力勤资源 | 8,515.30 | 0.01 | 首发流通受限 |

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 融通深证成份指数 A/B | 融通深证成份指数 C |
| --- | --- | --- |
| 报告期期初基金份额总额 | 56,799,228.27 | 16,118,199.86 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 7,473,547.65 | 17,714,602.56 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 5,079,447.52 | 13,891,699.79 |
| 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 | 59,193,328.40 | 19,941,102.63 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准融通深证成份指数证券投资基金设立的文件

（二）《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》

（三）《融通深证成份指数证券投资基金托管协议》

（四）《融通深证成份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

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

## 9.3 查阅方式

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

**融通基金管理有限公司**

**2026 年 10 月 26 日**