融通中证港股通科技指数证券投资基金

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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	融通中证港股通科技指数	
基金主代码	021891	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 11 月 12 日	
报告期末基金份额总额	68,251,112.09 份	
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。	
投资策略	本基金投资策略主要包括股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略等部分。	
业绩比较基准	中证港股通科技指数（人民币）收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	融通中证港股通科技指数 A	融通中证港股通科技指数 C
下属分级基金的交易代码	021891	021892
报告期末下属分级基金的份额总额	33,216,939.00 份	35,034,173.09 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）	
	融通中证港股通科技指数 A	融通中证港股通科技指数 C
1.本期已实现收益	-455,269.95	-510,716.09
2.本期利润	-418,394.24	-370,116.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0127	-0.0105
4.期末基金资产净值	31,678,498.77	33,302,111.83
5.期末基金份额净值	0.9537	0.9506

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通中证港股通科技指数 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-1.19%	1.49%	-0.91%	1.48%	-0.28%	0.01%
过去六个月	-7.68%	1.59%	-7.41%	1.55%	-0.27%	0.04%
过去一年	-33.58%	1.60%	-33.45%	1.57%	-0.13%	0.03%
自基金合同生效起至今	-4.63%	1.77%	1.83%	1.87%	-6.46%	-0.10%

融通中证港股通科技指数 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	-1.24%	1.49%	-0.91%	1.48%	-0.33%	0.01%
过去六个月	-7.76%	1.59%	-7.41%	1.55%	-0.35%	0.04%
过去一年	-33.71%	1.60%	-33.45%	1.57%	-0.26%	0.03%
自基金合同	-4.95%	1.77%	1.83%	1.87%	-6.78%	-0.10%

生效起至今						

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





3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

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

何博	本基金的基金经理	2024 年 11 月 12 日	-	14 年	何博女士，上海财经大学金融学硕士，14 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入融通基金管理有限公司，历任 QDII 研究员、国际业务部专户投资经理、融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金经理、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金经理、融通中证港股通科技指数证券投资基金基金经理。

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

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年第三季度，港股市场呈现先扬后抑走势，指数间表现明显分化，科技风格相对承压。报告期内，恒生指数上涨 7.57%，恒生中国企业指数上涨 8.76%，中证港股通科技指数(CNY)下跌 1%。7 月，全球 AI 算力叙事阶段性承压，叠加杠杆资金去化，全球 AI 基建板块整体回调，前期在日韩、美股、A 股 AI 硬件链拥挤交易的部分资金转向港股再平衡，港股凭借低估值与相对较低

的 AI 硬件敞口，逆势成为资金避风港，叠加部分空头回补，显著反弹；8 月以来，长端美债收益率维持高位震荡，刷新逾 2019 年高位，8 月中下旬进入中报密集验证期，部分龙头公司业绩不及预期，加剧市场波动；9 月美联储加息落地，港股科技成长风格遭遇分母端逆风，板块持续走弱。

港股作为典型离岸市场，同时承受全球资本与中国资产的双重影响。外部环境方面，中东地缘冲突反复，国际油价于 9 月初再度突破 100 美元/桶，强化全球二次通胀担忧，美联储 9 月议息会议将联邦基金利率目标区间上调 25 个基点，为 2023 年 7 月以来首次加息，在“更高更久”的基调下，科技成长风格的估值弹性受限。内部环境方面，国内经济处于低位修复，核心 CPI 涨幅仍偏低，内需修复强度相对有限，社零仅小幅改善，消费回暖仍有待更强政策驱动，以及就业与收入端的进一步修复，与之相对，以 AI 为代表的外需制造链保持韧性。反映在上市公司盈利层面，AI 产业链利润当前仍集中在上游硬件环节，平台与应用侧受资本开支前置影响，利润兑现节奏偏慢，并对现金流构成一定压力。

尽管短期市场受外部利率压制，港股科技板块中长期配置价值仍较明确，经历前期调整，估值分位偏低，横向对比全球主要市场仍属洼地；AI 产业趋势明确，北美龙头 CSP 财报验证云计算高景气与盈利能力，AI 商业化路径逐步清晰，国内大模型迭代与应用落地加速。

中证港股通科技指数从港股通范围内选取 50 只市值较大、研发投入较高且营收增速较好的科技龙头上市公司证券作为指数样本，以反映港股通内科技龙头上市公司证券的整体表现。本基金以指数化投资为目标，通过紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。基金管理人将通过跟踪误差分析系统及指数基金运作监控，力争实现对标的指数的有效跟踪，并认真完成基金日常申赎的应对工作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通中证港股通科技指数 A 基金份额净值为 0.9537 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.19%，同期业绩比较基准收益率为-0.91%；

截至本报告期末融通中证港股通科技指数 C 基金份额净值为 0.9506 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.24%，同期业绩比较基准收益率为-0.91%。

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	61,403,695.56	93.86
	其中：股票	61,403,695.56	93.86
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	3,967,263.48	6.06
8	其他资产	51,162.57	0.08
9	合计	65,422,121.61	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 61,403,695.56 元，占基金资产净值比例为 94.50%。

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

无。

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

无。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
房地产	-	-
能源	-	-
材料	-	-
工业	444,721.65	0.68
非必需消费品	14,624,190.77	22.51
必需消费品	963,044.23	1.48
医疗保健	9,828,007.66	15.12
金融	-	-
科技	20,454,945.98	31.48
通讯	15,088,785.27	23.22
公用事业	-	-
政府	-	-
合计	61,403,695.56	94.50

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

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	00700	腾讯控股	16,800	6,215,647.54	9.57
2	03690	美团-W	98,200	6,044,083.71	9.30
3	01810	小米集团-W	273,800	5,932,293.40	9.13
4	09988	阿里巴巴-W	63,600	5,819,881.58	8.96
5	00981	中芯国际	83,500	4,347,274.95	6.69
6	01211	比亚迪股份	63,600	4,127,420.71	6.35
7	00992	联想集团	126,000	3,735,878.18	5.75
8	02269	药明生物	71,500	3,440,182.53	5.29
9	01801	信达生物	30,000	2,525,042.43	3.89
10	00175	吉利汽车	112,000	1,398,881.23	2.15

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

无。

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地参与股指期货交易。套期保值

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

5.10 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

本基金的国债期货交易将以风险管理为原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	8,622.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	42,540.57
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	51,162.57

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

无。

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	融通中证港股通科技指数 A	融通中证港股通科技指数 C
报告期期初基金份额总额	32,801,406.45	40,659,983.90
报告期期间基金总申购份额	2,412,980.05	2,311,567.35
减:报告期期间基金总赎回份额	1,997,447.50	7,937,378.16
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	33,216,939.00	35,034,173.09

§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）中国证监会准予融通中证港股通科技指数证券投资基金注册的文件

（二）《融通中证港股通科技指数证券投资基金基金合同》

（三）《融通中证港股通科技指数证券投资基金托管协议》

（四）《融通中证港股通科技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