

天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月28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2024年01月01日起至2024年06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	6
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	7
3.2 基金净值表现	7
§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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	69
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	69
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	69
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	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
7.12 投资组合报告附注	70
§8 基金份额持有人信息	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71

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.....	72
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	72
§9 开放式基金份额变动.....	72
§10 重大事件揭示.....	72
10.1 基金份额持有人大会决议.....	72
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.....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4 基金投资策略的改变.....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	73
10.8 其他重大事件.....	74
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
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.....	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
§12 备查文件目录.....	76
12.1 备查文件目录.....	76
12.2 存放地点.....	76
12.3 查阅方式.....	76

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证800指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中证800	
基金主代码	001588	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2015年07月16日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	55,225,134.33份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证800A	天弘中证800C
下属分级基金的交易代码	001588	001589
报告期末下属分级基金的份额总额	30,799,914.27份	24,425,220.06份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。本基金产品投资策略主要包括大类资产配置、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略、其他金融工具投资策略等策略。
业绩比较基准	中证800指数收益率×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，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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		天弘基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	童建林	罗琦
	联系电话	022-83310208	020-66338888
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		95046	95575
传真		022-83865564	020-87553363-6847
注册地址		天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
邮政编码		300203	510627
法定代表人		韩歆毅	林传辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16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 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	天弘中证800A	天弘中证800C
本期已实现收益	-619,360.81	-559,170.73
本期利润	196,584.67	609,708.44
加权平均基金份额本期利润	0.0064	0.0210
本期加权平均净值利润率	0.61%	2.05%
本期基金份额净值增长率	0.74%	0.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	1,340,111.29	571,563.79
期末可供分配基金份额利润	0.0435	0.0234
期末基金资产净值	32,140,025.56	24,996,783.85
期末基金份额净值	1.0435	1.0234
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	4.35%	2.34%

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（例如，开放式基金的申购赎回费等），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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

天弘中证800A

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

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	-3.27%	0.54%	-4.02%	0.54%	0.75%	0.00%
过去三个月	-1.66%	0.77%	-3.10%	0.79%	1.44%	-0.02%
过去六个月	0.74%	0.96%	-1.64%	0.98%	2.38%	-0.02%
过去一年	-8.38%	0.86%	-11.35%	0.89%	2.97%	-0.03%
过去三年	-26.08%	0.97%	-30.91%	0.99%	4.83%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	4.35%	1.23%	-17.30%	1.24%	21.65%	-0.01%

天弘中证800C

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	-3.29%	0.54%	-4.02%	0.54%	0.73%	0.00%
过去三个月	-1.71%	0.77%	-3.10%	0.79%	1.39%	-0.02%
过去六个月	0.65%	0.96%	-1.64%	0.98%	2.29%	-0.02%
过去一年	-8.57%	0.86%	-11.35%	0.89%	2.78%	-0.03%
过去三年	-26.52%	0.97%	-30.91%	0.99%	4.39%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	2.34%	1.23%	-17.30%	1.24%	19.64%	-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

天弘中证800A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年07月16日-2024年06月30日)



天弘中证800C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年07月16日-2024年06月30日)



- 注：1、本基金合同于2015年07月16日生效。
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§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

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、深圳、四川、浙江设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2024年6月30日，公司共管理运作197只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

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		
贺雨轩	本基金基金经理	2022年09月	-	9年	男，通信与信息系统硕士。历任国信证券股份有限公司数据挖掘工程师。2016年10月加盟本公司，历任智能投资部研究员、指数与数量投资部高级研究员等。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

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

本基金在报告期内充分尊重基金合同约定，原则上采用完全复制的投资策略来控制跟踪误差，尽力降低交易成本，力争基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

期间基金运行平稳，日均跟踪偏离和年化跟踪误差均控制在合理范围内，并取得了一定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2024年06月30日，天弘中证800A基金份额净值为1.0435元，天弘中证800C基金份额净值为1.0234元。报告期内份额净值增长率天弘中证800A为0.74%，同期业绩比较基准增长率为-1.64%；天弘中证800C为0.65%，同期业绩比较基准增长率为-1.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年上半年，A股市场经历了一系列跌宕起伏的变化，整体呈现出深V反弹的态势。1月中下旬起，A股市场快速下跌，2月5日盘中甚至跌到了多年的低点。但随即开始变盘向上，主要股指普遍连续7至10个交易日大幅上涨，市场流动性和风险偏好得到改善，板块轮动补涨，主题投资充分演绎。大盘在反弹至关键点位后，上升斜率有所放缓。跨季期间，由于机构调仓和业绩报告等关键博弈窗口，资金动作偏谨慎，导致指数震荡走弱。4月中下旬，在“新国九条”发布和地产政策预期发酵等催化下，指数再次上行，但5月20日后市场开始回调，主要原因包括经济复苏放缓和美联储降息预期摇摆等。至6月末，市场呈现出企稳特征。

总体来看，上半年A股主要股指表现分化，大盘价值显著强于小盘成长。小盘股受到多次冲击，分别是1月中下旬的雪球敲入潮、4月新“国九条”发布后大小票分化、5月ST退市危机等，中证2000指数上半年大幅下挫，跌幅超过20%。与此同时，由于市场风险偏好降低、避险情绪的持续发酵，使得大盘价值风格明显跑赢，特别是银行、煤炭、电力等代表的红利板块。而TMT、消费和医药板块表现不佳。

当前时点，我们对A股下半年行情保持乐观。我们认为，当前市场整体基本面的低风险（利空因素基本出清且已经充分计价）、有长期数据支撑的低估值（悲观预期充分反应、广泛的低预期），已经基本上有望为我们在短、中、长期均提供比较好的预期收益。此外，潜在的边际变化（宏观环境、政策导向、关键技术突破等），都随时可能给A股市场相当一部分上市公司整体性地带来盈利弹性的提升。我们认为，当前A股市场前两个维度（即基本面和估值）当前呈现出的已经是在全历史中较罕见的优异状态。所以我们对A股市场整体持明确的乐观态度。

中证800作为“真正的A股全市场代表指数”（沪深300指数、中证500指数均有明显的市值风格偏向。而中证800更加均衡，是众多投资组合的业绩基准），是实操层面配置A股全市场的优选，具有较高的配置价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§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，本基金托管人在对天弘中证800指数型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，天弘基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何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

本基金托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘中证800指数型发起式证券投资基金2024年中期报告中的财务指标、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：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,901,928.16	3,722,893.05
结算备付金		18,608.30	3,462.91
存出保证金		19,762.77	15,625.12
交易性金融资产	6.4.7.2	54,049,316.38	62,429,136.15
其中：股票投资		54,049,316.38	62,429,136.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收清算款		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		157,042.97	170,752.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		58,146,658.58	66,341,869.93
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023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		203,522.03	0.02
应付赎回款		694,640.42	403,234.82
应付管理人报酬		23,660.47	28,131.41
应付托管费		4,732.07	5,626.28
应付销售服务费		4,018.65	5,965.65
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	6.4.7.6	79,275.53	143,451.23
负债合计		1,009,849.17	586,409.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	55,225,134.33	64,095,243.33
未分配利润	6.4.7.8	1,911,675.08	1,660,217.19
净资产合计		57,136,809.41	65,755,460.52
负债和净资产总计		58,146,658.58	66,341,869.93

注：报告截止日2024年06月30日，天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值1.0435元，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值1.0234元；基金份额总额55,225,134.33份，其中天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份

额30,799,914.27份，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额24,425,220.06份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		1,102,894.04	843,459.77
1.利息收入		13,099.43	12,881.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,099.43	12,881.36
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）		-899,768.96	-115,408.97
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,694,268.72	-843,156.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	271.59	3,916.50
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	794,228.17	723,830.73
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,984,824.65	945,411.22

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,738.92	576.16
减：二、营业总支出		296,600.93	303,326.56
1.管理人报酬		155,108.61	156,536.17
2.托管费		31,021.71	31,307.25
3.销售服务费		29,822.13	35,012.47
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	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.19	80,648.48	80,470.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		806,293.11	540,133.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		806,293.11	540,133.21
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		806,293.11	540,133.21

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	64,095,243.33	1,660,217.19	65,755,460.52

产			
二、本期期初净资产	64,095,243.33	1,660,217.19	65,755,460.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,870,109.00	251,457.89	-8,618,651.11
（一）、综合收益总额	-	806,293.11	806,293.11
（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）	-8,870,109.00	-554,835.22	-9,424,944.22
其中：1.基金申购款	23,494,653.17	695,684.81	24,190,337.98
2.基金赎回款	-32,364,762.17	-1,250,520.03	-33,615,282.20
（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、本期期末净资产	55,225,134.33	1,911,675.08	57,136,809.41
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	55,220,029.80	6,651,093.03	61,871,122.83
二、本期期初净资产	55,220,029.80	6,651,093.03	61,871,122.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,027,754.42	543,460.07	1,571,214.49

(一)、综合收益总额	-	540,133.21	540,133.21
(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)	1,027,754.42	3,326.86	1,031,081.28
其中: 1.基金申购款	16,989,737.17	2,743,485.84	19,733,223.01
2.基金赎回款	-15,961,982.75	-2,740,158.98	-18,702,141.73
(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、本期期末净资产	56,247,784.22	7,194,553.10	63,442,337.32

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:

高阳

薄贺龙

薄贺龙

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

天弘中证800指数型发起式证券投资基金(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[2015]1339号《关于准予天弘中证800指数型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由天弘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《天弘中证800指数型发起式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发起式基金,存续期限不定,首次募集期间为2015年7月15日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集10,000,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第959号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》于2015年7月16日

正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用方式的差异，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资人认购/申购、赎回基金时收取认购/申购费用、赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额。在投资人认购/申购时不收取认购/申购费、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证800指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%，投资于中证800指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准：中证800指数收益率×95% + 银行活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年度上半年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2024年06月30日的财务状况以及2024年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

（4）基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2024年06月30日
活期存款	3,901,928.16
等于：本金	3,901,252.11
加：应计利息	676.05
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	3,901,928.16

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		62,378,679.66	-	54,049,316.38	-8,329,363.28
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		62,378,679.66	-	54,049,316.38	-8,329,363.28

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	318.68	
应付证券出借违约金	-	
应付交易费用	6,312.27	
其中：交易所市场	6,312.27	
银行间市场	-	
应付利息	-	
预提费用	64,644.58	
其他应付款	8,000.00	
合计	79,275.53	

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘中证800A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,607,096.86	30,607,096.86
本期申购	4,088,280.67	4,088,280.67
本期赎回（以“-”号填列）	-3,895,463.26	-3,895,463.26
本期末	30,799,914.27	30,799,914.27

6.4.7.7.2 天弘中证800C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,488,146.47	33,488,146.47
本期申购	19,406,372.50	19,406,372.50

本期赎回（以“-”号填列）	-28,469,298.91	-28,469,298.91
本期末	24,425,220.06	24,425,220.06

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 天弘中证800A

单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,490,916.57	-13,394,929.06	1,095,987.51
本期期初	14,490,916.57	-13,394,929.06	1,095,987.51
本期利润	-619,360.81	815,945.48	196,584.67
本期基金份额交易产生的变动数	87,606.53	-40,067.42	47,539.11
其中：基金申购款	1,879,573.76	-1,659,980.89	219,592.87
基金赎回款	-1,791,967.23	1,619,913.47	-172,053.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,959,162.29	-12,619,051.00	1,340,111.29

6.4.7.8.2 天弘中证800C

单位：人民币元

项目 (天弘中证800C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,045,013.78	-14,480,784.10	564,229.68
本期期初	15,045,013.78	-14,480,784.10	564,229.68
本期利润	-559,170.73	1,168,879.17	609,708.44
本期基金份额交易产生的变动数	-4,022,059.94	3,419,685.61	-602,374.33
其中：基金申购款	8,484,257.39	-8,008,165.45	476,091.94
基金赎回款	-12,506,317.33	11,427,851.06	-1,078,466.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,463,783.11	-9,892,219.32	571,563.79

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	12,801.18
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	163.48
其他	134.77
合计	13,099.43

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	23,246,640.63
减：卖出股票成本总额	24,917,566.13
减：交易费用	23,343.22
买卖股票差价收入	-1,694,268.72

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	409.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-138.00
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	271.59

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	101,740.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	100,366.00
减：应计利息总额	1,512.33
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-138.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	794,228.17
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	794,228.17

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	1,984,824.65
——股票投资	1,984,824.65
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	1,984,824.65

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	4,735.10
基金转换费收入	3.82
合计	4,738.92

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
指数使用费	16,000.00
存托服务费	3.90
合计	80,648.48

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

截至本财务报表批准报出日，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
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
广发证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06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
广发证券股份有限公司	37,799,562.34	100.00%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06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
广发证券股份有限公司	9,294.71	100.00%	6,312.27	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06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,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、本报告期及上年度可比期间,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。

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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	155,108.61	156,536.17
其中:应支付销售机构的客户维护费	58,197.35	44,740.64
应支付基金管理人的净管理费	96,911.26	111,795.53

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	31,021.71	31,307.25

注:支付基金托管人广发证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

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 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司	-	9,928.11	9,928.11
广发证券股份有限公司	-	130.52	130.52
合计	-	10,058.63	10,058.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司	-	15,219.50	15,219.50
广发证券股份有限公司	-	162.18	162.18
合计	-	15,381.68	15,381.68

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日各级基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。天弘中证800C按0.20%计提销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘中证800A不收取销售服务费。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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**

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

天弘中证800A

无

天弘中证800C

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	3,901,928.16	12,801.18	3,431,051.15	12,653.83

注：本基金由基金托管人广发证券股份有限公司保管的银行存款，存放在具有基金托管资格的银行，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金（因追踪指数成份股而被动）持有广发证券的股票6,700股（上年度末：6,600股），估值总额为人民币81,539.00元（上年度末：94,314.00元），占基金净资产的比例为0.14%（上年度末：0.14%）；持有君正集团的股票7,300股（上年度末：7,300股），估值总额为人民币26,937.00元（上年度末：27,302.00元），占基金净资产的比例为0.05%（上年度末：0.04%）；持有恒生电子的股票2,786股（上年度末：3,486股），估值总额为人民币49,200.76元（上年度末：100,257.36元），占基金净资产的比例为0.09%（上年度末：0.15%）。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

天弘中证800A

本报告期无利润分配事项。

天弘中证800C

本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2024年06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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

截至本报告期末2024年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为股票型指数基金，采用指数复制投资策略，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。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从事风险管理的主要目标是在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以风险委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立风险委员会，负责审议风险管理的宏观政策，指导监督公司风险管理目标的落实等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责指导、协调和监督各业务或职能部门开展风险管理工作；决定公司风险控制政策和程序，审批公司风险管理标准和重要业务风险管理口径；听取风险汇报，并就报告的重大风险管理事项进行决策；听取创新业务或产品风险评估报告；组织和协调重大风险事件的应对，直至风险得到妥善处理；审议公司重要的风险管理制度和流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部由督察长分管。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人广发证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。此外，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2024年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。本期末，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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。

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06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	3,901,928.16	-	-	-	3,901,928.16
结算备付金	18,608.30	-	-	-	18,608.30
存出保证金	19,762.77	-	-	-	19,762.77
交易性金融资产	-	-	-	54,049,316.38	54,049,316.38

应收申购款	-	-	-	157,042.97	157,042.97
资产总计	3,940,299.23	-	-	54,206,359.35	58,146,658.58
负债					
应付清算款	-	-	-	203,522.03	203,522.03
应付赎回款	-	-	-	694,640.42	694,640.42
应付管理人报酬	-	-	-	23,660.47	23,660.47
应付托管费	-	-	-	4,732.07	4,732.07
应付销售服务费	-	-	-	4,018.65	4,018.65
其他负债	-	-	-	79,275.53	79,275.53
负债总计	-	-	-	1,009,849.17	1,009,849.17
利率敏感度缺口	3,940,299.23	-	-	53,196,510.18	57,136,809.41
上年度末 2023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	3,722,893.05	-	-	-	3,722,893.05
结算备付金	3,462.91	-	-	-	3,462.91
存出保证金	15,625.12	-	-	-	15,625.12
交易性金融资产	-	-	-	62,429,136.15	62,429,136.15
应收申购款	-	-	-	170,752.70	170,752.70
资产总计	3,741,981.08	-	-	62,599,888.85	66,341,869.93
负债					
应付清算款	-	-	-	0.02	0.02
应付赎回款	-	-	-	403,234.82	403,234.82
应付管理人报酬	-	-	-	28,131.41	28,131.41
应付托管费	-	-	-	5,626.28	5,626.28
应付销售服务费	-	-	-	5,965.65	5,965.65
其他负债	-	-	-	143,451.23	143,451.23
负债总计	-	-	-	586,409.41	586,409.41
利率敏感度缺口	3,741,981.08	-	-	62,013,479.44	65,755,460.52

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2024年06月30日，本基金未持有交易性债券投资(2023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(2023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。

6.4.13.4.3 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。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪中证800指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

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 2024年06月30日		上年度末 2023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	54,049,316.38	94.60	62,429,136.15	94.94
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	54,049,316.38	94.60	62,429,136.15	94.94

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,694,571.93	3,172,569.19
	业绩比较基准下降5%	-2,694,571.93	-3,172,569.19

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	54,049,316.38	62,429,136.15
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	54,049,316.38	62,429,136.15

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	54,049,316.38	92.95
	其中：股票	54,049,316.38	92.95
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	3,920,536.46	6.74
8	其他各项资产	176,805.74	0.30
9	合计	58,146,658.58	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	220,409.00	0.39
B	采矿业	4,409,580.08	7.72
C	制造业	31,444,067.99	55.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,379,187.20	4.16
E	建筑业	1,252,680.41	2.19
F	批发和零售业	634,084.29	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,479,460.96	2.59
H	住宿和餐饮业	46,273.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,996,395.94	3.49
J	金融业	8,733,580.33	15.29
K	房地产业	412,018.09	0.72
L	租赁和商务服务业	360,452.10	0.63
M	科学研究和技术服务业	408,854.32	0.72
N	水利、环境和公共设施管理业	55,948.52	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	105,509.76	0.18
R	文化、体育和娱乐业	80,292.00	0.14
S	综合	23,232.00	0.04
	合计	54,042,025.99	94.58

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	1,303.20	0.00
C	制造业	4,503.99	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	468.90	0.00
E	建筑业	45.90	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8.40	0.00
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	960.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,290.39	0.01

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	600519	贵州茅台	1,400	2,054,346.00	3.60
2	300750	宁德时代	5,860	1,054,975.80	1.85
3	000333	美的集团	15,686	1,011,747.00	1.77
4	601318	中国平安	21,045	870,421.20	1.52
5	600036	招商银行	25,100	858,169.00	1.50
6	600900	长江电力	27,600	798,192.00	1.40
7	601899	紫金矿业	36,700	644,819.00	1.13
8	000858	五粮液	4,297	550,187.88	0.96
9	002594	比亚迪	2,000	500,500.00	0.88
10	601166	兴业银行	28,200	496,884.00	0.87
11	601857	中国石油	48,000	495,360.00	0.87
12	601668	中国建筑	90,480	480,448.80	0.84
13	601088	中国神华	10,700	474,759.00	0.83
14	600028	中国石化	72,100	455,672.00	0.80
15	601328	交通银行	60,000	448,200.00	0.78
16	600809	山西汾酒	1,980	417,542.40	0.73
17	601600	中国铝业	53,000	404,390.00	0.71
18	002475	立讯精密	10,282	404,185.42	0.71
19	000651	格力电器	10,000	392,200.00	0.69
20	601398	工商银行	68,600	391,020.00	0.68
21	600276	恒瑞医药	10,015	385,176.90	0.67
22	000630	铜陵有色	105,000	379,050.00	0.66
23	300760	迈瑞医疗	1,300	378,183.00	0.66
24	002252	上海莱士	47,100	368,322.00	0.64
25	600887	伊利股份	14,000	361,760.00	0.63
26	600511	国药股份	11,000	338,690.00	0.59
27	600309	万华化学	4,180	337,994.80	0.59
28	002128	电投能源	16,000	337,600.00	0.59

29	000513	丽珠集团	8,961	333,438.81	0.58
30	600030	中信证券	18,160	331,056.80	0.58
31	600938	中国海油	10,000	330,000.00	0.58
32	002532	天山铝业	39,000	316,290.00	0.55
33	600690	海尔智家	11,100	315,018.00	0.55
34	000933	神火股份	15,300	309,519.00	0.54
35	000895	双汇发展	12,500	297,125.00	0.52
36	600919	江苏银行	39,650	294,599.50	0.52
37	300059	东方财富	27,677	292,269.12	0.51
38	300308	中际旭创	2,080	286,790.40	0.50
39	000807	云铝股份	21,200	286,412.00	0.50
40	000739	普洛药业	21,000	284,970.00	0.50
41	002648	卫星化学	15,180	272,936.40	0.48
42	601288	农业银行	62,500	272,500.00	0.48
43	000725	京东方 A	66,200	270,758.00	0.47
44	002007	华兰生物	17,055	269,298.45	0.47
45	600529	山东药玻	10,300	261,002.00	0.46
46	603156	养元饮品	11,764	250,220.28	0.44
47	300124	汇川技术	4,800	246,240.00	0.43
48	601816	XD京沪高	45,200	242,724.00	0.42
49	600096	云天化	12,400	240,808.00	0.42
50	600161	天坛生物	9,782	238,680.80	0.42
51	600031	三一重工	14,400	237,600.00	0.42
52	002415	海康威视	7,675	237,234.25	0.42
53	600141	兴发集团	12,380	236,210.40	0.41
54	601168	西部矿业	13,000	233,350.00	0.41
55	000568	泸州老窖	1,600	229,584.00	0.40
56	603259	药明康德	5,728	224,480.32	0.39
57	002371	北方华创	700	223,923.00	0.39
58	601000	唐山港	47,078	221,266.60	0.39
59	002050	三花智控	11,513	219,668.04	0.38

60	600941	中国移动	2,000	215,000.00	0.38
61	601919	中远海控	13,800	213,762.00	0.37
62	600177	雅戈尔	29,300	208,616.00	0.37
63	300274	阳光电源	3,316	205,691.48	0.36
64	600150	中国船舶	5,000	203,550.00	0.36
65	600674	川投能源	10,700	200,625.00	0.35
66	688187	时代电气	3,998	197,421.24	0.35
67	601138	工业富联	7,200	197,280.00	0.35
68	000001	平安银行	18,600	188,790.00	0.33
69	002142	宁波银行	8,525	188,061.50	0.33
70	601985	中国核电	17,600	187,616.00	0.33
71	600837	海通证券	21,800	186,608.00	0.33
72	601225	XD陕西煤	7,100	182,967.00	0.32
73	601988	中国银行	39,300	181,566.00	0.32
74	601186	中国铁建	20,800	178,256.00	0.31
75	600406	国电南瑞	7,136	178,114.56	0.31
76	600016	民生银行	46,940	177,902.60	0.31
77	601233	桐昆股份	11,100	177,156.00	0.31
78	601601	中国太保	6,350	176,911.00	0.31
79	603993	洛阳钼业	20,800	176,800.00	0.31
80	600000	浦发银行	21,300	175,299.00	0.31
81	601728	中国电信	28,300	174,045.00	0.30
82	688981	中芯国际	3,700	170,570.00	0.30
83	601766	中国中车	22,700	170,477.00	0.30
84	300502	新易盛	1,600	168,880.00	0.30
85	000338	潍柴动力	10,100	164,024.00	0.29
86	000063	中兴通讯	5,800	162,226.00	0.28
87	600050	中国联通	34,100	160,270.00	0.28
88	600497	驰宏锌锗	30,000	160,200.00	0.28
89	600362	江西铜业	6,700	158,656.00	0.28
90	000792	盐湖股份	9,000	157,050.00	0.27

91	002352	顺丰控股	4,400	157,036.00	0.27
92	601012	隆基绿能	11,137	156,140.74	0.27
93	600129	太极集团	5,300	153,276.00	0.27
94	601390	中国中铁	23,200	151,264.00	0.26
95	603986	兆易创新	1,552	148,402.24	0.26
96	000100	TCL科技	34,060	147,139.20	0.26
97	600660	福耀玻璃	3,000	143,700.00	0.25
98	601169	北京银行	24,500	143,080.00	0.25
99	002230	科大讯飞	3,300	141,735.00	0.25
100	600803	新奥股份	6,800	141,440.00	0.25
101	601567	三星医疗	4,000	140,000.00	0.25
102	603501	韦尔股份	1,400	139,118.00	0.24
103	601009	南京银行	13,200	137,148.00	0.24
104	600219	南山铝业	35,700	136,017.00	0.24
105	002001	新和成	7,044	135,244.80	0.24
106	601229	上海银行	18,570	134,818.20	0.24
107	600089	特变电工	9,050	125,523.50	0.22
108	000625	长安汽车	9,268	124,469.24	0.22
109	600436	片仔癀	600	124,302.00	0.22
110	600893	航发动力	3,400	124,270.00	0.22
111	688041	海光信息	1,700	119,544.00	0.21
112	600985	淮北矿业	7,100	118,854.00	0.21
113	600023	浙能电力	16,600	118,026.00	0.21
114	000157	中联重科	15,300	117,504.00	0.21
115	600546	山煤国际	8,000	116,960.00	0.20
116	601717	郑煤机	7,900	116,920.00	0.20
117	601688	华泰证券	9,401	116,478.39	0.20
118	600905	三峡能源	26,700	116,412.00	0.20
119	600048	保利发展	13,200	115,632.00	0.20
120	688012	中微公司	797	112,584.22	0.20
121	601888	中国中免	1,800	112,482.00	0.20

122	601818	光大银行	35,300	111,901.00	0.20
123	601211	XD国泰君	8,200	111,110.00	0.19
124	002027	分众传媒	18,160	110,049.60	0.19
125	601006	大秦铁路	15,000	107,400.00	0.19
126	002938	鹏鼎控股	2,700	107,352.00	0.19
127	601658	邮储银行	20,700	104,949.00	0.18
128	601989	中国重工	21,200	104,516.00	0.18
129	600019	宝钢股份	15,592	103,686.80	0.18
130	603288	海天味业	2,997	103,306.59	0.18
131	600886	国投电力	5,600	102,144.00	0.18
132	600795	国电电力	16,600	99,434.00	0.17
133	600585	海螺水泥	4,201	99,101.59	0.17
134	002563	森马服饰	17,000	98,770.00	0.17
135	000977	浪潮信息	2,700	98,199.00	0.17
136	688008	澜起科技	1,696	96,943.36	0.17
137	600999	招商证券	6,940	96,535.40	0.17
138	603225	新凤鸣	6,156	95,972.04	0.17
139	600438	通威股份	4,900	93,639.00	0.16
140	601939	建设银行	12,500	92,500.00	0.16
141	000938	紫光股份	4,123	92,149.05	0.16
142	600549	厦门钨业	5,330	91,942.50	0.16
143	688111	XD金山办	402	91,455.00	0.16
144	603019	中科曙光	2,200	91,300.00	0.16
145	300014	亿纬锂能	2,245	89,620.40	0.16
146	000060	中金岭南	21,100	89,464.00	0.16
147	000425	徐工机械	12,500	89,375.00	0.16
148	300015	爱尔眼科	8,643	89,195.76	0.16
149	002304	洋河股份	1,100	88,814.00	0.16
150	600547	山东黄金	3,216	88,054.08	0.15
151	002241	歌尔股份	4,502	87,834.02	0.15
152	601669	中国电建	15,500	86,645.00	0.15

153	600584	长电科技	2,700	85,617.00	0.15
154	600015	华夏银行	13,300	85,120.00	0.15
155	000596	古井贡酒	401	84,639.07	0.15
156	000002	万科A	12,201	84,552.93	0.15
157	600926	杭州银行	6,420	83,781.00	0.15
158	000538	云南白药	1,603	81,993.45	0.14
159	000776	广发证券	6,700	81,539.00	0.14
160	600760	中航沈飞	2,024	81,162.40	0.14
161	300433	蓝思科技	4,400	80,300.00	0.14
162	600011	华能国际	8,200	78,884.00	0.14
163	600489	中金黄金	5,300	78,440.00	0.14
164	600111	北方稀土	4,500	77,400.00	0.14
164	600066	宇通客车	3,000	77,400.00	0.14
165	002179	中航光电	1,988	75,643.40	0.13
166	601058	赛轮轮胎	5,400	75,600.00	0.13
167	600958	XD东方证	9,784	74,358.40	0.13
168	600426	华鲁恒升	2,790	74,325.60	0.13
169	002028	思源电气	1,100	73,590.00	0.13
170	300408	三环集团	2,500	72,975.00	0.13
171	600600	青岛啤酒	1,000	72,770.00	0.13
172	000166	申万宏源	16,720	72,063.20	0.13
173	600989	宝丰能源	4,100	71,053.00	0.12
174	002311	海大集团	1,500	70,575.00	0.12
175	600188	兖矿能源	3,100	70,463.00	0.12
176	002920	德赛西威	800	69,672.00	0.12
177	300498	温氏股份	3,500	69,370.00	0.12
178	601901	方正证券	8,900	68,797.00	0.12
179	603799	华友钴业	3,100	68,603.00	0.12
180	003816	中国广核	14,700	68,061.00	0.12
181	300832	新产业	1,000	67,440.00	0.12
182	601077	XD渝农商	13,400	67,268.00	0.12

183	002049	紫光国微	1,260	66,276.00	0.12
184	000988	华工科技	2,200	65,846.00	0.12
185	002714	牧原股份	1,500	65,400.00	0.11
186	601377	兴业证券	12,850	65,021.00	0.11
187	300628	亿联网络	1,760	64,715.20	0.11
188	688036	传音控股	840	64,293.60	0.11
189	000661	长春高新	700	64,239.00	0.11
190	002384	东山精密	3,100	64,170.00	0.11
191	000768	中航西飞	2,600	62,478.00	0.11
192	300033	同花顺	600	62,220.00	0.11
193	300394	天孚通信	700	61,894.00	0.11
194	300122	智飞生物	2,200	61,666.00	0.11
195	002460	赣锋锂业	2,141	61,339.65	0.11
196	002340	格林美	9,600	61,152.00	0.11
197	002236	大华股份	3,950	61,067.00	0.11
198	002025	航天电器	1,300	60,294.00	0.11
199	001979	招商蛇口	6,800	59,772.00	0.10
200	002601	龙佰集团	3,200	59,424.00	0.10
201	600010	包钢股份	42,300	59,220.00	0.10
202	601800	中国交建	6,600	59,004.00	0.10
203	600029	南方航空	10,000	58,900.00	0.10
204	300347	泰格医药	1,200	58,320.00	0.10
205	601633	长城汽车	2,300	58,190.00	0.10
206	600845	宝信软件	1,808	57,729.44	0.10
207	300782	卓胜微	740	57,527.60	0.10
208	600176	中国巨石	5,201	57,471.05	0.10
209	600741	华域汽车	3,500	57,330.00	0.10
210	600085	XD同仁堂	1,500	57,315.00	0.10
211	601336	新华保险	1,901	57,087.03	0.10
212	002466	天齐锂业	1,900	56,829.00	0.10
213	000786	北新建材	1,900	56,354.00	0.10

214	601117	中国化学	6,800	56,032.00	0.10
215	603369	今世缘	1,200	55,440.00	0.10
216	002736	国信证券	6,300	54,747.00	0.10
217	601838	成都银行	3,600	54,684.00	0.10
217	600346	恒力石化	3,920	54,684.00	0.10
218	002493	荣盛石化	5,600	54,096.00	0.09
219	600183	生益科技	2,565	54,018.90	0.09
220	601066	中信建投	2,800	53,872.00	0.09
221	300661	圣邦股份	650	53,807.00	0.09
222	601689	拓普集团	1,000	53,610.00	0.09
223	600027	华电国际	7,700	53,438.00	0.09
224	601100	XD恒立液	1,144	53,287.52	0.09
225	688777	中控技术	1,400	52,780.00	0.09
226	601788	光大证券	3,600	52,632.00	0.09
227	600885	宏发股份	1,896	52,481.28	0.09
228	600418	江淮汽车	3,300	52,272.00	0.09
229	300418	昆仑万维	1,600	51,584.00	0.09
230	601868	中国能建	24,199	51,301.88	0.09
231	002273	水晶光电	3,018	51,245.64	0.09
232	002966	苏州银行	6,820	51,150.00	0.09
233	601555	东吴证券	8,647	51,017.30	0.09
234	002223	鱼跃医疗	1,350	50,760.00	0.09
235	600642	申能股份	5,700	50,331.00	0.09
236	002180	纳思达	1,900	50,198.00	0.09
237	600233	圆通速递	3,200	50,080.00	0.09
238	601128	常熟银行	6,600	49,962.00	0.09
239	601898	中煤能源	4,000	49,920.00	0.09
240	002129	TCL中环	5,700	49,305.00	0.09
241	600570	恒生电子	2,786	49,200.76	0.09
242	601360	三六零	6,400	49,152.00	0.09
243	600988	赤峰黄金	3,000	49,020.00	0.09

244	600157	永泰能源	41,400	48,852.00	0.09
245	300979	华利集团	800	48,680.00	0.09
246	002625	光启技术	2,800	48,580.00	0.09
247	600765	中航重机	2,380	48,552.00	0.08
248	300896	爱美客	280	48,188.00	0.08
249	002185	华天科技	5,900	48,085.00	0.08
250	600875	东方电气	2,600	47,970.00	0.08
251	002916	深南电路	452	47,808.04	0.08
252	600588	用友网络	4,761	47,610.00	0.08
253	001965	招商公路	4,000	47,440.00	0.08
254	601618	中国中冶	15,300	47,430.00	0.08
255	601995	中金公司	1,600	47,376.00	0.08
256	601699	潞安环能	2,600	47,138.00	0.08
257	002156	通富微电	2,100	47,019.00	0.08
258	600115	中国东航	11,600	46,516.00	0.08
259	601108	财通证券	7,010	46,336.10	0.08
260	300866	安克创新	650	46,286.50	0.08
261	002271	东方雨虹	3,750	46,275.00	0.08
262	601878	浙商证券	4,300	46,096.00	0.08
263	300003	乐普医疗	3,100	46,004.00	0.08
264	000963	华东医药	1,647	45,803.07	0.08
265	300207	欣旺达	3,000	45,510.00	0.08
266	603392	万泰生物	687	45,259.56	0.08
267	600745	闻泰科技	1,600	45,200.00	0.08
268	600873	梅花生物	4,500	45,090.00	0.08
269	601021	春秋航空	800	45,064.00	0.08
270	000400	许继电气	1,300	44,733.00	0.08
271	600079	人福医药	2,602	44,676.34	0.08
272	688396	华润微	1,190	44,553.60	0.08
273	600060	海信视像	1,800	44,532.00	0.08
274	600415	小商品城	6,000	44,520.00	0.08

275	601998	中信银行	6,600	44,220.00	0.08
276	601607	上海医药	2,290	43,761.90	0.08
277	300759	康龙化成	2,350	43,663.00	0.08
278	601111	中国国航	5,900	43,542.00	0.08
279	300957	贝泰妮	900	43,488.00	0.08
280	000983	山西焦煤	4,200	43,302.00	0.08
281	002078	太阳纸业	3,100	43,245.00	0.08
282	600025	华能水电	4,000	43,120.00	0.08
283	300316	晶盛机电	1,500	43,095.00	0.08
284	600372	中航机载	3,600	43,092.00	0.08
285	300017	网宿科技	5,400	42,660.00	0.07
286	002465	海格通信	4,100	42,476.00	0.07
287	002353	杰瑞股份	1,200	42,096.00	0.07
288	603260	合盛硅业	900	42,039.00	0.07
289	600398	海澜之家	4,500	41,580.00	0.07
290	600352	浙江龙盛	4,800	41,232.00	0.07
291	002138	顺络电子	1,500	41,190.00	0.07
292	300136	信维通信	2,100	41,118.00	0.07
293	688599	天合光能	2,400	40,608.00	0.07
294	000009	中国宝安	4,720	40,592.00	0.07
295	000783	长江证券	8,400	40,572.00	0.07
296	600348	华阳股份	4,050	40,338.00	0.07
297	000932	华菱钢铁	9,080	40,224.40	0.07
298	000683	远兴能源	5,800	40,078.00	0.07
299	688256	寒武纪	200	39,734.00	0.07
300	002008	大族激光	1,900	39,520.00	0.07
301	000066	中国长城	4,500	39,375.00	0.07
302	000301	东方盛虹	4,900	39,053.00	0.07
303	600104	上汽集团	2,800	38,808.00	0.07
304	000999	华润三九	910	38,747.80	0.07
305	301269	华大九天	500	38,525.00	0.07

306	002074	国轩高科	2,000	38,300.00	0.07
307	600332	白云山	1,300	38,129.00	0.07
308	601877	正泰电器	2,000	38,120.00	0.07
309	000831	中国稀土	1,500	38,025.00	0.07
310	002812	恩捷股份	1,200	37,980.00	0.07
311	002409	雅克科技	600	37,746.00	0.07
312	000039	中集集团	4,070	37,688.20	0.07
313	605117	德业股份	504	37,467.36	0.07
314	600879	航天电子	4,800	37,296.00	0.07
315	601238	广汽集团	4,800	37,152.00	0.07
316	002444	巨星科技	1,500	37,050.00	0.06
317	002709	天赐材料	2,108	37,016.48	0.06
318	600109	国金证券	4,900	36,995.00	0.06
319	002673	西部证券	5,900	36,521.00	0.06
320	603338	浙江鼎力	600	36,252.00	0.06
321	300012	华测检测	3,600	36,216.00	0.06
322	601179	中国西电	4,500	36,180.00	0.06
323	601577	长沙银行	4,400	35,992.00	0.06
324	600839	四川长虹	8,000	35,920.00	0.06
325	601666	平煤股份	3,200	35,840.00	0.06
326	300285	国瓷材料	2,000	35,700.00	0.06
327	600862	XD中航高	1,900	35,682.00	0.06
328	000960	锡业股份	2,300	35,627.00	0.06
329	688099	晶晨股份	600	35,592.00	0.06
330	601319	中国人保	6,900	35,535.00	0.06
331	600039	四川路桥	4,480	35,347.20	0.06
332	301236	软通动力	1,000	35,210.00	0.06
333	002459	晶澳科技	3,128	35,033.60	0.06
334	688180	君实生物	1,200	34,860.00	0.06
335	300474	景嘉微	550	34,776.50	0.06
336	002202	金风科技	5,151	34,614.72	0.06

337	600918	中泰证券	6,100	34,587.00	0.06
338	688126	沪硅产业	2,502	34,552.62	0.06
339	002155	湖南黄金	1,900	34,390.00	0.06
340	603160	汇顶科技	500	34,375.00	0.06
341	600282	南钢股份	6,900	34,362.00	0.06
342	000703	恒逸石化	4,838	34,301.42	0.06
343	600521	华海药业	2,000	34,100.00	0.06
344	603939	益丰药房	1,378	33,829.90	0.06
345	300037	新宙邦	1,180	33,700.80	0.06
346	000408	藏格矿业	1,400	33,698.00	0.06
347	002281	光迅科技	900	33,633.00	0.06
348	601799	星宇股份	300	33,612.00	0.06
349	300450	先导智能	2,020	33,592.60	0.06
350	601997	贵阳银行	6,360	33,517.20	0.06
351	300223	北京君正	600	33,264.00	0.06
352	000733	振华科技	800	33,224.00	0.06
353	603195	公牛集团	429	33,084.48	0.06
354	002064	华峰化学	4,600	32,982.00	0.06
355	603596	伯特利	840	32,676.00	0.06
356	600699	均胜电子	2,200	32,604.00	0.06
357	000617	中油资本	5,900	32,568.00	0.06
358	601162	天风证券	14,930	32,547.40	0.06
359	600863	内蒙华电	7,000	32,480.00	0.06
360	300724	捷佳伟创	600	32,406.00	0.06
361	000878	云南铜业	2,600	32,396.00	0.06
362	300001	特锐德	1,600	32,192.00	0.06
363	601615	明阳智能	3,400	32,096.00	0.06
364	300496	中科创达	700	31,913.00	0.06
365	000021	深科技	2,100	31,752.00	0.06
366	600061	国投资本	5,616	31,730.40	0.06
367	600460	士兰微	1,800	31,518.00	0.06

368	301358	湖南裕能	1,000	31,460.00	0.06
369	600895	张江高科	1,700	31,416.00	0.05
370	603589	口子窖	800	31,352.00	0.05
371	002385	大北农	8,100	31,185.00	0.05
372	300146	汤臣倍健	2,300	31,165.00	0.05
373	002195	岩山科技	12,379	31,071.29	0.05
374	300395	菲利华	1,000	30,750.00	0.05
375	600298	安琪酵母	1,100	30,723.00	0.05
376	688122	西部超导	800	30,656.00	0.05
377	300751	迈为股份	256	30,586.88	0.05
378	002595	豪迈科技	800	30,536.00	0.05
379	601881	中国银河	2,800	30,408.00	0.05
380	600132	重庆啤酒	500	30,350.00	0.05
381	600970	中材国际	2,500	30,150.00	0.05
382	300999	金龙鱼	1,100	30,085.00	0.05
383	600018	上港集团	5,200	30,056.00	0.05
384	002738	中矿资源	1,120	30,016.00	0.05
385	300529	健帆生物	1,100	29,931.00	0.05
386	300058	蓝色光标	5,500	29,920.00	0.05
387	000708	中信特钢	2,200	29,854.00	0.05
388	689009	九号公司	800	29,448.00	0.05
389	600486	扬农化工	520	29,354.00	0.05
390	000598	兴蓉环境	3,900	29,328.00	0.05
391	603816	顾家家居	900	29,061.00	0.05
392	000830	鲁西化工	2,500	28,975.00	0.05
393	600118	XD中国卫	1,300	28,899.00	0.05
394	300413	芒果超媒	1,370	28,633.00	0.05
395	000723	美锦能源	6,000	28,560.00	0.05
396	688303	大全能源	1,400	28,546.00	0.05
397	600566	济川药业	900	28,539.00	0.05
398	002432	九安医疗	700	28,378.00	0.05

399	002152	广电运通	2,700	28,242.00	0.05
400	002410	广联达	2,940	28,165.20	0.05
401	601696	中银证券	3,100	28,148.00	0.05
402	000738	航发控制	1,400	28,098.00	0.05
403	600380	健康元	2,504	27,969.68	0.05
404	601628	中国人寿	900	27,945.00	0.05
405	000519	中兵红箭	1,900	27,873.00	0.05
406	600499	科达制造	3,300	27,819.00	0.05
407	300699	光威复材	1,120	27,809.60	0.05
408	002821	凯莱英	420	27,636.00	0.05
409	600998	九州通	5,650	27,572.00	0.05
410	603806	福斯特	1,875	27,562.50	0.05
411	300073	当升科技	800	27,448.00	0.05
412	000623	吉林敖东	2,043	27,376.20	0.05
413	000729	燕京啤酒	3,100	27,373.00	0.05
414	600637	东方明珠	4,490	27,299.20	0.05
415	300024	机器人	2,780	27,077.20	0.05
416	601198	东兴证券	3,400	27,064.00	0.05
417	601216	君正集团	7,300	26,937.00	0.05
418	688772	珠海冠宇	1,800	26,820.00	0.05
419	600392	盛和资源	3,110	26,808.20	0.05
420	600820	隧道股份	4,101	26,779.53	0.05
421	002294	信立泰	1,000	26,630.00	0.05
422	000998	隆平高科	2,700	26,541.00	0.05
423	600143	金发科技	4,000	26,440.00	0.05
424	688223	晶科能源	3,700	26,270.00	0.05
425	601865	福莱特	1,300	26,130.00	0.05
426	600909	XD华安证	6,190	26,059.90	0.05
427	601456	国联证券	2,700	26,028.00	0.05
428	601665	齐鲁银行	5,300	26,023.00	0.05
429	600867	通化东宝	3,100	25,947.00	0.05

430	000883	湖北能源	4,300	25,843.00	0.05
431	600369	西南证券	7,200	25,776.00	0.05
432	300677	英科医疗	960	25,737.60	0.05
433	600008	首创环保	9,500	25,460.00	0.04
434	605358	立昂微	1,100	25,454.00	0.04
435	000591	太阳能	5,400	25,434.00	0.04
436	300088	长信科技	5,400	25,380.00	0.04
437	601016	节能风电	8,480	25,355.20	0.04
438	600754	锦江酒店	1,100	25,278.00	0.04
439	300454	深信服	500	25,265.00	0.04
440	600704	物产中大	5,800	25,172.00	0.04
441	600535	天士力	2,000	25,160.00	0.04
442	688002	睿创微纳	899	25,145.03	0.04
443	600755	厦门国贸	3,500	25,095.00	0.04
444	300487	蓝晓科技	600	25,056.00	0.04
445	000997	新大陆	1,800	25,038.00	0.04
446	603899	晨光股份	800	25,024.00	0.04
447	600153	建发股份	2,800	25,004.00	0.04
448	601916	浙商银行	9,000	24,840.00	0.04
449	600582	天地科技	3,600	24,804.00	0.04
450	600170	上海建工	11,500	24,725.00	0.04
451	600038	中直股份	600	24,666.00	0.04
452	300568	星源材质	3,000	24,600.00	0.04
453	002120	韵达股份	3,164	24,489.36	0.04
454	000027	深圳能源	3,340	24,382.00	0.04
455	600580	卧龙电驱	1,999	24,287.85	0.04
456	002439	启明星辰	1,400	24,164.00	0.04
457	603290	斯达半导	280	24,110.80	0.04
458	601231	环旭电子	1,500	24,075.00	0.04
459	002831	裕同科技	940	24,054.60	0.04
460	600325	华发股份	3,700	24,050.00	0.04

460	002429	兆驰股份	5,000	24,050.00	0.04
461	600498	烽火通信	1,512	24,040.80	0.04
462	601966	玲珑轮胎	1,300	23,881.00	0.04
463	603893	瑞芯微	400	23,668.00	0.04
464	300383	光环新网	2,800	23,660.00	0.04
465	002841	视源股份	800	23,624.00	0.04
466	300373	扬杰科技	600	23,340.00	0.04
467	002756	永兴材料	650	23,257.00	0.04
468	000629	钒钛股份	9,300	23,250.00	0.04
469	600673	东阳光	3,300	23,232.00	0.04
470	002497	雅化集团	2,600	23,192.00	0.04
471	600655	豫园股份	4,500	23,175.00	0.04
472	300601	康泰生物	1,480	23,102.80	0.04
473	601598	中国外运	4,100	23,083.00	0.04
474	002926	华西证券	3,500	23,065.00	0.04
475	600737	中粮糖业	2,400	23,016.00	0.04
476	603568	伟明环保	1,118	23,008.44	0.04
477	002850	科达利	300	22,914.00	0.04
478	601958	金钼股份	2,200	22,902.00	0.04
479	600563	法拉电子	300	22,854.00	0.04
480	600732	爱旭股份	2,520	22,806.00	0.04
481	603927	中科软	1,260	22,793.40	0.04
482	600021	上海电力	2,300	22,747.00	0.04
483	002373	千方科技	2,500	22,675.00	0.04
484	603486	科沃斯	480	22,646.40	0.04
485	688363	华熙生物	400	22,628.00	0.04
486	601636	旗滨集团	3,500	22,575.00	0.04
486	600009	上海机场	700	22,575.00	0.04
487	603658	安图生物	490	22,574.30	0.04
488	002557	洽洽食品	800	22,552.00	0.04
489	002958	青农商行	8,400	22,512.00	0.04

490	688220	翱捷科技	600	22,476.00	0.04
491	300253	卫宁健康	3,800	22,420.00	0.04
491	002624	完美世界	2,950	22,420.00	0.04
492	601808	中海油服	1,300	22,360.00	0.04
493	600166	福田汽车	9,900	22,275.00	0.04
494	600373	中文传媒	1,500	22,260.00	0.04
495	603659	璞泰来	1,575	22,254.75	0.04
496	002430	杭氧股份	1,000	22,250.00	0.04
497	002500	山西证券	4,730	22,231.00	0.04
498	000636	风华高科	1,700	22,202.00	0.04
499	601866	中远海发	8,600	22,188.00	0.04
500	002065	东华软件	4,900	22,148.00	0.04
501	002683	广东宏大	1,100	22,143.00	0.04
502	002414	高德红外	3,744	22,052.16	0.04
503	000887	中鼎股份	1,800	22,032.00	0.04
504	603077	和邦生物	13,300	21,945.00	0.04
505	600901	江苏金租	4,340	21,917.00	0.04
506	300251	光线传媒	2,600	21,866.00	0.04
507	002299	圣农发展	1,600	21,824.00	0.04
508	600707	彩虹股份	3,200	21,792.00	0.04
509	300604	长川科技	800	21,736.00	0.04
510	300919	中伟股份	700	21,693.00	0.04
511	600516	方大炭素	5,033	21,692.23	0.04
512	002407	多氟多	1,760	21,524.80	0.04
513	300009	安科生物	2,516	21,486.64	0.04
514	002572	索菲亚	1,400	21,462.00	0.04
515	002508	老板电器	970	21,437.00	0.04
516	002372	伟星新材	1,380	21,279.60	0.04
517	600528	中铁工业	2,900	21,228.00	0.04
518	002056	横店东磁	1,700	21,199.00	0.04
519	002936	郑州银行	12,223	21,145.79	0.04

520	002408	齐翔腾达	3,776	21,145.60	0.04
521	600859	王府井	1,800	21,132.00	0.04
522	600884	杉杉股份	2,600	21,112.00	0.04
523	000893	亚钾国际	1,300	21,008.00	0.04
524	600258	XD首旅酒	1,700	20,995.00	0.04
525	002506	协鑫集成	10,800	20,952.00	0.04
526	002268	电科网安	1,470	20,918.10	0.04
527	601880	辽港股份	17,000	20,910.00	0.04
528	600801	华新水泥	1,520	20,900.00	0.04
529	002203	海亮股份	2,600	20,748.00	0.04
530	300748	金力永磁	1,600	20,736.00	0.04
531	002507	涪陵榨菜	1,690	20,702.50	0.04
532	603833	欧派家居	380	20,352.80	0.04
533	002244	滨江集团	2,800	20,328.00	0.04
534	300296	利亚德	4,500	20,250.00	0.04
535	002240	盛新锂能	1,500	20,130.00	0.04
536	600739	辽宁成大	2,400	20,088.00	0.04
537	600598	北大荒	1,600	19,984.00	0.03
538	600196	复星医药	900	19,926.00	0.03
539	002568	百润股份	1,180	19,859.40	0.03
540	600390	五矿资本	4,900	19,845.00	0.03
541	300070	碧水源	4,732	19,827.08	0.03
542	002019	亿帆医药	1,601	19,788.36	0.03
543	600399	抚顺特钢	3,500	19,705.00	0.03
544	000050	深天马 A	2,700	19,656.00	0.03
545	600848	上海临港	2,156	19,641.16	0.03
546	600329	达仁堂	600	19,434.00	0.03
547	300118	东方日升	1,600	19,360.00	0.03
548	002080	中材科技	1,500	19,350.00	0.03
549	688538	和辉光电	9,600	19,008.00	0.03
550	688385	复旦微电	600	18,828.00	0.03

551	002531	天顺风能	2,100	18,774.00	0.03
552	601098	中南传媒	1,500	18,630.00	0.03
553	603228	景旺电子	584	18,571.20	0.03
554	603858	步长制药	1,224	18,543.60	0.03
555	600968	海油发展	4,500	18,540.00	0.03
556	002368	太极股份	820	18,491.00	0.03
557	000778	新兴铸管	5,300	18,444.00	0.03
558	600271	航天信息	2,500	18,400.00	0.03
559	000155	川能动力	1,700	18,309.00	0.03
560	002939	长城证券	2,700	18,090.00	0.03
561	300390	天华新能	1,040	17,867.20	0.03
562	000709	河钢股份	9,200	17,848.00	0.03
563	603688	石英股份	600	17,766.00	0.03
564	601155	新城控股	2,000	17,740.00	0.03
565	600663	陆家嘴	2,000	17,640.00	0.03
566	601928	凤凰传媒	1,600	17,536.00	0.03
567	300676	华大基因	500	17,505.00	0.03
568	688029	南微医学	282	17,359.92	0.03
569	600378	昊华科技	600	17,340.00	0.03
570	601118	海南橡胶	3,800	17,290.00	0.03
571	600435	XD北方导	2,000	17,240.00	0.03
572	600062	华润双鹤	880	17,230.40	0.03
573	601298	青岛港	1,800	17,208.00	0.03
574	688516	奥特维	406	16,974.86	0.03
575	600959	江苏有线	6,424	16,959.36	0.03
576	000825	太钢不锈	5,000	16,900.00	0.03
577	600416	湘电股份	1,700	16,898.00	0.03
578	600131	国网信通	1,000	16,870.00	0.03
579	688065	凯赛生物	368	16,703.52	0.03
580	603883	老百姓	902	16,560.72	0.03
581	000987	越秀资本	3,335	16,541.60	0.03

582	600517	国网英大	3,800	16,454.00	0.03
583	000800	一汽解放	2,100	16,443.00	0.03
584	603712	七一二	900	16,371.00	0.03
585	603882	金域医学	600	16,314.00	0.03
586	300558	贝达药业	500	16,275.00	0.03
587	601991	大唐发电	5,400	16,254.00	0.03
588	000937	冀中能源	2,400	16,080.00	0.03
589	688521	芯原股份	600	16,050.00	0.03
590	600155	华创云信	2,700	15,957.00	0.03
591	688520	神州细胞	400	15,740.00	0.03
592	003035	南网能源	3,500	15,400.00	0.03
593	603885	吉祥航空	1,400	15,386.00	0.03
594	688567	孚能科技	1,600	15,360.00	0.03
595	002653	海思科	500	15,350.00	0.03
596	600871	石化油服	8,800	15,312.00	0.03
597	603737	三棵树	420	15,233.40	0.03
598	601872	招商轮船	1,800	15,210.00	0.03
599	603456	九洲药业	1,100	15,092.00	0.03
600	600350	山东高速	1,700	15,045.00	0.03
601	002423	中粮资本	2,000	14,980.00	0.03
602	600316	洪都航空	900	14,967.00	0.03
603	300595	欧普康视	940	14,739.20	0.03
604	300776	帝尔激光	320	14,707.20	0.03
605	600208	新湖中宝	9,300	14,694.00	0.03
606	300438	鹏辉能源	800	14,672.00	0.03
607	601608	中信重工	3,800	14,478.00	0.03
608	600022	山东钢铁	11,800	14,396.00	0.03
609	300357	我武生物	700	14,154.00	0.02
610	603379	三美股份	360	14,090.40	0.02
611	603233	大参林	979	13,999.70	0.02
612	601106	中国一重	6,000	13,860.00	0.02

612	600377	宁沪高速	1,100	13,860.00	0.02
613	601611	中国核建	1,700	13,753.00	0.02
614	600967	内蒙一机	1,900	13,680.00	0.02
615	600481	双良节能	2,900	13,543.00	0.02
616	300212	易华录	800	13,464.00	0.02
617	601236	红塔证券	2,090	13,417.80	0.02
618	603127	昭衍新药	1,000	13,270.00	0.02
619	002266	浙富控股	4,700	13,113.00	0.02
620	000559	万向钱潮	2,900	12,934.00	0.02
621	603707	健友股份	1,075	12,771.00	0.02
622	601698	中国卫通	900	12,681.00	0.02
623	000156	华数传媒	2,000	12,560.00	0.02
624	600827	百联股份	1,700	12,546.00	0.02
625	300763	锦浪科技	300	12,492.00	0.02
626	600315	上海家化	700	12,446.00	0.02
627	002690	美亚光电	750	12,375.00	0.02
628	601992	金隅集团	9,000	12,330.00	0.02
629	603517	绝味食品	800	12,320.00	0.02
630	600126	杭钢股份	2,980	12,247.80	0.02
631	000563	陕国投A	4,330	11,907.50	0.02
632	000967	盈峰环境	2,800	11,844.00	0.02
633	603650	彤程新材	400	11,820.00	0.02
634	688561	奇安信	500	11,810.00	0.02
635	600764	中国海防	600	11,778.00	0.02
636	002867	周大生	900	11,754.00	0.02
637	688005	容百科技	500	11,640.00	0.02
638	600339	中油工程	3,700	11,544.00	0.02
639	000537	中绿电	1,200	11,436.00	0.02
640	603218	日月股份	1,100	11,297.00	0.02
641	000898	鞍钢股份	5,260	11,151.20	0.02
642	600500	中化国际	3,080	10,749.20	0.02

643	600808	马钢股份	5,300	10,706.00	0.02
644	300888	稳健医疗	420	10,626.00	0.02
645	000785	居然之家	4,300	10,449.00	0.02
646	300682	朗新集团	1,200	10,212.00	0.02
647	002153	石基信息	1,731	9,918.63	0.02
648	000401	冀东水泥	2,400	9,744.00	0.02
649	001872	招商港口	500	9,625.00	0.02
650	603185	弘元绿能	559	9,553.31	0.02
651	600928	西安银行	2,900	9,483.00	0.02
652	000959	首钢股份	3,400	9,248.00	0.02
653	601568	北元集团	2,480	9,200.80	0.02
654	601139	深圳燃气	1,300	8,684.00	0.02
655	688779	长远锂科	1,800	8,334.00	0.01
656	601228	广州港	2,700	8,235.00	0.01
657	603317	天味食品	703	8,021.23	0.01
658	603056	德邦股份	600	7,860.00	0.01
659	600299	安迪苏	800	7,760.00	0.01
660	300861	美畅股份	400	7,740.00	0.01
661	001289	龙源电力	400	6,900.00	0.01
662	000031	大悦城	2,800	6,552.00	0.01
663	688006	杭可科技	281	4,903.45	0.01
664	001203	大中矿业	500	4,805.00	0.01
665	301029	怡合达	240	4,718.40	0.01
666	600927	永安期货	400	4,460.00	0.01
667	603868	飞科电器	100	3,840.00	0.01
668	601828	美凯龙	1,150	2,932.50	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	603355	莱克电气	80	1,728.00	0.00
2	000975	银泰黄金	80	1,303.20	0.00
3	600160	巨化股份	50	1,206.50	0.00
4	300244	迪安诊断	80	960.00	0.00
5	000547	航天发展	97	568.42	0.00
6	600167	联美控股	90	468.90	0.00
7	000970	中科三环	40	306.00	0.00
8	002030	达安基因	58	290.00	0.00
9	603866	桃李面包	43	218.01	0.00
10	002925	盈趣科技	10	126.70	0.00
11	000930	中粮科技	12	60.36	0.00
12	600606	绿地控股	34	45.90	0.00
13	002468	申通快递	1	8.40	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	603156	养元饮品	479,426.00	0.73
2	601600	中国铝业	389,538.00	0.59
3	000895	双汇发展	364,295.00	0.55
4	002252	上海莱士	330,524.00	0.50
5	600529	山东药玻	323,972.00	0.49
6	000807	云铝股份	299,510.00	0.46
7	002128	电投能源	292,895.00	0.45
8	000933	神火股份	285,161.00	0.43
9	600160	巨化股份	283,251.00	0.43
10	600161	天坛生物	277,925.00	0.42

11	002007	华兰生物	274,172.00	0.42
12	002532	天山铝业	234,417.00	0.36
13	600809	山西汾酒	228,765.00	0.35
14	002648	卫星化学	221,240.00	0.34
15	300760	迈瑞医疗	213,143.00	0.32
16	600938	中国海油	202,896.00	0.31
17	600096	云天化	197,224.00	0.30
18	600141	兴发集团	197,128.00	0.30
19	601857	中国石油	190,534.00	0.29
20	601919	中远海控	178,782.00	0.27

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	000932	华菱钢铁	682,711.00	1.04
2	600066	宇通客车	610,555.00	0.93
3	000333	美的集团	609,657.00	0.93
4	000975	山金国际	606,704.00	0.92
5	603707	健友股份	596,273.40	0.91
6	600873	梅花生物	567,398.00	0.86
7	600489	中金黄金	533,184.00	0.81
8	600901	江苏金租	472,868.00	0.72
9	002155	湖南黄金	424,638.00	0.65
10	601668	中国建筑	391,554.00	0.60
11	600547	山东黄金	390,394.00	0.59
12	601318	中国平安	365,602.00	0.56
13	601168	西部矿业	365,065.00	0.56

14	002463	沪电股份	344,629.00	0.52
15	600519	贵州茅台	334,306.00	0.51
16	000739	普洛药业	332,040.00	0.50
17	600160	巨化股份	331,241.00	0.50
18	000513	丽珠集团	307,797.00	0.47
19	600153	建发股份	282,560.00	0.43
20	000858	五粮液	272,072.00	0.41

注：本项的"卖出金额"均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	14,552,921.71
卖出股票收入（成交）总额	23,246,640.63

注：本项"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【招商银行股份有限公司】于2023年11月27日收到国家外汇管理局深圳市分局出具罚款处罚、没收违法所得的通报，于2023年12月13日收到国家金融监督管理总局深圳监管局出具公开处罚的通报，于2024年06月24日收到国家金融监督管理总局出具公开处罚的通报。本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

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	19,762.77
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	157,042.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	176,805.74

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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
天弘中证800A	3,282	9,384.50	2,499,805.49	8.12%	28,300,108.78	91.88%
天弘中证800C	3,433	7,114.83	4,189,213.62	17.15%	20,236,006.44	82.85%
合计	6,588	8,382.69	6,689,019.11	12.11%	48,536,115.22	87.89%

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	天弘中证800A	20,940.73	0.07%
	天弘中证800C	2,086.32	0.01%

	合计	23,027.05	0.04%
--	----	-----------	-------

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	天弘中证800A	0
	天弘中证800C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证800A	0~10
	天弘中证800C	0
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立后有10,000,000.00份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为2015年07月16日至2018年07月16日。截至本报告期末，发起资金持有份额为0.00份。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证800A	天弘中证800C
基金合同生效日(2015年07月16日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	30,607,096.86	33,488,146.47
本报告期基金总申购份额	4,088,280.67	19,406,372.50
减：本报告期基金总赎回份额	3,895,463.26	28,469,298.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	30,799,914.27	24,425,220.06

§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

本报告期内，聂挺进先生担任公司副总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，本基金托管人不涉及公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

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，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

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，本基金托管人的专门基金托管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	
东方财富证券	2	-	-	-	-	-

东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	37,799,562.34	100.00%	9,294.71	100.00%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；具有较强的综合服务能力，能及时、全面提供高质量的关于宏观策略、行业、资本市场、个股分析的研究服务及丰富全面的信息咨询服务；具有较强的证券交易服务能力，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务及合理的佣金费率。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	200,594.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2024-01-22

2	天弘基金将严格落实《证监会新闻发言人就“两融”融券业务有关情况答记者问》相关要求	中国证监会规定媒介	2024-02-06
3	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2023年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-03-29
4	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-30
5	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2024-04-22
6	天弘中证800指数型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28
7	天弘中证800指数型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240101-20240104, 20240201-20240201, 20240304-	12,890,750.89	-	8,701,537.27	4,189,213.62	7.59%

	20240415				
产品特有风险					
<p>基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>(1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；</p> <p>(2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；</p> <p>(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；</p> <p>(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；</p> <p>(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p>					

注：份额占比精度处理方式四舍五入。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证800指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证800指数型发起式证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二四年八月三十日