# 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

# 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

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”）2026 年度第 3 季度报告。

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 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 2,387,843,338.67 份 | |
| 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 | |
| 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 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 | 2,379,701,375.50份 | 8,141,963.17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100指数A/B | 融通深证100指数C |
| 1.本期已实现收益 | 37,932,681.11 | 107,268.55 |
| 2.本期利润 | -955,075,999.17 | -2,946,265.03 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.4001 | -0.3740 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,771,209,409.23 | 12,432,430.94 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.585 | 1.527 |

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100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 | -20.15% | 1.88% | -19.48% | 1.85% | -0.67% | 0.03% |
| 过去六个月 | -3.06% | 1.80% | -2.51% | 1.77% | -0.55% | 0.03% |
| 过去一年 | -6.66% | 1.52% | -5.89% | 1.51% | -0.77% | 0.01% |
| 过去三年 | 24.67% | 1.45% | 27.98% | 1.46% | -3.31% | -0.01% |
| 过去五年 | -12.84% | 1.36% | -8.77% | 1.36% | -4.07% | 0.00% |
| 过去七年 | 38.26% | 1.40% | 46.41% | 1.40% | -8.15% | 0.00% |
| 过去十年 | 53.46% | 1.37% | 70.11% | 1.37% | -16.65% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 481.52% | 1.63% | 665.12% | 1.61% | -183.60% | 0.02% |

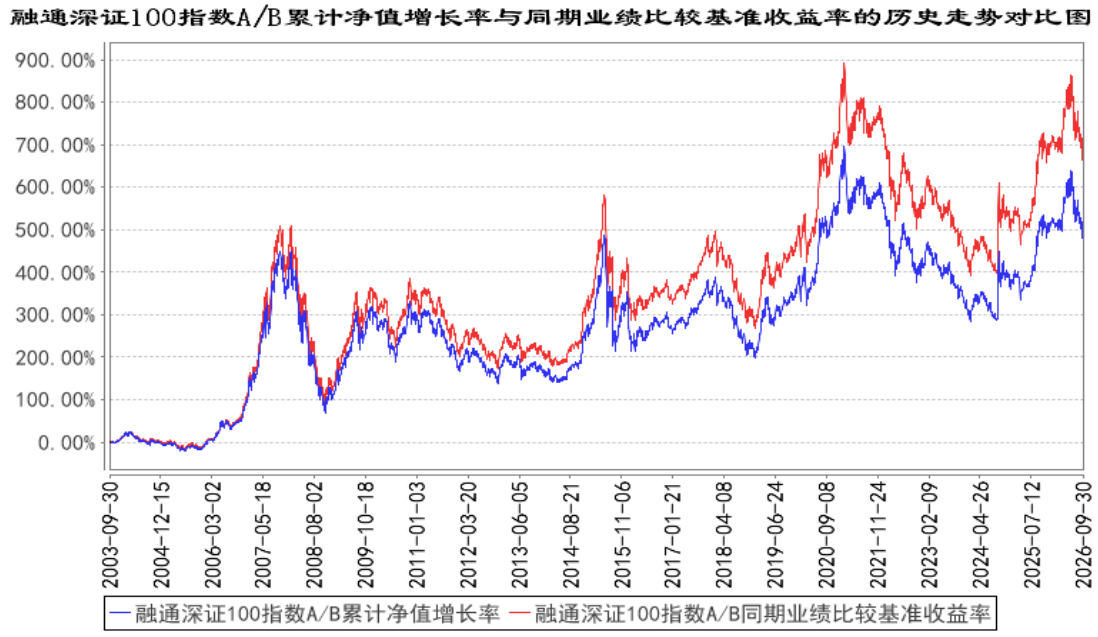
融通深证100指数C

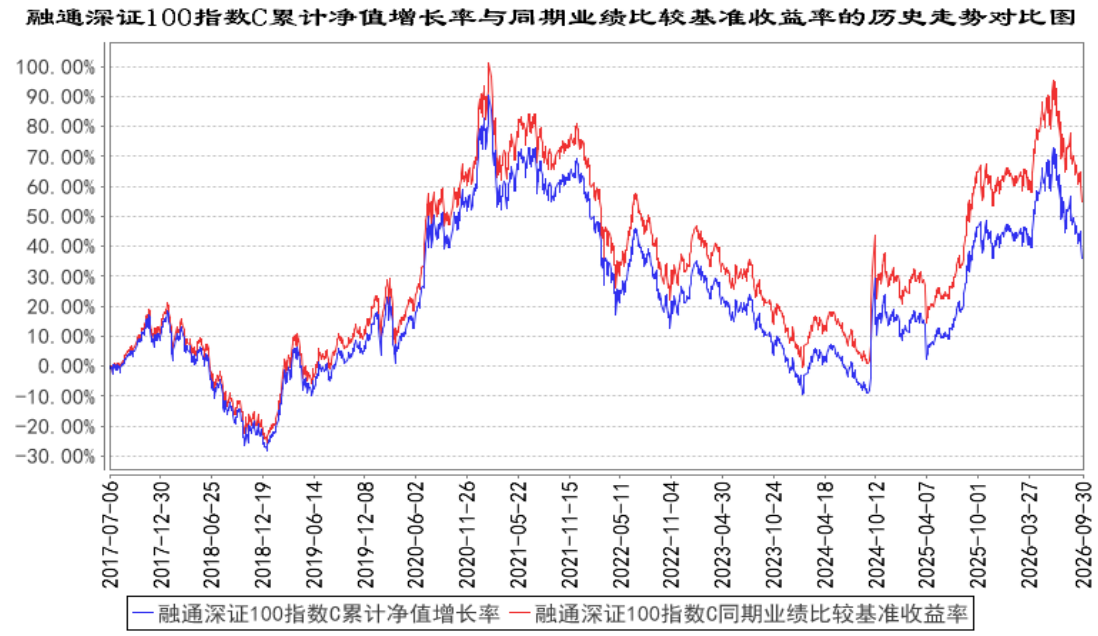
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -20.22% | 1.87% | -19.48% | 1.85% | -0.74% | 0.02% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去六个月 | -3.23% | 1.79% | -2.51% | 1.77% | -0.72% | 0.02% |
| 过去一年 | -7.06% | 1.52% | -5.89% | 1.51% | -1.17% | 0.01% |
| 过去三年 | 23.11% | 1.45% | 27.98% | 1.46% | -4.87% | -0.01% |
| 过去五年 | -14.57% | 1.36% | -8.77% | 1.36% | -5.80% | 0.00% |
| 过去七年 | 34.41% | 1.40% | 46.41% | 1.40% | -12.00% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 35.97% | 1.41% | 55.05% | 1.40% | -19.08% | 0.01% |

注：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。

### 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：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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 何天翔 | 本基金的基金经理、指数与量化投资部总经理 | 2014年10月25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。 |

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

本报告期内，本基金标的指数深证100指数收益率为-20.45%，整体呈现下行走势，成交量有所收缩，但成交活跃度仍较好。市场整体呈现震荡下行态势，其中沪深300指数收益率-12.49%，中证500指数收益率-17.67%，市场交易活跃度仍保持较高水平。

行业方面，煤炭、石油石化、农林牧渔、银行、医药生物等行业指数涨幅较大，电子、通信、建筑材料、电力设备、机械设备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，科技和消费占比较高，期末前五大权重行业分别为电子、通信、电力设备、家用电器、计算机。

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指数成分股自然权重的偏离，有效控制跟踪误差，为投资者提供一个投资深证100指数的有效工具。我们通过算法交易系统、跟踪误差分析系统、自建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0.04%，年化跟踪误差为0.47%，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，无成分股定期调整，无长期停牌成分股，不涉及上述情形引起的投资操作调整，对跟踪误差亦无影响。

### 4.5 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1.585元，本报告期基金份额净值增长率为-20.15%，同期业绩比较基准收益率为-19.48%；

截至本报告期末融通深证100指数C基金份额净值为1.527元，本报告期基金份额净值增长率为-20.22%，同期业绩比较基准收益率为-19.48%。

### 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 | 3,565,904,749.54 | 94.06 |
| | 其中：股票 | 3,565,904,749.54 | 94.06 |
| 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 | 223,775,096.16 | 5.90 |
| 8 | 其他资产 | 1,579,832.86 | 0.04 |
| 9 | 合计 | 3,791,259,678.56 | 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 | 76,170,794.61 | 2.01 |
| B | 采矿业 | 21,139,026.00 | 0.56 |
| C | 制造业 | 2,994,251,037.90 | 79.14 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,683,075.00 | 0.36 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 8,966,077.38 | 0.24 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 41,469,133.58 | 1.10 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 99,011,803.34 | 2.62 |
| J | 金融业 | 270,761,475.19 | 7.16 |
| K | 房地产业 | 6,119,728.16 | 0.16 |
| L | 租赁和商务服务业 | 20,930,642.59 | 0.55 |
| 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 | 11,522,186.34 | 0.30 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
|  | 合计 | 3,564,024,980.09 | 94.20 |

### 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 | - | - |
| C | 制造业 | 1,329,895.63 | 0.04 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 549,873.82 | 0.01 |
| 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 | 1,879,769.45 | 0.05 |

**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 | 1,083,046 | 315,285,521.06 | 8.33 |
| 2 | 300308 | 中际旭创 | 358,939 | 290,180,645.16 | 7.67 |
| 3 | 300502 | 新易盛 | 515,320 | 200,459,480.00 | 5.30 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 2,016,470 | 161,519,247.00 | 4.27 |
| 5 | 002371 | 北方华创 | 168,060 | 103,519,918.20 | 2.74 |
| 6 | 002475 | 立讯精密 | 1,983,522 | 98,045,492.46 | 2.59 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 5,395,173 | 95,980,127.67 | 2.54 |
| 8 | 002594 | 比亚迪 | 1,048,935 | 87,386,774.85 | 2.31 |
| 9 | 002384 | 东山精密 | 519,000 | 86,880,600.00 | 2.30 |
| 10 | 000725 | 京东方A | 13,616,603 | 77,886,969.16 | 2.06 |

**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 | 001248 | 华润新能源 | 58,873 | 549,873.82 | 0.01 |
| 2 | 301666 | 大普微 | 1,220 | 403,990.80 | 0.01 |
| 3 | 301660 | 粤芯半导体 | 28,853 | 346,524.53 | 0.01 |
| 4 | 001399 | 惠科股份 | 6,488 | 126,580.88 | 0.00 |
| 5 | 001246 | 力勤资源 | 2,178 | 109,096.02 | 0.00 |

**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 | 131,894.35 |
| 2 | 应收证券清算款 | 386,897.80 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,061,040.71 |

| | | |
|---|---|---|
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,579,832.86 |

### 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 | 001248 | 华润新能源 | 549,873.82 | 0.01 | 首发流通受限 |
| 2 | 301666 | 大普微 | 403,990.80 | 0.01 | 首发流通受限 |
| 3 | 301660 | 粤芯半导体 | 346,524.53 | 0.01 | 首发流通受限 |
| 4 | 001399 | 惠科股份 | 126,580.88 | 0.00 | 首发流通受限 |
| 5 | 001246 | 力勤资源 | 109,096.02 | 0.00 | 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100指数A/B | 融通深证100指数C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,406,084,481.00 | 7,281,808.19 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 59,910,518.66 | 3,248,283.03 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 86,293,624.16 | 2,388,128.05 |
| 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 | 2,379,701,375.50 | 8,141,963.17 |

## §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

### 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**