

融通深证成份指数证券投资基金

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

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深证成份指数证券投资基金（以下简称“本基金”）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 基金管理人及基金托管人	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	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	17
§ 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	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通深证成份指数证券投资基金	
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	
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	89,675,755.92 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	77,455,253.81 份	12,220,502.11 份

2.2 基金产品说明

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。

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	证券时报
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、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)	
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C
本期已实现收益	821,169.98	99,651.91
本期利润	1,705,367.46	243,132.93
加权平均基金份额本期利润	0.0213	0.0192
本期加权平均净值利润率	2.13%	1.92%
本期基金份额净值增长率	2.13%	1.97%
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	1,959,673.44	330,908.41
期末可供分配基金份额利润	0.0253	0.0271
期末基金资产净值	79,414,927.25	12,551,410.52
期末基金份额净值	1.025	1.027
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	9.65%	20.78%

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

融通深证成份指数 A/B

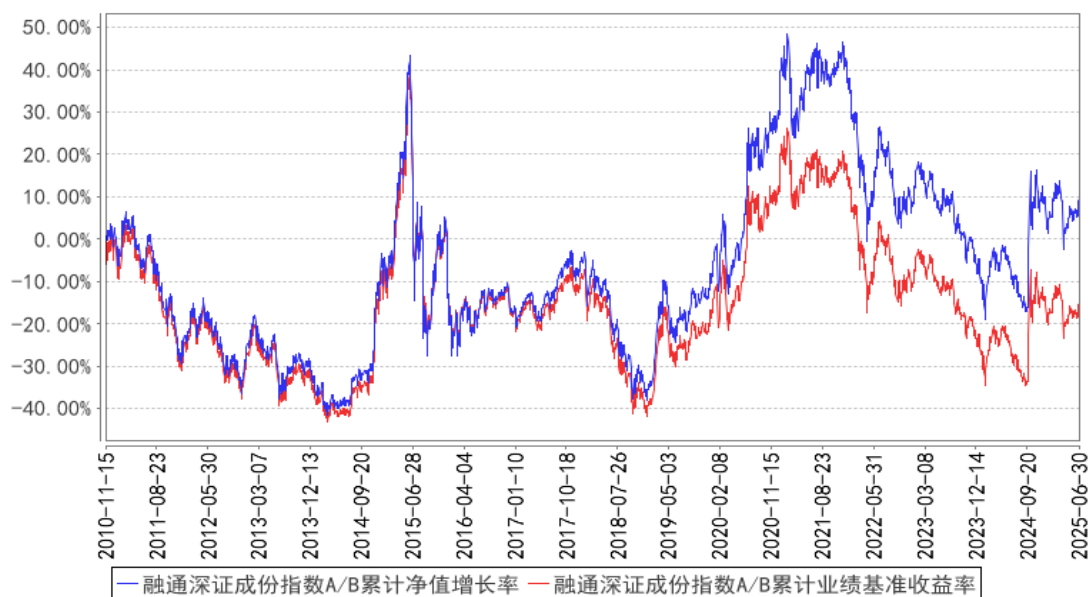
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.81%	0.76%	4.02%	0.76%	0.79%	0.00%
过去三个月	0.79%	1.44%	-0.31%	1.44%	1.10%	0.00%
过去六个月	2.13%	1.31%	0.53%	1.32%	1.60%	-0.01%
过去一年	20.92%	1.68%	17.52%	1.73%	3.40%	-0.05%
过去三年	-12.57%	1.30%	-17.68%	1.33%	5.11%	-0.03%
自基金合同生效起至今	9.65%	1.50%	-15.00%	1.47%	24.65%	0.03%

融通深证成份指数 C

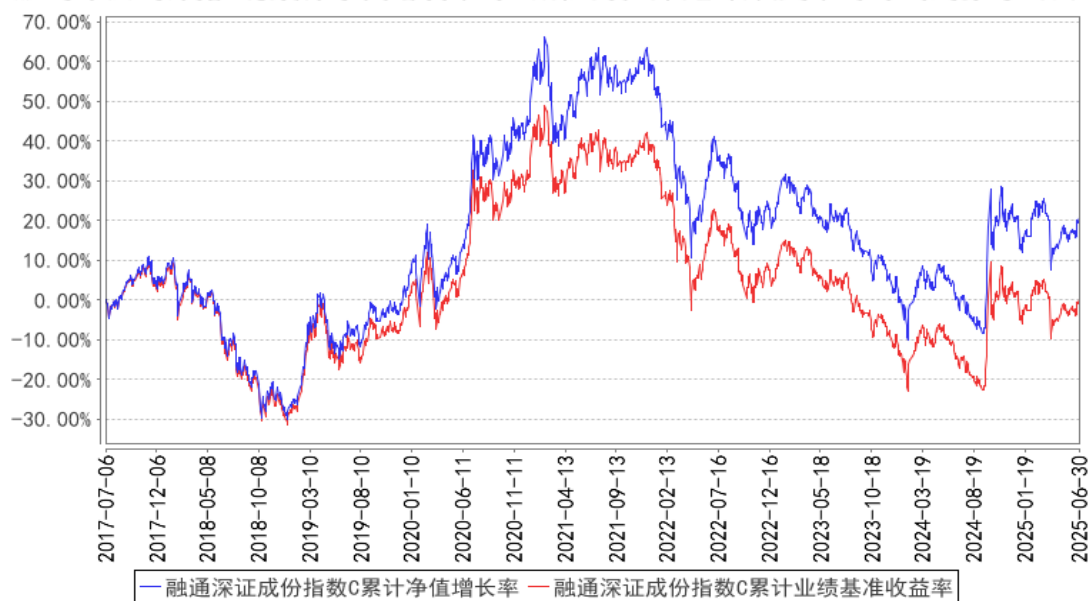
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.80%	0.77%	4.02%	0.76%	0.78%	0.01%
过去三个月	0.69%	1.45%	-0.31%	1.44%	1.00%	0.01%
过去六个月	1.97%	1.32%	0.53%	1.32%	1.44%	0.00%
过去一年	20.36%	1.68%	17.52%	1.73%	2.84%	-0.05%
过去三年	-13.53%	1.30%	-17.68%	1.33%	4.15%	-0.03%
自基金合同生效起至今	20.78%	1.37%	0.23%	1.36%	20.55%	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

融通深证成份指数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



融通深证成份指数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：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	-	14 年	蔡志伟先生，计算机应用技术硕士，金融风险管理师（FRM），14 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。

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。报告期内，本基金主要采取指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

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。

4.4.2 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 1.025 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.13%，同期业绩比较基准收益率为 0.53%；

截至本报告期末融通深证成份指数 C 基金份额净值为 1.027 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.97%，同期业绩比较基准收益率为 0.53%。

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 2025 年上半年，4 月在美国对等关税的极限施压下，中国进行了坚决的反制，迫使中美关税博弈走向缓和，并于 5 月日内瓦经贸会谈中破冰，6 月启动伦敦磋商机制。A 股市场层面，上半年 A 股市场呈现出典型的“N 型”走势，经受住了极限的外部冲击，表现出了强大的韧性；市场整体在国内政策托底+科技突围的驱动下逐步企稳，最终上半年上证指数上涨 2.76%。

展望下半年，海外方面随着中美经贸缓和，伦敦磋商的开启，以及美国内部分歧的加大，预计年内最大的外部风险边际弱化。国内方面，2024 年底中央经济工作会议以及 2025 年 4 月的政治局会议，均明确了货币和财政政策双宽松的总体政策基调，政策着力稳股市、稳楼市、“大力提振消费”，积极推动经济复苏。随着政策在二季度提速落地，预计 2025 年下半年经济有望筑底回升。

A 股市场层面，预计在政策加码落地的背景下，下半年市场整体有望呈现震荡上行的趋势，市场核心宽基指数预计将窄幅震荡，在指数企稳下，市场风险偏好有望得到较好的修复，市场或迎来较好的结构性机会窗口期。市场的投资方向上，预计主要集中在“科技创新”与“红利”类资产两大领域，对两类资产进行哑铃策略的组合有望获得较好的回报。

从行业层面来看，数字经济是今明两年的主线，AI 为新一轮科技周期的重要方向，中长期具备战略配置属性；重点关注在 DeepSeek 技术突破的推动下，国产自主可控的 AI 算力板块以及 AI 应用板块，包括国产算力、光模块、AI 芯片、AI 软件、机器人、AI Agent 等。

2025 年下半年，深证成指作为 A 股市场最重要的标尺指数之一，有望受益经济的筑底回升，迎来指数中长期的布局窗口期。

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，融通深证成份指数 A/B 每 10 份基金份额派发红利 0.004 元，融通深证成份指数 C 每 10 份基金份额派发红利 0.008 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：融通深证成份指数证券投资基金

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	4,903,148.96	5,479,349.96
结算备付金		86,417.14	-
存出保证金		2,930.36	8,018.16
交易性金融资产	6.4.7.2	86,551,457.24	89,465,459.62
其中：股票投资		86,544,056.78	89,465,459.62

基金投资		-	-
债券投资		7,400.46	-
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		1,344,653.01	248,224.34
应收股利		-	-
应收申购款		284,593.65	91,386.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		93,173,200.36	95,292,438.54
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		1,025,755.95	382,298.88
应付管理人报酬		74,673.59	83,217.84
应付托管费		14,934.71	16,643.58
应付销售服务费		4,246.67	4,649.28
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	87,251.67	112,928.50
负债合计		1,206,862.59	599,738.08
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	89,675,755.92	94,291,332.52
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,290,581.85	401,367.94
净资产合计		91,966,337.77	94,692,700.46
负债和净资产总计		93,173,200.36	95,292,438.54

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日,基金份额总额 89,675,755.92 份，其中 A/B 类基金份额 77,455,253.81 份,基金份额净值 1.025 元，C 类基金份额 12,220,502.11 份,基金份额净值 1.027 元。

6.2 利润表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金

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		2,597,777.94	-3,346,311.93
1. 利息收入		9,896.76	5,850.17
其中：存款利息收入	6.4.7.13	9,896.76	5,850.17
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）		1,528,507.53	-6,396,449.17
其中：股票投资收益	6.4.7.14	551,812.79	-7,376,056.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	5,047.96	23,850.26
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	971,646.78	955,756.70
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	1,027,678.50	3,015,817.54
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	31,695.15	28,469.53
减：二、营业总支出		649,277.55	528,678.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	458,930.02	378,463.28

其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	91,785.96	75,692.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	25,061.69	17,216.18
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	73,499.88	57,306.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,948,500.39	-3,874,990.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,948,500.39	-3,874,990.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,948,500.39	-3,874,990.34

6.3 净资产变动表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金

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	94,291,332.52	-	401,367.94	94,692,700.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	94,291,332.52	-	401,367.94	94,692,700.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,615,576.60	-	1,889,213.91	-2,726,362.69
（一）、综合收益总额	-	-	1,948,500.39	1,948,500.39
（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）	-4,615,576.60	-	-16,792.73	-4,632,369.33
其中：1. 基金申购款	20,370,594.36	-	-48,931.59	20,321,662.77

2. 基金赎回款	-24,986,170.96	-	32,138.86	-24,954,032.10
(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)	-	-	-42,493.75	-42,493.75
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	89,675,755.92	-	2,290,581.85	91,966,337.77
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	86,032,716.46	-	-9,179,173.99	76,853,542.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	86,032,716.46	-	-9,179,173.99	76,853,542.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,840,023.84	-	-4,236,280.99	-1,396,257.15
(一)、综合收益总额	-	-	-3,874,990.34	-3,874,990.34
(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)	2,840,023.84	-	-361,290.65	2,478,733.19
其中：1. 基金申购款	23,084,559.89	-	-3,043,348.07	20,041,211.82
2. 基金赎回款	-20,244,536.05	-	2,682,057.42	-17,562,478.63
(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	88,872,740.30	-	-13,415,454.98	75,457,285.32

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

融通深证成份指数证券投资基金(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”)证监许可[2010]606号《关于核准融通深证成份指数证券投资基金募集的批复》核准,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《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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1,848,674,651.50元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第315号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》于2010年11月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,848,841,553.44份基金份额,其中认购资金利息折合166,901.94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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人于2017年7月5日发布的《融通基金管理有限公司关于融通深证成份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》,自2017年7月5日起对本基金进行份额分类,原有基金份额为A/B类份额,增设C类份额。在投资者申购时收取前端申购费用的份额,称为A类份额;在投资者赎回时收取后端申购费用的份额,称为B类份额;不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费并按照持有期限收取赎回费的份额,称为C类份额。本基金分类后,本基金原有基金份额将自动划归为本基金A/B类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括深证成份指数的成份股与备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金力求将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。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。本基金股票资产占基金资产的比例为90%-95%,其中投资于深证成份指数成份股与及其备选成份股的资产不低于股票资产的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:深证成份指数收益率X95%+银行活期存款利率X5%。

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作为增值税纳税人。

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	4,903,148.96
等于：本金	4,902,669.53
加：应计利息	479.43
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	4,903,148.96

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	81,867,107.04	—	86,544,056.78	4,676,949.74
贵金属投资-金交所 黄金合约	—	—	—	—

债券	交易所市场	7,399.97	0.49	7,400.46	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,399.97	0.49	7,400.46	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		81,874,507.01	0.49	86,551,457.24	4,676,949.74

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	-
应付赎回费	421.41
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	13,438.38
其中：交易所市场	13,438.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	73,391.88
合计	87,251.67

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通深证成份指数 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	81,334,512.69	81,334,512.69
本期申购	7,093,163.65	7,093,163.65
本期赎回（以“-”号填列）	-10,972,422.53	-10,972,422.53
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	77,455,253.81	77,455,253.81

融通深证成份指数 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	12,956,819.83	12,956,819.83
本期申购	13,277,430.71	13,277,430.71

本期赎回（以“-”号填列）	-14,013,748.43	-14,013,748.43
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	12,220,502.11	12,220,502.11

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

融通深证成份指数 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	40,435,302.80	-40,135,708.30	299,594.50
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	40,435,302.80	-40,135,708.30	299,594.50
本期利润	821,169.98	884,197.48	1,705,367.46
本期基金份额交易产生的变动数	-1,949,599.33	1,936,822.44	-12,776.89
其中：基金申购款	3,560,347.72	-3,613,069.65	-52,721.93
基金赎回款	-5,509,947.05	5,549,892.09	39,945.04
本期已分配利润	-32,511.63	-	-32,511.63
本期末	39,274,361.82	-37,314,688.38	1,959,673.44

融通深证成份指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	508,303.93	-406,530.49	101,773.44
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	508,303.93	-406,530.49	101,773.44
本期利润	99,651.91	143,481.02	243,132.93
本期基金份额交易产生的变动数	-26,481.62	22,465.78	-4,015.84
其中：基金申购款	573,926.37	-570,136.03	3,790.34
基金赎回款	-600,407.99	592,601.81	-7,806.18
本期已分配利润	-9,982.12	-	-9,982.12
本期末	571,492.10	-240,583.69	330,908.41

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	9,807.00
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	78.77
其他	10.99
合计	9,896.76

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	551,812.79
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	551,812.79

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	49,332,151.57
减：卖出股票成本总额	48,732,243.29
减：交易费用	48,095.49
买卖股票差价收入	551,812.79

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	3.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	5,044.90
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	5,047.96
----	----------

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	33,048.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	27,999.88
减：应计利息总额	2.72
减：交易费用	1.33
买卖债券差价收入	5,044.90

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	971,646.78
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	971,646.78

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	1,027,678.50
股票投资	1,027,678.50
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	1,027,678.50

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	30,931.64
基金转换费收入	763.51
合计	31,695.15

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. 基金的转换费用包括转换费和补差费，其中不低于转换费的 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	13,884.51
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	108.00
合计	73,499.88

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 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	
	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	40,569,007.59	43.30	-	-

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	7,542.34	43.30	4,104.97	30.55
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（%）
-	-	-	-	-

注：（1）上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

（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 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管理费	458,930.02	378,463.28
其中：应支付销售机构的客户维护费	213,732.49	176,065.01
应支付基金管理人的净管理费	245,197.53	202,398.27

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	91,785.96	75,692.73

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		
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C	合计
融通基金	-	42.83	42.83
中国工商银行	-	3,314.58	3,314.58
合计	-	3,357.41	3,357.41
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		
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C	合计
融通基金	-	73.55	73.55
中国工商银行	-	114.95	114.95
合计	-	188.50	188.50

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	4,903,148.96	9,807.00	2,227,156.64	5,614.73

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

融通深证成份指数 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	0.004	17,384.38	15,127.25	32,511.63	-
合计	-	-	-	0.004	17,384.38	15,127.25	32,511.63	-
融通深证成份指数 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	0.008	8,579.23	1,402.89	9,982.12	-
合计	-	-	-	0.008	8,579.23	1,402.89	9,982.12	-

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	2025-04-02	1-6 个月 （含）	首发流 通受限	12.80	28.05	68	870.40	1,907.40	-
001356	富岭 股份	2025-01-16	1-6 个月 （含）	首发流 通受限	5.30	14.44	238	1,261.40	3,436.72	-
001382	新亚 电缆	2025-03-13	1-6 个月 （含）	首发流 通受限	7.40	20.21	202	1,494.80	4,082.42	-
001388	信通 电子	2025-06-24	1 个月内 （含）	首发流 通受限	16.42	16.42	421	6,912.82	6,912.82	-
001388	信通 电子	2025-06-24	1-6 个月 （含）	首发流 通受限	16.42	16.42	47	771.74	771.74	-
001390	古麒 绒材	2025-05-21	1-6 个月 （含）	首发流 通受限	12.08	18.12	77	930.16	1,395.24	-
001395	亚联 机械	2025-01-20	1-6 个月 （含）	首发流 通受限	19.08	47.25	68	1,297.44	3,213.00	-
301173	毓恬 冠佳	2025-02-24	1-6 个月 （含）	首发流 通受限	28.33	44.98	81	2,294.73	3,643.38	-
301275	汉朔 科技	2025-03-04	1-6 个月 （含）	首发流 通受限	27.50	56.19	83	2,282.50	4,663.77	-
301458	钧崴 电子	2025-01-02	1-6 个月 （含）	首发流 通受限	10.40	34.11	281	2,922.40	9,584.91	-
301479	弘景 光电	2025-03-06	1-6 个月 （含）	首发流 通受限	41.90	77.87	53	2,220.70	4,127.11	-
301479	弘景 光电	2025-05-28	1-6 个月 （含）	送股流 通受限	-	77.87	21	-	1,635.27	-
301501	恒鑫 生活	2025-03-11	1-6 个月 （含）	首发流 通受限	39.92	45.22	54	2,155.68	2,441.88	-
301501	恒鑫 生活	2025-06-06	1-6 个月 （含）	送股流 通受限	-	45.22	24	-	1,085.28	-

301535	浙江华远	2025-03-18	1-6 个月 (含)	首发流通受限	4.92	18.99	490	2,410.80	9,305.10	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	1-6 个月 (含)	首发流通受限	16.50	27.45	98	1,617.00	2,690.10	-
301590	优优绿能	2025-05-28	1-6 个月 (含)	首发流通受限	89.60	139.48	20	1,792.00	2,789.60	-
301595	太力科技	2025-05-12	1-6 个月 (含)	首发流通受限	17.05	29.10	108	1,841.40	3,142.80	-
301601	惠通科技	2025-01-08	1-6 个月 (含)	首发流通受限	11.80	33.85	224	2,643.20	7,582.40	-
301602	超研股份	2025-01-15	1-6 个月 (含)	首发流通受限	6.70	24.80	364	2,438.80	9,027.20	-
301636	泽润新能	2025-04-30	1-6 个月 (含)	首发流通受限	33.06	47.46	56	1,851.36	2,657.76	-
301658	首航新能	2025-03-26	1-6 个月 (含)	首发流通受限	11.80	22.98	207	2,442.60	4,756.86	-
301662	宏工科技	2025-04-10	1-6 个月 (含)	首发流通受限	26.60	82.50	76	2,021.60	6,270.00	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	1-6 个月 (含)	首发流通受限	10.27	22.39	227	2,331.29	5,082.53	-
301678	新恒汇	2025-06-13	1-6 个月 (含)	首发流通受限	12.80	44.54	131	1,676.80	5,834.74	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123257	安克转债	2025-6-16	1 个月内 (含)	配债流通受限	100.00	100.01	74	7,399.97	7,400.46	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000627	天茂集团	2025-5-6	重大事项停牌	2.74	-	-	13,400	32,026.00	36,716.00	-

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，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01% (2024 年 12 月 31 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，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	4,903,148.96	-	-	-	4,903,148.96
结算备付金	86,417.14	-	-	-	86,417.14
存出保证金	2,930.36	-	-	-	2,930.36
交易性金融资产	-	-	7,400.46	86,544,056.78	86,551,457.24
应收申购款	-	-	-	284,593.65	284,593.65
应收清算款	-	-	-	1,344,653.01	1,344,653.01
资产总计	4,992,496.46	-	7,400.46	88,173,303.44	93,173,200.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,025,755.95	1,025,755.95
应付管理人报酬	-	-	-	74,673.59	74,673.59
应付托管费	-	-	-	14,934.71	14,934.71
应付销售服务费	-	-	-	4,246.67	4,246.67
其他负债	-	-	-	87,251.67	87,251.67
负债总计	-	-	-	1,206,862.59	1,206,862.59
利率敏感度缺口	4,992,496.46	-	7,400.46	86,966,440.85	91,966,337.77
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	5,479,349.96	-	-	-	5,479,349.96
存出保证金	8,018.16	-	-	-	8,018.16
交易性金融资产	-	-	-	89,465,459.62	89,465,459.62

应收申购款	-	-	-	91,386.46	91,386.46
应收清算款	-	-	-	248,224.34	248,224.34
资产总计	5,487,368.12	-	-	89,805,070.42	95,292,438.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	382,298.88	382,298.88
应付管理人报酬	-	-	-	83,217.84	83,217.84
应付托管费	-	-	-	16,643.58	16,643.58
应付销售服务费	-	-	-	4,649.28	4,649.28
其他负债	-	-	-	112,928.50	112,928.50
负债总计	-	-	-	599,738.08	599,738.08
利率敏感度缺口	5,487,368.12	-	-	89,205,332.34	94,692,700.46

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 0.01% (2024 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 (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。

6.4.13.4.3 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成份指数的跟踪误差，力求实现对深证成份指数的有效跟踪。金融工程小组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。本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资深证成份指数成份股及其备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；并保持不低于基金资产

净值 5%的现金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	86,544,056.78	94.10	89,465,459.62	94.48
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	86,544,056.78	94.10	89,465,459.62	94.48

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除深证成份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. 深证成份指数收益率上升 5%	4,345,941.34	4,344,672.69
	2. 深证成份指数收益率下降 5%	-4,345,941.34	-4,344,672.69

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	86,399,300.75	89,070,676.12
第二层次	51,801.02	264,974.00
第三层次	100,355.47	129,809.50
合计	86,551,457.24	89,465,459.62

6.4.14.2 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	86,544,056.78	92.89
	其中：股票	86,544,056.78	92.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,400.46	0.01
	其中：债券	7,400.46	0.01
	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	4,989,566.10	5.36
8	其他各项资产	1,632,177.02	1.75

9	合计	93,173,200.36	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	1,566,257.99	1.70
B	采矿业	1,113,102.33	1.21
C	制造业	63,215,340.61	68.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,103,170.00	1.20
E	建筑业	148,278.00	0.16
F	批发和零售业	921,241.00	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,460,772.00	1.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,727,055.24	6.23
J	金融业	7,347,886.57	7.99
K	房地产业	725,211.51	0.79
L	租赁和商务服务业	1,025,684.80	1.12
M	科学研究和技术服务业	675,656.50	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	182,031.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	112,608.00	0.12
Q	卫生和社会工作	539,685.20	0.59
R	文化、体育和娱乐业	535,320.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	86,399,300.75	93.95

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	98,550.23	0.11
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	1,907.40	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	36,716.00	0.04
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	7,582.40	0.01
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	144,756.03	0.16

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	18,660	4,706,425.20	5.12
2	000333	美的集团	36,303	2,621,076.60	2.85
3	300059	东方财富	92,469	2,138,807.97	2.33
4	002594	比亚迪	6,244	2,072,446.04	2.25
5	000858	五粮液	13,446	1,598,729.40	1.74
6	000651	格力电器	32,102	1,442,021.84	1.57
7	002475	立讯精密	34,557	1,198,782.33	1.30
8	000725	京东方 A	244,898	977,143.02	1.06
9	300124	汇川技术	14,647	945,756.79	1.03
10	300308	中际旭创	6,388	931,753.68	1.01
11	002371	北方华创	2,100	928,641.00	1.01
12	300760	迈瑞医疗	4,100	921,475.00	1.00
13	300502	新易盛	6,477	822,708.54	0.89
14	002352	顺丰控股	16,300	794,788.00	0.86
15	002714	牧原股份	18,475	776,134.75	0.84
16	002415	海康威视	27,835	771,864.55	0.84
17	000063	中兴通讯	23,577	766,016.73	0.83
18	000001	平安银行	62,609	755,690.63	0.82
19	300274	阳光电源	10,844	734,897.88	0.80
20	002142	宁波银行	25,323	692,837.28	0.75
21	002230	科大讯飞	14,363	687,700.44	0.75
22	300498	温氏股份	39,378	672,576.24	0.73
23	000568	泸州老窖	5,543	628,576.20	0.68
24	300476	胜宏科技	4,500	604,710.00	0.66
25	000100	TCL 科技	134,352	581,744.16	0.63
26	000338	潍柴动力	37,640	578,903.20	0.63
27	002027	分众传媒	74,664	545,047.20	0.59
28	000425	徐工机械	61,500	477,855.00	0.52
29	000792	盐湖股份	26,400	450,912.00	0.49
30	300014	亿纬锂能	9,278	425,025.18	0.46
31	002241	歌尔股份	18,114	422,418.48	0.46

32	002463	沪电股份	9,920	422,393.60	0.46
33	002050	三花智控	15,583	411,079.54	0.45
34	000625	长安汽车	32,109	409,710.84	0.45
35	300033	同花顺	1,500	409,515.00	0.45
36	002625	光启技术	10,200	407,796.00	0.44
37	300015	爱尔眼科	32,115	400,795.20	0.44
38	000977	浪潮信息	7,664	389,944.32	0.42
39	000776	广发证券	20,860	350,656.60	0.38
40	002384	东山精密	9,150	345,595.50	0.38
41	002179	中航光电	8,557	345,360.52	0.38
42	002311	海大集团	5,840	342,165.60	0.37
43	000938	紫光股份	13,375	320,866.25	0.35
44	300433	蓝思科技	14,360	320,228.00	0.35
45	000002	万 科 A	49,700	319,074.00	0.35
46	002049	紫光国微	4,840	318,762.40	0.35
47	000538	云南白药	5,559	310,136.61	0.34
48	300408	三环集团	9,250	308,950.00	0.34
49	000166	申万宏源	61,420	308,328.40	0.34
50	002028	思源电气	4,200	306,222.00	0.33
51	002422	科伦药业	8,516	305,894.72	0.33
52	000988	华工科技	6,300	296,163.00	0.32
53	002304	洋河股份	4,535	292,734.25	0.32
54	002460	赣锋锂业	8,410	284,005.70	0.31
55	300339	润和软件	5,500	279,565.00	0.30
56	000157	中联重科	36,741	265,637.43	0.29
57	002074	国轩高科	8,100	262,926.00	0.29
58	000768	中航西飞	9,560	261,370.40	0.28
59	002966	苏州银行	29,400	258,132.00	0.28
60	002517	恺英网络	13,300	256,823.00	0.28
61	002252	上海莱士	36,800	252,816.00	0.27
62	000807	云铝股份	15,700	250,886.00	0.27
63	300394	天孚通信	3,136	250,378.24	0.27
64	002456	欧菲光	21,100	250,035.00	0.27
65	002001	新 和 成	11,645	247,689.15	0.27
66	002466	天齐锂业	7,600	243,504.00	0.26
67	000975	山金国际	12,772	241,901.68	0.26
68	301236	软通动力	4,300	234,952.00	0.26
69	002736	国信证券	20,300	233,856.00	0.25
70	002340	格林美	36,310	230,568.50	0.25
71	000408	藏格矿业	5,400	230,418.00	0.25
72	000963	华东医药	5,700	230,052.00	0.25
73	300255	常山药业	4,900	228,389.00	0.25
74	002236	大华股份	14,332	227,592.16	0.25

75	001979	招商蛇口	25,763	225,941.51	0.25
76	002648	卫星化学	12,986	225,047.38	0.24
77	002195	岩山科技	39,500	222,385.00	0.24
78	000066	中国长城	14,828	219,454.40	0.24
79	000661	长春高新	2,194	217,600.92	0.24
80	002558	巨人网络	9,200	216,660.00	0.24
81	300661	圣邦股份	2,970	216,126.90	0.24
82	300803	指南针	2,675	215,765.50	0.23
83	300418	昆仑万维	6,400	215,232.00	0.23
84	300251	光线传媒	10,500	212,835.00	0.23
85	002156	通富微电	8,300	212,646.00	0.23
86	300347	泰格医药	3,950	210,614.00	0.23
87	002797	第一创业	29,120	206,169.60	0.22
88	300450	先导智能	8,241	204,788.85	0.22
89	300207	欣旺达	10,202	204,652.12	0.22
90	002920	德赛西威	2,000	204,260.00	0.22
91	002202	金风科技	19,288	197,702.00	0.21
92	000895	双汇发展	8,017	195,694.97	0.21
93	002916	深南电路	1,811	195,243.91	0.21
94	000933	神火股份	11,600	193,024.00	0.21
95	002465	海格通信	13,830	192,790.20	0.21
96	002185	华天科技	19,034	192,243.40	0.21
97	003816	中国广核	52,500	191,100.00	0.21
98	002555	三七互娱	11,000	190,190.00	0.21
99	002601	龙佰集团	11,500	186,415.00	0.20
100	302132	中航成飞	2,100	184,674.00	0.20
101	002600	领益智造	21,300	182,967.00	0.20
102	000831	中国稀土	5,000	180,600.00	0.20
103	000786	北新建材	6,796	179,958.08	0.20
104	002493	荣盛石化	21,600	178,848.00	0.19
105	300782	卓胜微	2,504	178,710.48	0.19
106	300458	全志科技	4,500	178,605.00	0.19
107	300779	惠城环保	1,000	178,490.00	0.19
108	300442	润泽科技	3,600	178,308.00	0.19
109	000997	新大陆	5,500	178,090.00	0.19
110	002273	水晶光电	8,900	177,733.00	0.19
111	002595	豪迈科技	3,000	177,660.00	0.19
112	300866	安克创新	1,560	177,216.00	0.19
113	300474	景嘉微	2,400	175,200.00	0.19
114	300759	康龙化成	7,125	174,847.50	0.19
115	300896	爱美客	1,000	174,810.00	0.19
116	002532	天山铝业	21,000	174,510.00	0.19
117	000630	铜陵有色	52,100	174,014.00	0.19

118	002281	光迅科技	3,500	172,620.00	0.19
119	000423	东阿阿胶	3,300	172,590.00	0.19
120	300058	蓝色光标	26,260	172,265.60	0.19
121	001965	招商公路	14,300	171,600.00	0.19
122	002294	信立泰	3,600	170,388.00	0.19
123	300454	深信服	1,800	169,524.00	0.18
124	002180	纳思达	7,300	167,462.00	0.18
125	002472	双环传动	5,000	167,450.00	0.18
126	002129	TCL 中环	21,700	166,656.00	0.18
127	300122	智飞生物	8,500	166,515.00	0.18
128	300017	网宿科技	15,500	166,160.00	0.18
129	300223	北京君正	2,400	166,080.00	0.18
130	300002	神州泰岳	13,900	164,020.00	0.18
131	000783	长江证券	23,425	162,335.25	0.18
132	000034	神州数码	4,300	161,852.00	0.18
133	301269	华大九天	1,300	161,044.00	0.18
134	002709	天赐材料	8,852	160,398.24	0.17
135	002223	鱼跃医疗	4,500	160,200.00	0.17
136	002085	万丰奥威	10,000	158,900.00	0.17
137	002078	太阳纸业	11,800	158,828.00	0.17
138	300395	菲利华	3,100	158,410.00	0.17
139	000728	国元证券	19,990	157,721.10	0.17
140	002938	鹏鼎控股	4,900	156,947.00	0.17
141	000426	兴业银锡	9,900	156,420.00	0.17
142	002353	杰瑞股份	4,451	155,785.00	0.17
143	002851	麦格米特	3,100	155,434.00	0.17
144	000766	通化金马	6,100	154,757.00	0.17
145	002065	东华软件	15,900	152,640.00	0.17
146	002131	利欧股份	43,400	151,900.00	0.17
147	000021	深科技	8,100	151,794.00	0.17
148	300115	长盈精密	7,079	151,490.60	0.16
149	300024	机器人	8,800	151,184.00	0.16
150	002738	中矿资源	4,700	151,152.00	0.16
151	000733	振华科技	3,000	150,150.00	0.16
152	000999	华润三九	4,800	150,144.00	0.16
153	002271	东方雨虹	13,943	149,608.39	0.16
154	000876	新 希 望	15,900	149,142.00	0.16
155	300496	中科创达	2,600	148,772.00	0.16
156	002008	大族激光	6,100	148,657.00	0.16
157	002128	电投能源	7,500	148,350.00	0.16
158	300383	光环新网	10,300	147,290.00	0.16
159	002850	科达利	1,300	147,121.00	0.16
160	000596	古井贡酒	1,100	146,465.00	0.16

161	300054	鼎龙股份	5,100	146,268.00	0.16
162	002138	顺络电子	5,200	146,224.00	0.16
163	000301	东方盛虹	17,400	144,942.00	0.16
164	300765	新诺威	2,800	144,732.00	0.16
165	002624	完美世界	9,500	144,115.00	0.16
166	000617	中油资本	19,700	143,810.00	0.16
167	300604	长川科技	3,200	143,712.00	0.16
168	002673	西部证券	18,148	143,006.24	0.16
169	300253	卫宁健康	13,485	142,941.00	0.16
170	002155	湖南黄金	7,989	142,603.65	0.16
171	300832	新产业	2,500	141,800.00	0.15
172	002436	兴森科技	10,700	141,668.00	0.15
173	002126	银轮股份	5,800	140,824.00	0.15
174	002405	四维图新	16,300	139,202.00	0.15
175	002410	广联达	10,300	138,123.00	0.15
176	300346	南大光电	4,360	137,950.40	0.15
177	002402	和而泰	5,900	136,703.00	0.15
178	300136	信维通信	6,095	136,528.00	0.15
179	002459	晶澳科技	13,608	135,807.84	0.15
180	300142	沃森生物	12,200	134,200.00	0.15
181	002444	巨星科技	5,200	132,652.00	0.14
182	300857	协创数据	1,540	132,532.40	0.14
183	002821	凯莱英	1,500	132,375.00	0.14
184	300073	当升科技	3,000	131,610.00	0.14
185	000878	云南铜业	10,300	131,016.00	0.14
186	000932	华菱钢铁	29,580	130,152.00	0.14
187	300001	特锐德	5,400	129,438.00	0.14
188	000750	国海证券	31,300	128,956.00	0.14
189	002812	恩捷股份	4,400	128,876.00	0.14
190	300699	光威复材	4,041	127,978.47	0.14
191	002152	广电运通	9,475	127,344.00	0.14
192	300773	拉卡拉	3,800	127,110.00	0.14
193	000519	中兵红箭	5,800	126,962.00	0.14
194	300037	新宙邦	3,580	126,016.00	0.14
195	300003	乐普医疗	9,100	125,398.00	0.14
196	300316	晶盛机电	4,600	124,890.00	0.14
197	300674	宇信科技	4,100	124,189.00	0.14
198	002414	高德红外	12,100	124,025.00	0.13
199	002837	英维克	4,160	123,593.60	0.13
200	000893	亚钾国际	4,100	123,574.00	0.13
201	300627	华测导航	3,500	122,500.00	0.13
202	300628	亿联网络	3,510	122,007.60	0.13
203	300012	华测检测	10,400	121,576.00	0.13

204	002389	航天彩虹	4,700	120,320.00	0.13
205	300459	汤姆猫	21,200	118,720.00	0.13
206	300666	江丰电子	1,600	118,560.00	0.13
207	000983	山西焦煤	18,500	118,400.00	0.13
208	002007	华兰生物	7,485	117,289.95	0.13
209	300999	金龙鱼	3,942	116,407.26	0.13
210	000729	燕京啤酒	9,000	116,370.00	0.13
211	300570	太辰光	1,200	115,656.00	0.13
212	300568	星源材质	9,091	115,273.88	0.13
213	000623	吉林敖东	6,800	115,260.00	0.13
214	002335	科华数据	2,700	115,236.00	0.13
215	002958	青农商行	31,700	114,437.00	0.12
216	002607	中公教育	36,800	112,608.00	0.12
217	002318	久立特材	4,800	112,272.00	0.12
218	002044	美年健康	21,800	112,052.00	0.12
219	002683	广东宏大	3,300	112,002.00	0.12
220	000528	柳 工	11,600	111,476.00	0.12
221	300364	中文在线	4,200	111,300.00	0.12
222	000960	锡业股份	7,200	110,160.00	0.12
223	300558	贝达药业	1,900	110,105.00	0.12
224	002409	雅克科技	2,000	109,380.00	0.12
225	002139	拓邦股份	7,900	109,099.00	0.12
226	002025	航天电器	2,121	109,040.61	0.12
227	300373	扬杰科技	2,100	108,990.00	0.12
228	000039	中集集团	13,850	108,861.00	0.12
229	300724	捷佳伟创	2,000	108,600.00	0.12
230	002739	万达电影	9,500	108,585.00	0.12
231	300748	金力永磁	4,500	107,280.00	0.12
232	000887	中鼎股份	6,000	105,540.00	0.11
233	001696	宗申动力	4,700	105,515.00	0.11
234	300757	罗博特科	700	104,979.00	0.11
235	000738	航发控制	5,051	104,808.25	0.11
236	000009	中国宝安	11,800	104,784.00	0.11
237	000400	许继电气	4,800	104,496.00	0.11
238	300100	双林股份	2,200	103,576.00	0.11
239	300413	芒果超媒	4,740	103,426.80	0.11
240	300144	宋城演艺	12,000	102,600.00	0.11
241	300672	国科微	1,200	101,904.00	0.11
242	002385	大北农	25,150	101,606.00	0.11
243	300919	中伟股份	3,080	101,270.40	0.11
244	300296	利亚德	16,600	101,260.00	0.11
245	300432	富临精工	7,700	100,639.00	0.11
246	300285	国瓷材料	5,800	100,630.00	0.11

247	002080	中材科技	5,160	100,620.00	0.11
248	002222	福晶科技	2,900	99,180.00	0.11
249	002568	百润股份	3,852	98,649.72	0.11
250	002841	视源股份	2,800	96,880.00	0.11
251	300682	朗新集团	4,100	96,350.00	0.10
252	000513	丽珠集团	2,658	95,794.32	0.10
253	002926	华西证券	10,700	95,658.00	0.10
254	300487	蓝晓科技	1,900	95,570.00	0.10
255	002487	大金重工	2,900	95,410.00	0.10
256	300623	捷捷微电	3,200	95,360.00	0.10
257	300679	电连技术	2,100	95,298.00	0.10
258	000723	美锦能源	22,000	95,040.00	0.10
259	002015	协鑫能科	6,800	94,724.00	0.10
260	002151	北斗星通	3,300	94,677.00	0.10
261	300777	中简科技	2,600	94,250.00	0.10
262	002407	多氟多	7,720	94,106.80	0.10
263	301358	湖南裕能	3,000	93,570.00	0.10
264	000683	博源化工	19,500	93,405.00	0.10
265	300088	长信科技	15,600	92,976.00	0.10
266	002245	蔚蓝锂芯	7,200	92,376.00	0.10
267	002312	川发龙蟒	8,000	91,840.00	0.10
268	300763	锦浪科技	1,600	91,824.00	0.10
269	002432	九安医疗	2,500	91,075.00	0.10
270	300676	华大基因	1,800	89,586.00	0.10
271	002497	雅化集团	7,700	87,780.00	0.10
272	002056	横店东磁	6,200	87,730.00	0.10
273	300638	广和通	3,040	87,035.20	0.09
274	000591	太阳能	19,800	86,922.00	0.09
275	002506	协鑫集成	32,400	86,508.00	0.09
276	002064	华峰化学	13,000	85,930.00	0.09
277	000155	川能动力	8,700	85,434.00	0.09
278	002262	恩华药业	4,100	85,198.00	0.09
279	002617	露笑科技	11,300	85,089.00	0.09
280	300567	精测电子	1,400	84,854.00	0.09
281	002439	启明星辰	5,300	84,747.00	0.09
282	000060	中金岭南	18,400	84,272.00	0.09
283	000703	恒逸石化	14,300	84,084.00	0.09
284	002939	长城证券	10,000	83,800.00	0.09
285	000998	隆平高科	8,500	83,725.00	0.09
286	002203	海亮股份	8,100	83,592.00	0.09
287	002500	山西证券	14,300	83,512.00	0.09
288	000818	航锦科技	3,700	83,250.00	0.09
289	300146	汤臣倍健	7,400	83,176.00	0.09

290	300229	拓尔思	4,500	82,980.00	0.09
291	000050	深天马 A	9,700	82,644.00	0.09
292	000970	中科三环	7,000	82,390.00	0.09
293	300390	天华新能	4,300	82,001.00	0.09
294	002484	江海股份	4,000	81,960.00	0.09
295	300475	香农芯创	2,300	81,949.00	0.09
296	002244	滨江集团	8,400	81,900.00	0.09
297	002249	大洋电机	12,400	81,592.00	0.09
298	002176	江特电机	11,200	81,312.00	0.09
299	000958	电投产融	11,800	80,712.00	0.09
300	000099	中信海直	3,700	80,586.00	0.09
301	002603	以岭药业	5,700	80,370.00	0.09
302	000563	陕国投 A	22,500	80,325.00	0.09
303	000799	酒鬼酒	1,800	79,182.00	0.09
304	002984	森麒麟	4,220	79,125.00	0.09
305	000547	航天发展	9,400	78,960.00	0.09
306	002701	奥瑞金	13,220	78,659.00	0.09
307	000686	东北证券	10,300	78,589.00	0.09
308	301078	孩子王	6,000	78,420.00	0.09
309	301536	星辰科技	1,300	78,390.00	0.09
310	000636	风华高科	5,700	78,318.00	0.09
311	300775	三角防务	2,900	77,894.00	0.08
312	002756	永兴材料	2,450	77,787.50	0.08
313	000951	中国重汽	4,400	77,352.00	0.08
314	002936	郑州银行	37,500	77,250.00	0.08
315	000830	鲁西化工	7,500	77,250.00	0.08
316	000921	海信家电	3,000	77,100.00	0.08
317	002747	埃斯顿	3,800	76,912.00	0.08
318	300212	易华录	3,500	76,160.00	0.08
319	002653	海思科	1,800	75,996.00	0.08
320	300677	英科医疗	3,200	75,776.00	0.08
321	002268	电科网安	4,100	74,989.00	0.08
322	000708	中信特钢	6,370	74,911.20	0.08
323	002507	涪陵榨菜	5,820	74,437.80	0.08
324	300529	健帆生物	3,410	73,553.70	0.08
325	001227	兰州银行	29,200	73,000.00	0.08
326	300070	碧水源	16,200	72,900.00	0.08
327	300009	安科生物	8,700	72,819.00	0.08
328	000778	新兴铸管	19,500	72,540.00	0.08
329	002948	青岛银行	14,500	72,210.00	0.08
330	000581	威孚高科	3,800	71,972.00	0.08
331	300438	鹏辉能源	2,600	71,786.00	0.08
332	002373	千方科技	7,700	71,610.00	0.08

333	300601	康泰生物	4,700	71,393.00	0.08
334	000875	吉电股份	14,100	71,346.00	0.08
335	002240	盛新锂能	5,500	70,840.00	0.08
336	000403	派林生物	3,900	70,707.00	0.08
337	000598	兴蓉环境	9,800	70,658.00	0.08
338	001389	广合科技	1,200	70,524.00	0.08
339	002221	东华能源	7,300	70,518.00	0.08
340	300735	光弘科技	2,800	70,280.00	0.08
341	002368	太极股份	3,000	70,260.00	0.08
342	002019	亿帆医药	5,400	70,146.00	0.08
343	002429	兆驰股份	16,000	70,080.00	0.08
344	002430	杭氧股份	3,600	69,912.00	0.08
345	002120	韵达股份	10,400	69,680.00	0.08
346	000559	万向钱潮	9,100	69,615.00	0.08
347	002773	康弘药业	2,400	69,528.00	0.08
348	300456	赛微电子	4,000	68,760.00	0.07
349	300751	迈为股份	979	68,099.24	0.07
350	002544	普天科技	2,900	68,005.00	0.07
351	300573	兴齐眼药	1,312	67,948.48	0.07
352	000422	湖北宜化	5,700	67,944.00	0.07
353	301050	雷电微力	1,260	67,158.00	0.07
354	002698	博实股份	4,300	66,822.00	0.07
355	000682	东方电子	6,500	66,560.00	0.07
356	002670	国盛金控	4,400	66,220.00	0.07
357	000739	普洛药业	4,700	65,800.00	0.07
358	301498	乖宝宠物	600	65,622.00	0.07
359	002831	裕同科技	2,800	65,576.00	0.07
360	002270	华明装备	3,900	65,286.00	0.07
361	003021	兆威机电	600	64,890.00	0.07
362	002675	东诚药业	4,500	64,755.00	0.07
363	002508	老板电器	3,400	64,634.00	0.07
364	000709	河钢股份	29,900	64,584.00	0.07
365	002048	宁波华翔	3,500	64,435.00	0.07
366	000657	中钨高新	5,400	64,044.00	0.07
367	000801	四川九洲	4,100	64,042.00	0.07
368	003031	中瓷电子	1,200	63,852.00	0.07
369	000032	深桑达 A	3,100	62,713.00	0.07
370	000555	神州信息	4,400	62,568.00	0.07
371	300718	长盛轴承	900	62,541.00	0.07
372	000825	太钢不锈	17,400	62,466.00	0.07
373	300118	东方日升	6,500	62,270.00	0.07
374	002183	怡亚通	13,500	62,235.00	0.07
375	300957	贝泰妮	1,400	61,908.00	0.07

376	002299	圣农发展	4,300	61,447.00	0.07
377	301301	川宁生物	5,100	61,404.00	0.07
378	000762	西藏矿业	3,200	61,376.00	0.07
379	300026	红日药业	16,600	61,254.00	0.07
380	301308	江波龙	700	61,243.00	0.07
381	002003	伟星股份	5,600	61,096.00	0.07
382	000902	新洋丰	4,400	60,852.00	0.07
383	000069	华侨城 A	26,644	59,949.00	0.07
384	300457	赢合科技	2,600	59,800.00	0.07
385	000027	深圳能源	9,300	59,334.00	0.06
386	000062	深圳华强	2,200	59,092.00	0.06
387	000987	越秀资本	8,600	58,996.00	0.06
388	002416	爱施德	4,900	58,898.00	0.06
389	002597	金禾实业	2,500	58,875.00	0.06
390	300034	钢研高纳	3,500	58,205.00	0.06
391	000883	湖北能源	12,900	58,179.00	0.06
392	000156	华数传媒	7,300	57,962.00	0.06
393	300979	华利集团	1,100	57,827.00	0.06
394	300910	瑞丰新材	1,000	57,750.00	0.06
395	002032	苏泊尔	1,100	57,629.00	0.06
396	000800	一汽解放	8,400	57,624.00	0.06
397	300888	稳健医疗	1,400	57,540.00	0.06
398	002572	索菲亚	4,100	57,441.00	0.06
399	000967	盈峰环境	8,200	56,990.00	0.06
400	000737	北方铜业	5,200	56,472.00	0.06
401	002266	浙富控股	18,300	56,364.00	0.06
402	002847	盐津铺子	700	56,280.00	0.06
403	300595	欧普康视	3,680	56,193.60	0.06
404	000628	高新发展	1,300	55,289.00	0.06
405	002906	华阳集团	1,700	55,267.00	0.06
406	002265	建设工业	1,800	54,990.00	0.06
407	000429	粤高速 A	4,100	54,653.00	0.06
408	300747	锐科激光	2,300	54,464.00	0.06
409	002745	木林森	6,900	54,372.00	0.06
410	000543	皖能电力	7,700	53,900.00	0.06
411	002153	石基信息	6,200	53,692.00	0.06
412	300776	帝尔激光	1,000	53,210.00	0.06
413	000035	中国天楹	12,300	52,767.00	0.06
414	002010	传化智联	9,400	52,452.00	0.06
415	002468	申通快递	4,900	52,381.00	0.06
416	002091	江苏国泰	7,200	52,344.00	0.06
417	300294	博雅生物	2,000	51,980.00	0.06
418	300298	三诺生物	2,300	51,957.00	0.06

419	002237	恒邦股份	4,300	50,740.00	0.06
420	300633	开立医疗	1,700	50,524.00	0.05
421	000089	深圳机场	7,300	50,370.00	0.05
422	301155	海力风电	700	50,330.00	0.05
423	002557	洽洽食品	2,300	49,726.00	0.05
424	000877	天山股份	10,500	48,720.00	0.05
425	002372	伟星新材	4,700	48,692.00	0.05
426	002531	天顺风能	6,800	48,552.00	0.05
427	000088	盐田港	10,600	48,018.00	0.05
428	000582	北部湾港	5,800	47,850.00	0.05
429	001286	陕西能源	5,500	47,850.00	0.05
430	301219	腾远钴业	900	47,808.00	0.05
431	000966	长源电力	10,600	47,700.00	0.05
432	300482	万孚生物	2,180	46,543.00	0.05
433	000810	创维数字	3,900	45,942.00	0.05
434	301029	怡合达	2,000	45,720.00	0.05
435	301165	锐捷网络	740	45,480.40	0.05
436	000937	冀中能源	7,900	45,425.00	0.05
437	002096	易普力	3,600	44,676.00	0.05
438	002408	齐翔腾达	9,800	43,904.00	0.05
439	002865	钧达股份	1,100	42,900.00	0.05
440	000552	甘肃能化	17,200	42,484.00	0.05
441	000537	中绿电	5,000	41,800.00	0.05
442	000785	居然智家	13,700	41,785.00	0.05
443	300357	我武生物	2,000	41,280.00	0.04
444	301091	深城交	1,400	40,936.00	0.04
445	002867	周大生	3,100	40,858.00	0.04
446	002608	江苏国信	5,500	40,315.00	0.04
447	002541	鸿路钢构	2,400	40,176.00	0.04
448	000898	鞍钢股份	17,200	39,904.00	0.04
449	003022	联泓新科	2,500	39,575.00	0.04
450	301095	广立微	700	39,368.00	0.04
451	002925	盈趣科技	2,170	39,016.60	0.04
452	002690	美亚光电	2,300	38,801.00	0.04
453	002832	比音勒芬	2,400	38,520.00	0.04
454	002518	科士达	1,700	38,403.00	0.04
455	001914	招商积余	3,100	38,347.00	0.04
456	003035	南网能源	8,300	38,097.00	0.04
457	000959	首钢股份	11,100	37,740.00	0.04
458	000935	四川双马	2,000	36,440.00	0.04
459	301039	中集车辆	4,400	35,772.00	0.04
460	300726	宏达电子	1,000	35,750.00	0.04
461	001872	招商港口	1,800	35,748.00	0.04

462	000401	冀东水泥	8,000	35,040.00	0.04
463	001287	中电港	1,900	34,789.00	0.04
464	301238	瑞泰新材	1,800	34,596.00	0.04
465	300761	立华股份	1,800	33,822.00	0.04
466	000028	国药一致	1,300	32,409.00	0.04
467	002945	华林证券	2,200	31,614.00	0.03
468	002737	葵花药业	2,000	31,440.00	0.03
469	002705	新宝股份	2,100	30,870.00	0.03
470	300140	节能环保	5,000	30,850.00	0.03
471	002320	海峡股份	4,700	30,738.00	0.03
472	002563	森马服饰	5,800	30,508.00	0.03
473	002461	珠江啤酒	2,700	30,483.00	0.03
474	002060	广东建工	8,700	30,276.00	0.03
475	002498	汉缆股份	8,700	29,406.00	0.03
476	300428	立中集团	1,600	29,152.00	0.03
477	301589	诺瓦星云	200	29,066.00	0.03
478	000539	粤电力 A	6,300	28,602.00	0.03
479	001203	大中矿业	3,000	28,350.00	0.03
480	301611	珂玛科技	500	27,505.00	0.03
481	301267	华夏眼科	1,400	26,838.00	0.03
482	000791	甘肃能源	4,200	26,796.00	0.03
483	001213	中铁特货	6,000	24,360.00	0.03
484	000567	海德股份	3,700	21,904.00	0.02
485	301015	百洋医药	1,000	20,060.00	0.02
486	301207	华兰疫苗	1,100	18,546.00	0.02
487	002901	大博医疗	500	18,120.00	0.02
488	001289	龙源电力	1,100	17,798.00	0.02
489	001308	康冠科技	700	15,834.00	0.02
490	002978	安宁股份	500	15,790.00	0.02
491	301551	无线传媒	300	14,622.00	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

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	000627	天茂集团	13,400	36,716.00	0.04
2	301458	钧崴电子	281	9,584.91	0.01
3	301535	浙江华远	490	9,305.10	0.01
4	301602	超研股份	364	9,027.20	0.01
5	001388	信通电子	468	7,684.56	0.01
6	301601	惠通科技	224	7,582.40	0.01
7	301662	宏工科技	76	6,270.00	0.01
8	301678	新恒汇	131	5,834.74	0.01
9	301479	弘景光电	74	5,762.38	0.01
10	301665	泰禾股份	227	5,082.53	0.01

11	301658	首航新能	207	4,756.86	0.01
12	301275	汉朔科技	83	4,663.77	0.01
13	001382	新亚电缆	202	4,082.42	0.00
14	301173	毓恬冠佳	81	3,643.38	0.00
15	301501	恒鑫生活	78	3,527.16	0.00
16	001356	富岭股份	238	3,436.72	0.00
17	001395	亚联机械	68	3,213.00	0.00
18	301595	太力科技	108	3,142.80	0.00
19	301590	优优绿能	20	2,789.60	0.00
20	301560	众捷汽车	98	2,690.10	0.00
21	301636	泽润新能	56	2,657.76	0.00
22	001335	信凯科技	68	1,907.40	0.00
23	001390	古麒绒材	77	1,395.24	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	000333	美的集团	632,489.00	0.67
2	002594	比亚迪	631,101.00	0.67
3	000063	中兴通讯	511,038.00	0.54
4	002851	麦格米特	441,997.00	0.47
5	002475	立讯精密	441,236.00	0.47
6	002371	北方华创	407,211.00	0.43
7	000651	格力电器	347,543.00	0.37
8	300251	光线传媒	330,926.00	0.35
9	001389	广合科技	329,208.00	0.35
10	002797	第一创业	317,770.00	0.34
11	000963	华东医药	303,250.00	0.32
12	002236	大华股份	295,331.00	0.31
13	001965	招商公路	291,272.00	0.31
14	002601	龙佰集团	286,466.00	0.30
15	002493	荣盛石化	286,113.00	0.30
16	000783	长江证券	284,160.00	0.30
17	002821	凯莱英	280,954.00	0.30
18	002938	鹏鼎控股	278,927.00	0.29
19	000999	华润三九	276,311.00	0.29
20	300395	菲利华	273,885.00	0.29

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	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	-----	------	----------	----------------

	码			
1	002594	比亚迪	742,852.00	0.78
2	000333	美的集团	739,871.00	0.78
3	300750	宁德时代	673,567.00	0.71
4	002475	立讯精密	543,274.00	0.57
5	002371	北方华创	402,054.00	0.42
6	002851	麦格米特	388,620.00	0.41
7	000651	格力电器	365,457.00	0.39
8	002821	凯莱英	355,938.00	0.38
9	000063	中兴通讯	348,134.00	0.37
10	002236	大华股份	345,997.00	0.37
11	300251	光线传媒	345,832.00	0.37
12	002797	第一创业	337,734.00	0.36
13	002601	龙佰集团	331,098.00	0.35
14	300769	德方纳米	317,669.40	0.34
15	000858	五粮液	315,967.00	0.33
16	000783	长江证券	312,999.00	0.33
17	002493	荣盛石化	310,920.00	0.33
18	000338	潍柴动力	309,638.00	0.33
19	001965	招商公路	300,475.00	0.32
20	300395	菲利华	296,868.00	0.31

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	44,783,161.95
卖出股票收入（成交）总额	49,332,151.57

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	7,400.46	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	7,400.46	0.01
----	----	----------	------

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123257	安克转债	74	7,400.46	0.01

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	2,930.36
2	应收清算款	1,344,653.01
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	284,593.65

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,632,177.02

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	000627	天茂集团	36,716.00	0.04	重大事项停牌
2	301458	钧崴电子	9,584.91	0.01	首发流通受限
3	301535	浙江华远	9,305.10	0.01	首发流通受限
4	301602	超研股份	9,027.20	0.01	首发流通受限
5	001388	信通电子	7,684.56	0.01	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（%）
融通深证成份指数 A/B	5,471	14,157.42	-	-	77,455,253.81	100.00
融通深证成份指数 C	2,208	5,534.65	117,375.88	0.96	12,103,126.23	99.04
合计	7,679	11,678.05	117,375.88	0.13	89,558,380.04	99.87

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	融通深证成份指数 A/B	52,026.76	0.06717

有从业人员持 有本基金	融通深证成份指数 C	58.81	0.00048
	合计	52,085.57	0.05808

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	融通深证成份指数 A/B	0
	融通深证成份指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通深证成份指数 A/B	0
	融通深证成份指数 C	0
	合计	0

§ 9 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
基金合同生效日（2010 年 11 月 15 日）基金份额总额	1,848,841,553.44	—
本报告期期初基金份额总额	81,334,512.69	12,956,819.83
本报告期基金总申购份额	7,093,163.65	13,277,430.71
减：本报告期基金总赎回份额	10,972,422.53	14,013,748.43
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	77,455,253.81	12,220,502.11

§ 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，本基金的托管人托管业务部门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 (%)	
诚通证券	2	40,569,007.59	43.30	7,542.34	43.30	—
国泰海通证券	2	34,181,612.55	36.48	6,354.28	36.48	—
华泰证券	1	17,919,196.35	19.12	3,331.00	19.12	—
中信证券	2	893,999.98	0.95	166.31	0.95	—
长江证券	1	70,770.80	0.08	13.15	0.08	—
中金公司	1	67,592.45	0.07	12.56	0.07	—
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	2	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—
天风证券	1	—	—	—	—	—
万联证券	1	—	—	—	—	—
西部证券	1	—	—	—	—	—
浙商证券	1	—	—	—	—	—

中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
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。

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

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 (%)
诚通证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	61,506.88	89.86	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	6,941.95	10.14	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
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	融通深证成份指数证券投资基金第五次分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 10 日
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	融通基金管理有限公司关于系统升级期间暂停	中国证监会指	2025 年 4 月 16 日

	服务的公告	定报刊及网站	
8	融通基金关于旗下部分开放式基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司前端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 5 月 12 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

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