

天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金  
2025 年中期报告

2025 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:2025 年 08 月 29 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2025年08月27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01月01日起至2025年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§1</b>	<b>重要提示及目录</b>	<b>2</b>
<b>1.1</b>	<b>重要提示</b>	<b>2</b>
<b>1.2</b>	<b>目录</b>	<b>3</b>
<b>§2</b>	<b>基金简介</b>	<b>5</b>
<b>2.1</b>	<b>基金基本情况</b>	<b>5</b>
<b>2.2</b>	<b>基金产品说明</b>	<b>5</b>
<b>2.3</b>	<b>基金管理人和基金托管人</b>	<b>6</b>
<b>2.4</b>	<b>信息披露方式</b>	<b>6</b>
<b>2.5</b>	<b>其他相关资料</b>	<b>6</b>
<b>§3</b>	<b>主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
<b>3.1</b>	<b>主要会计数据和财务指标</b>	<b>7</b>
<b>3.2</b>	<b>基金净值表现</b>	<b>7</b>
<b>§4</b>	<b>管理人报告</b>	<b>9</b>
<b>4.1</b>	<b>基金管理人及基金经理情况</b>	<b>9</b>
<b>4.2</b>	<b>管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明</b>	<b>11</b>
<b>4.3</b>	<b>管理人对报告期内公平交易情况的专项说明</b>	<b>11</b>
<b>4.4</b>	<b>管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明</b>	<b>11</b>
<b>4.5</b>	<b>管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望</b>	<b>12</b>
<b>4.6</b>	<b>管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明</b>	<b>12</b>
<b>4.7</b>	<b>管理人对报告期内基金利润分配情况的说明</b>	<b>13</b>
<b>4.8</b>	<b>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</b>	<b>13</b>
<b>§5</b>	<b>托管人报告</b>	<b>13</b>
<b>5.1</b>	<b>报告期内本基金托管人遵规守信情况声明</b>	<b>13</b>
<b>5.2</b>	<b>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</b>	<b>13</b>
<b>5.3</b>	<b>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</b>	<b>13</b>
<b>§6</b>	<b>半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
<b>6.1</b>	<b>资产负债表</b>	<b>14</b>
<b>6.2</b>	<b>利润表</b>	<b>15</b>
<b>6.3</b>	<b>净资产变动表</b>	<b>17</b>
<b>6.4</b>	<b>报表附注</b>	<b>19</b>
<b>§7</b>	<b>投资组合报告</b>	<b>42</b>
<b>7.1</b>	<b>期末基金资产组合情况</b>	<b>42</b>
<b>7.2</b>	<b>报告期末按行业分类的股票投资组合</b>	<b>42</b>
<b>7.3</b>	<b>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</b>	<b>43</b>
<b>7.4</b>	<b>报告期内股票投资组合的重大变动</b>	<b>62</b>
<b>7.5</b>	<b>期末按债券品种分类的债券投资组合</b>	<b>64</b>
<b>7.6</b>	<b>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</b>	<b>64</b>
<b>7.7</b>	<b>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</b>	<b>64</b>
<b>7.8</b>	<b>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</b>	<b>64</b>
<b>7.9</b>	<b>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</b>	<b>64</b>
<b>7.10</b>	<b>本基金投资股指期货的投资政策</b>	<b>64</b>
<b>7.11</b>	<b>报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明</b>	<b>65</b>
<b>7.12</b>	<b>投资组合报告附注</b>	<b>65</b>
<b>§8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>66</b>
<b>8.1</b>	<b>期末基金份额持有人户数及持有人结构</b>	<b>66</b>
<b>8.2</b>	<b>期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况</b>	<b>66</b>

---

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.....	67
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	67
§9 开放式基金份额变动.....	67
§10 重大事件揭示.....	67
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
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 .....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
10.4 基金投资策略的改变 .....	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
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 .....	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
10.8 其他重大事件 .....	69
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
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.....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
§12 备查文件目录.....	71
12.1 备查文件目录 .....	71
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

## §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	40,263,721.46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	20,106,373.65份	20,157,347.81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		黄辰立	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 (2025年01月01日-2025年06月30日)	
	天弘中证800A	天弘中证800C
本期已实现收益	-321,165.45	-374,237.35
本期利润	410,932.14	362,322.82
加权平均基金份额本期利润	0.0193	0.0158
本期加权平均净值利润率	1.64%	1.37%
本期基金份额净值增长率	1.64%	1.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
期末可供分配利润	4,316,224.28	3,808,198.89
期末可供分配基金份额利润	0.2147	0.1889
期末基金资产净值	24,422,597.93	23,965,546.70
期末基金份额净值	1.2147	1.1889
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	21.47%	18.89%

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	3.29%	0.54%	2.82%	0.59%	0.47%	-0.05%
过去三个月	1.76%	1.09%	1.15%	1.12%	0.61%	-0.03%
过去六个月	1.64%	1.00%	0.87%	1.03%	0.77%	-0.03%
过去一年	16.41%	1.36%	14.55%	1.38%	1.86%	-0.02%
过去三年	-4.39%	1.06%	-10.57%	1.08%	6.18%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	21.47%	1.24%	-5.27%	1.25%	26.74%	-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	3.27%	0.53%	2.82%	0.59%	0.45%	-0.06%
过去三个月	1.70%	1.09%	1.15%	1.12%	0.55%	-0.03%
过去六个月	1.53%	1.00%	0.87%	1.03%	0.66%	-0.03%
过去一年	16.17%	1.36%	14.55%	1.38%	1.62%	-0.02%
过去三年	-4.96%	1.06%	-10.57%	1.08%	5.61%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	18.89%	1.24%	-5.27%	1.25%	24.16%	-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-2025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-2025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，注册资本金为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2025年06月30日，公司共管理运作223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	-	10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遵规守信情况的说明

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0次，未发生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极小化。

报告期内，本基金的跟踪误差主要来自申购赎回变动、基准指数权重定期调整等情况导致的结构变化。本基金坚持既定的指数化投资策略，报告期内，本基金整体运行平稳，日均跟踪偏离和年化跟踪误差均控制在合理范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年06月30日，天弘中证800A基金份额净值为1.2147元，天弘中证800C基金份额净值为1.1889元。报告期内份额净值增长率天弘中证800A为1.64%，同期业绩比较基准增长率为0.87%；天弘中证800C为1.53%，同期业绩比较基准增长率为0.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年上半年整体而言，A股结构上中小股表现更好，而港股整体指数呈现牛市行情。2025年上半年，A股万得全A指数微涨，风格上小盘相对占优，中证1000、科创综指、北证50等指数显著上涨。行业层面，二季度海外关税扰动反复下有色金属涨幅排名第一，外部不确定下市场重心逐步转移至内需方向，以IP经济、宠物经济、医美等方向为主的新消费方向走高，另外AI和机器人相关的汽车、机械、轻工、计算机等行业同样表现靠前。由于上半年的行情热点和主线，从产业视角来看，恰好也是港股的权重板块，包括AI相关的互联网，新消费相关的电动车和社服零售，还有创新药和央国企等，这些权重板块表现亮眼带动指数上扬，港股呈现牛市行情。展望下半年，我们认为市场在三季度可能存在较为短暂的阶段性压力，主要因素是市场整体对关税政策的不确定性担忧以及国内宽信用政策发力滞后的影响。但到四季度，我们预计大概率会有更多的支持政策出台，包括国内货币和宽信用政策等，观察的关键点在于出口状态的变化。我们认为，如果后续政策落地，将再次提升市场整体的风险偏好，有利于股票市场整体延续强势表现。

#### 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2025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：2025年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	2,539,029.79	2,982,523.40
结算备付金		17,838.31	18,701.88
存出保证金		5,095.28	19,112.93
交易性金融资产	6.4.7.2	45,836,336.17	52,365,627.31
其中：股票投资		45,836,336.17	52,365,627.31
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		677,825.30	100,839.04
应收股利		-	-
应收申购款		58,449.55	159,170.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		49,134,574.40	55,645,975.11
<b>负债和净资产</b>	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
<b>负债：</b>			

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		656,778.25	322,181.67
应付管理人报酬		20,119.13	23,823.59
应付托管费		4,023.82	4,764.73
应付销售服务费		4,051.88	4,939.62
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	61,456.69	132,935.04
负债合计		746,429.77	488,644.65
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	40,263,721.46	46,641,733.84
未分配利润	6.4.7.8	8,124,423.17	8,515,596.62
净资产合计		48,388,144.63	55,157,330.46
负债和净资产总计		49,134,574.40	55,645,975.11

注：报告截止日2025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1.2147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1.1889元；基金份额总额40,263,721.46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20,106,373.65份，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额20,157,347.81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：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年01月01日至	上年度可比期间 2024年01月01日至202
----	-----	--------------------	----------------------------

		2025年06月30日	4年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		1,015,134.99	1,102,894.04
1.利息收入		10,673.77	13,099.43
其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,673.77	13,099.43
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“-”号填列）		-465,095.16	-899,768.96
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,084,940.24	-1,694,268.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	148.41	271.59
资产支持证券投资收益	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	619,696.67	794,228.17
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	1,468,657.76	1,984,824.65
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	898.62	4,738.92
<b>减：二、营业总支出</b>		241,880.03	296,600.93
1.管理人报酬		128,123.85	155,108.61
2.托管费		25,624.77	31,021.71
3.销售服务费		26,304.88	29,822.13

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	61,826.53	80,648.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		773,254.96	806,293.11
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		773,254.96	806,293.11
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		773,254.96	806,293.11

### 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：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2025年01月01日至2025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	46,641,733.84	8,515,596.62	55,157,330.46
二、本期期初净资产	46,641,733.84	8,515,596.62	55,157,330.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,378,012.38	-391,173.45	-6,769,185.83
(一)、综合收益总额	-	773,254.96	773,254.96

(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)	-6,378,012.38	-1,164,428.41	-7,542,440.79
其中: 1.基金申购款	13,391,542.69	2,080,080.56	15,471,623.25
2.基金赎回款	-19,769,555.07	-3,244,508.97	-23,014,064.04
(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	40,263,721.46	8,124,423.17	48,388,144.63
项目	上年度可比期间 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
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

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指数量型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）系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指数量型发起式证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2015年07月16日生效，首次设立募集规模为10,000,000.00份基金份额。本基金的运作方式为契约型开放式、发起式，存续期限不定。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。

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。

#### 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

本基金2025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2025年06月30日的财务状况以及2025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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、

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》、财税[2017]2号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

b) 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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

d) 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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## 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06月30日
活期存款	2,539,029.79
等于：本金	2,538,502.60
加：应计利息	527.19
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	2,539,029.79

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	44,992,016.17	-	45,836,336.17	844,320.00
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	44,992,016.17	-	45,836,336.17	844,320.00

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 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	37.24
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,912.08
其中：交易所市场	1,912.08
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	59,507.37
合计	61,456.69

### 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 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	22,392,931.87	22,392,931.87
本期申购	2,075,803.12	2,075,803.12
本期赎回(以“-”号填列)	-4,362,361.34	-4,362,361.34
本期末	20,106,373.65	20,106,373.65

#### 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 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	24,248,801.97	24,248,801.97
本期申购	11,315,739.57	11,315,739.57
本期赎回(以“-”号填列)	-15,407,193.73	-15,407,193.73
本期末	20,157,347.81	20,157,347.81

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	10,710,495.40	-6,340,617.95	4,369,877.45
本期期初	10,710,495.40	-6,340,617.95	4,369,877.45
本期利润	-321,165.45	732,097.59	410,932.14
本期基金份额交易产生的变动数	-1,083,870.05	619,284.74	-464,585.31

其中：基金申购款	990,383.56	-634,983.56	355,400.00
基金赎回款	-2,074,253.61	1,254,268.30	-819,985.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,305,459.90	-4,989,235.62	4,316,224.28

#### 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	10,958,546.80	-6,812,827.63	4,145,719.17
本期期初	10,958,546.80	-6,812,827.63	4,145,719.17
本期利润	-374,237.35	736,560.17	362,322.82
本期基金份额交易产 生的变动数	-1,803,338.35	1,103,495.25	-699,843.10
其中：基金申购款	5,081,309.09	-3,356,628.53	1,724,680.56
基金赎回款	-6,884,647.44	4,460,123.78	-2,424,523.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,780,971.10	-4,972,772.21	3,808,198.89

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	10,637.23
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	9.34
其他	27.20
合计	10,673.77

#### 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
	2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	9,780,785.12
减：卖出股票成本总额	10,857,391.24
减：交易费用	8,334.12
买卖股票差价收入	-1,084,940.24

#### 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
	2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	114.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	34.00
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	148.41

##### 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
	2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	100,370.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	99,847.00
减：应计利息总额	489.42
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	34.00

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期末取得资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期末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**

本基金本报告期末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**

本基金本报告期末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 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	619,696.67
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	619,696.67

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	1,468,657.76
——股票投资	1,468,657.76
——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	1,468,657.76

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	884.47
基金转换费收入	14.15
合计	898.62

#### 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
	2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
指数使用费	2,314.89
存托服务费	4.27
合计	61,826.53

#### 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		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年06月30日	占当期股票成交总额的比例	2024年01月01日至2024年06月30日	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	9,558,525.73	75.57%	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 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
广发证券股份有限公司	199,728.00	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

#### 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01月01日至2025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	1,987.70	75.57%	1,269.52	66.39%
关联方名称	上年度可比期间 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%
------------	----------	---------	----------	---------

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、根据《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，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。该类佣金协议已根据此规定完成了更新。

#### 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01月01日至20 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	128,123.85	155,108.61
其中：应支付销售机构的客户维护费	55,540.08	58,197.35
应支付基金管理人的净管理费	72,583.77	96,911.26

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 2025年01月01日至2025 年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年06月30日
----	-----------------------------------	--

当期发生的基金应支付的托管费	25,624.77	31,021.71
----------------	-----------	-----------

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 2025年01月01日至2025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	-	5,383.49	5,383.49
广发证券股份有限公司	-	150.46	150.46
合计	-	5,533.95	5,533.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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的销售服务费率为0.20%。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

本报告期末及上年度末无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800C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### **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		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年06月30日	2024年01月01日至2024年06月30日	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限	2,539,029.79	10,637.23	3,901,928.16	12,801.18

公司				
----	--	--	--	--

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2,000股（上年度末：2,000股），估值总额为人民币33,620.00元（上年度末：32,420.00元），占基金净资产的比例为0.07%（上年度末：0.06%）；持有君正集团的股票5,800股（上年度末：7,100股），估值总额为人民币32,016.00元（上年度末：37,346.00元），占基金净资产的比例为0.07%（上年度末：0.07%）。

#### 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

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2025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2025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2025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。

本基金管理人按照“全面管理、专业分工、各司其职”的思路，明确风险管理职责并将其融入组织架构、写入制度、嵌入系统，实施多层次、多角度、全方位的风险管理。一是投资决策实施分层授权管理，投资决策委员会、投资总监、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，根据不同权限实施风险控制；二是按照部门职能执行分工管理，基金经理、中央交易室、研究相关部门、风险管理部、内控合规部、基金运营部等从不同角度、不同环节对投资全过程实行风险监控和管理；三是投资到结算的全流程，已经形成了一套贯穿“事前风险定位、事中风险管理和事后风险评估”的健全风险监控体系。

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债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，对不同的债券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且债券证券公司最近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2025年06月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约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 2025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	2,539,029.79	-	-	-	2,539,029.79
结算备付金	17,838.31	-	-	-	17,838.31
存出保证金	5,095.28	-	-	-	5,095.28
交易性金融资产	-	-	-	45,836,336.17	45,836,336.17
应收清算款	-	-	-	677,825.30	677,825.30
应收申购款	-	-	-	58,449.55	58,449.55
资产总计	2,561,963.38	-	-	46,572,611.02	49,134,574.40
负债					
应付赎回款	-	-	-	656,778.25	656,778.25
应付管理人报酬	-	-	-	20,119.13	20,119.13
应付托管费	-	-	-	4,023.82	4,023.82
应付销售服务费	-	-	-	4,051.88	4,051.88
其他负债	-	-	-	61,456.69	61,456.69

负债总计	-	-	-	746,429.77	746,429.77
利率敏感度缺口	2,561,963.38	-	-	45,826,181.25	48,388,144.63
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	2,982,523.40	-	-	-	2,982,523.40
结算备付金	18,701.88	-	-	-	18,701.88
存出保证金	19,112.93	-	-	-	19,112.93
交易性金融资产	-	-	-	52,365,627.31	52,365,627.31
应收清算款	-	-	-	100,839.04	100,839.04
应收申购款	-	-	-	159,170.55	159,170.55
资产总计	3,020,338.21	-	-	52,625,636.90	55,645,975.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	322,181.67	322,181.67
应付管理人报酬	-	-	-	23,823.59	23,823.59
应付托管费	-	-	-	4,764.73	4,764.73
应付销售服务费	-	-	-	4,939.62	4,939.62
其他负债	-	-	-	132,935.04	132,935.04
负债总计	-	-	-	488,644.65	488,644.65
利率敏感度缺口	3,020,338.21	-	-	52,136,992.25	55,157,330.46

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06月30日，本基金未持有交易性债券投资(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 2025年06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	45,836,336.17	94.73	52,365,627.31	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	45,836,336.17	94.73	52,365,627.31	94.94

注：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。

#### 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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
业绩比较基准上升5%	2,311,708.34	2,713,757.21	
业绩比较基准下降5%	-2,311,708.34	-2,713,757.21	

#### 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06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	45,836,336.17	52,281,153.31
第二层次	-	84,474.00
第三层次	-	-
合计	45,836,336.17	52,365,627.31

###### 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。

对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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

于2025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(2024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	45,836,336.17	93.29
	其中：股票	45,836,336.17	93.29
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	2,556,868.10	5.20
8	其他各项资产	741,370.13	1.51
9	合计	49,134,574.40	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	386,980.00	0.80
B	采矿业	2,350,599.38	4.86
C	制造业	24,733,361.21	51.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,689,118.20	3.49
E	建筑业	914,361.47	1.89
F	批发和零售业	397,089.78	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	1,487,408.48	3.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,376,173.00	4.91
J	金融业	9,807,775.75	20.27
K	房地产业	406,158.42	0.84
L	租赁和商务服务业	410,908.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	516,581.40	1.07
N	水利、环境和公共设施管理业	42,175.44	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	29,682.00	0.06
Q	卫生和社会工作	131,656.64	0.27
R	文化、体育和娱乐业	126,069.00	0.26
S	综合	30,238.00	0.06
	合计	45,836,336.17	94.73

## 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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	1,000	1,409,520.00	2.91
2	300750	宁德时代	4,560	1,150,123.20	2.38
3	601318	XD中国平	18,545	1,028,876.60	2.13
4	600036	招商银行	20,000	919,000.00	1.90
5	600900	长江电力	21,300	641,982.00	1.33
6	601166	兴业银行	27,000	630,180.00	1.30
7	000333	美的集团	8,486	612,689.20	1.27
8	601899	紫金矿业	30,200	588,900.00	1.22
9	002594	比亚迪	1,600	531,056.00	1.10
10	600030	中信证券	16,860	465,673.20	0.96
11	300059	东方财富	19,877	459,755.01	0.95
12	600276	恒瑞医药	8,115	421,168.50	0.87
13	601398	工商银行	55,000	417,450.00	0.86
14	000651	格力电器	9,000	404,280.00	0.84
15	000858	五粮液	3,397	403,903.30	0.83
16	601328	交通银行	45,000	360,000.00	0.74
17	603259	药明康德	5,028	349,697.40	0.72
18	601288	农业银行	58,000	341,040.00	0.70
19	601211	国泰海通	17,774	340,549.84	0.70
20	600887	伊利股份	12,000	334,560.00	0.69
21	600919	江苏银行	27,050	322,977.00	0.67
22	002475	立讯精密	8,782	304,647.58	0.63
23	601816	京沪高铁	51,300	294,975.00	0.61
24	601088	中国神华	7,000	283,780.00	0.59
25	600000	浦发银行	20,200	280,376.00	0.58
26	688981	中芯国际	3,098	273,150.66	0.56
27	601668	中国建筑	45,080	260,111.60	0.54

28	000725	京东方A	63,600	253,764.00	0.52
29	300124	汇川技术	3,800	245,366.00	0.51
30	688041	海光信息	1,700	240,193.00	0.50
31	600031	三一重工	13,000	233,350.00	0.48
32	601728	中国电信	30,000	232,500.00	0.48
33	300308	中际旭创	1,580	230,458.80	0.48
34	600941	中国移动	2,000	225,100.00	0.47
35	300760	迈瑞医疗	1,000	224,750.00	0.46
36	002371	北方华创	500	221,105.00	0.46
37	601601	中国太保	5,850	219,433.50	0.45
38	300502	新易盛	1,680	213,393.60	0.44
39	002352	顺丰控股	4,200	204,792.00	0.42
40	002714	牧原股份	4,800	201,648.00	0.42
41	601006	大秦铁路	29,900	197,340.00	0.41
42	603501	豪威集团	1,500	191,475.00	0.40
43	600016	民生银行	40,040	190,190.00	0.39
44	000338	潍柴动力	12,000	184,560.00	0.38
45	603019	中科曙光	2,600	183,040.00	0.38
46	000001	平安银行	15,000	181,050.00	0.37
47	002415	海康威视	6,475	179,551.75	0.37
48	000063	中兴通讯	5,500	178,695.00	0.37
49	600309	万华化学	3,280	177,972.80	0.37
50	601919	中远海控	11,600	174,464.00	0.36
51	601857	中国石油	20,000	171,000.00	0.35
52	300274	阳光电源	2,516	170,509.32	0.35
53	601229	上海银行	16,070	170,502.70	0.35
54	600028	中国石化	30,000	169,200.00	0.35
55	601818	光大银行	40,000	166,000.00	0.34
56	601169	北京银行	24,000	163,920.00	0.34
57	601012	隆基绿能	10,837	162,771.74	0.34
58	601009	南京银行	14,000	162,680.00	0.34

59	300498	温氏股份	9,500	162,260.00	0.34
60	002142	宁波银行	5,925	162,108.00	0.34
61	600690	海尔智家	6,500	161,070.00	0.33
62	600926	杭州银行	9,520	160,126.40	0.33
63	600660	福耀玻璃	2,800	159,628.00	0.33
64	600089	特变电工	13,050	155,686.50	0.32
65	600406	国电南瑞	6,936	155,435.76	0.32
66	000425	徐工机械	20,000	155,400.00	0.32
67	600809	山西汾酒	880	155,223.20	0.32
68	002230	科大讯飞	3,200	153,216.00	0.32
69	600050	中国联通	28,500	152,190.00	0.31
70	601766	中国中车	21,600	152,064.00	0.31
71	601138	工业富联	6,900	147,522.00	0.30
72	000568	泸州老窖	1,300	147,420.00	0.30
73	603986	兆易创新	1,152	145,762.56	0.30
74	000100	TCL科技	33,660	145,747.80	0.30
75	600019	宝钢股份	22,092	145,586.28	0.30
76	688012	中微公司	797	145,293.10	0.30
77	601688	华泰证券	7,801	138,935.81	0.29
78	601225	陕西煤业	7,000	134,680.00	0.28
79	300476	胜宏科技	1,000	134,380.00	0.28
80	601985	中国核电	14,300	133,276.00	0.28
81	600104	上汽集团	8,300	133,215.00	0.28
82	002027	分众传媒	17,860	130,378.00	0.27
83	600585	海螺水泥	6,001	128,841.47	0.27
84	600150	中国船舶	3,900	126,906.00	0.26
85	601628	中国人寿	3,000	123,570.00	0.26
86	605499	东鹏饮料	390	122,479.50	0.25
87	601838	成都银行	6,000	120,600.00	0.25
88	688256	寒武纪	200	120,300.00	0.25
89	600015	华夏银行	15,000	118,650.00	0.25

90	603288	海天味业	2,997	116,613.27	0.24
91	000157	中联重科	16,000	115,680.00	0.24
92	000625	长安汽车	8,868	113,155.68	0.23
93	600760	中航沈飞	1,924	112,784.88	0.23
94	000792	盐湖股份	6,600	112,728.00	0.23
95	601988	中国银行	20,000	112,400.00	0.23
96	600111	北方稀土	4,500	112,050.00	0.23
97	000807	云铝股份	7,000	111,860.00	0.23
98	603993	洛阳钼业	13,000	109,460.00	0.23
99	600547	山东黄金	3,416	109,072.88	0.23
100	600048	保利发展	13,200	106,920.00	0.22
101	600905	三峡能源	24,900	106,074.00	0.22
102	601390	中国中铁	18,900	106,029.00	0.22
103	600741	华域汽车	6,000	105,900.00	0.22
104	601600	中国铝业	15,000	105,600.00	0.22
105	601939	建设银行	11,000	103,840.00	0.21
106	601888	中国中免	1,700	103,649.00	0.21
107	002050	三花智控	3,913	103,224.94	0.21
108	300015	爱尔眼科	8,243	102,872.64	0.21
109	600489	中金黄金	7,000	102,410.00	0.21
110	688271	联影医疗	801	102,319.74	0.21
111	600415	小商品城	4,900	101,332.00	0.21
112	002241	歌尔股份	4,302	100,322.64	0.21
113	600436	片仔癀	500	100,005.00	0.21
114	600938	中国海油	3,800	99,218.00	0.21
115	000938	紫光股份	4,123	98,910.77	0.20
116	300014	亿纬锂能	2,145	98,262.45	0.20
117	000895	双汇发展	4,000	97,640.00	0.20
118	601989	中国重工	20,900	96,976.00	0.20
119	000977	浪潮信息	1,900	96,672.00	0.20
120	600873	梅花生物	9,000	96,210.00	0.20

121	601916	浙商银行	27,700	93,903.00	0.19
122	600893	航发动力	2,400	92,496.00	0.19
123	002179	中航光电	2,288	92,343.68	0.19
124	002532	天山铝业	11,000	91,410.00	0.19
125	000538	云南白药	1,603	89,431.37	0.18
126	002311	海大集团	1,500	87,885.00	0.18
127	601336	新华保险	1,501	87,808.50	0.18
128	600584	长电科技	2,600	87,594.00	0.18
129	601658	邮储银行	16,000	87,520.00	0.18
130	600999	招商证券	4,940	86,894.60	0.18
131	000630	铜陵有色	26,000	86,840.00	0.18
132	600570	恒生电子	2,586	86,734.44	0.18
133	002422	科伦药业	2,400	86,208.00	0.18
134	000988	华工科技	1,800	84,618.00	0.17
135	300433	蓝思科技	3,700	82,510.00	0.17
136	688008	澜起科技	993	81,426.00	0.17
137	600438	通威股份	4,800	80,400.00	0.17
138	002252	上海莱士	11,700	80,379.00	0.17
139	600177	雅戈尔	11,000	80,300.00	0.17
140	000002	万科A	12,501	80,256.42	0.17
141	002028	思源电气	1,100	80,201.00	0.17
142	600820	隧道股份	13,001	79,306.10	0.16
143	002966	苏州银行	9,020	79,195.60	0.16
144	600795	国电电力	16,000	77,440.00	0.16
145	300408	三环集团	2,300	76,820.00	0.16
146	601100	恒立液压	1,044	75,168.00	0.16
147	601669	中国电建	15,400	74,998.00	0.15
148	600988	赤峰黄金	3,000	74,640.00	0.15
149	000513	丽珠集团	2,061	74,278.44	0.15
150	603799	华友钴业	2,000	74,040.00	0.15
151	600704	物产中大	14,000	73,780.00	0.15

152	600901	江苏金租	12,040	72,962.40	0.15
153	600010	包钢股份	40,500	72,495.00	0.15
154	600655	豫园股份	13,000	72,150.00	0.15
155	600582	天地科技	12,000	71,880.00	0.15
156	000768	中航西飞	2,600	71,084.00	0.15
157	002304	洋河股份	1,100	71,005.00	0.15
158	002460	赣锋锂业	2,041	68,924.57	0.14
159	600183	生益科技	2,265	68,289.75	0.14
160	601360	三六零	6,600	67,320.00	0.14
161	601127	赛力斯	500	67,160.00	0.14
162	300394	天孚通信	840	67,065.60	0.14
163	688036	传音控股	840	66,948.00	0.14
164	600009	上海机场	2,100	66,717.00	0.14
165	600839	四川长虹	6,800	66,096.00	0.14
166	600160	巨化股份	2,300	65,964.00	0.14
167	600863	内蒙华电	16,000	65,760.00	0.14
168	601058	赛轮轮胎	5,000	65,600.00	0.14
169	002001	新和成	3,044	64,745.88	0.13
170	600066	宇通客车	2,600	64,636.00	0.13
171	600989	宝丰能源	4,000	64,560.00	0.13
172	002736	国信证券	5,600	64,512.00	0.13
173	300442	润泽科技	1,300	64,389.00	0.13
174	601186	中国铁建	8,000	64,080.00	0.13
174	002466	天齐锂业	2,000	64,080.00	0.13
175	000408	藏格矿业	1,500	64,005.00	0.13
176	300347	泰格医药	1,200	63,984.00	0.13
177	002517	恺英网络	3,300	63,723.00	0.13
178	600886	国投电力	4,300	63,382.00	0.13
179	600674	川投能源	3,900	62,556.00	0.13
180	000963	华东医药	1,547	62,436.92	0.13
181	002074	国轩高科	1,900	61,674.00	0.13

182	002558	巨人网络	2,600	61,230.00	0.13
183	600115	中国东航	15,100	60,853.00	0.13
184	601555	东吴证券	6,947	60,786.25	0.13
185	000975	山金国际	3,200	60,608.00	0.13
186	600008	首创环保	20,000	60,400.00	0.12
187	301236	软通动力	1,100	60,104.00	0.12
188	000661	长春高新	600	59,508.00	0.12
189	600282	南钢股份	14,000	58,800.00	0.12
190	002195	岩山科技	10,379	58,433.77	0.12
191	002340	格林美	9,200	58,420.00	0.12
192	600426	XD华鲁恒	2,690	58,292.30	0.12
193	600029	南方航空	9,700	57,230.00	0.12
194	600958	东方证券	5,884	56,957.12	0.12
195	601868	中国能建	25,399	56,639.77	0.12
196	600487	亨通光电	3,700	56,610.00	0.12
197	601689	拓普集团	1,195	56,463.75	0.12
198	300207	欣旺达	2,800	56,168.00	0.12
199	001979	招商蛇口	6,400	56,128.00	0.12
200	002261	拓维信息	1,800	55,710.00	0.12
201	601066	中信建投	2,300	55,315.00	0.11
202	601111	中国国航	7,000	55,230.00	0.11
203	300450	先导智能	2,220	55,167.00	0.11
204	601800	中国交建	6,200	55,118.00	0.11
205	600011	华能国际	7,700	54,978.00	0.11
206	601168	西部矿业	3,300	54,879.00	0.11
207	002202	金风科技	5,351	54,847.75	0.11
208	002236	大华股份	3,450	54,786.00	0.11
209	300251	光线传媒	2,700	54,729.00	0.11
210	300418	昆仑万维	1,600	53,808.00	0.11
211	601117	中国化学	7,000	53,690.00	0.11
212	600346	恒力石化	3,720	53,047.20	0.11

213	600219	南山铝业	13,800	52,854.00	0.11
214	600352	浙江龙盛	5,200	52,832.00	0.11
215	601998	中信银行	6,200	52,700.00	0.11
216	600157	永泰能源	39,200	52,528.00	0.11
217	600176	中国巨石	4,601	52,451.40	0.11
218	002294	信立泰	1,100	52,063.00	0.11
219	300661	圣邦股份	715	52,030.55	0.11
220	002648	卫星化学	2,980	51,643.40	0.11
221	002185	华天科技	5,100	51,510.00	0.11
222	002156	通富微电	2,000	51,240.00	0.11
223	300395	菲利华	1,000	51,100.00	0.11
224	002920	德赛西威	500	51,065.00	0.11
225	600372	中航机载	4,200	50,652.00	0.10
226	603369	今世缘	1,300	50,609.00	0.10
227	000066	中国长城	3,400	50,320.00	0.10
228	600588	用友网络	3,761	50,284.57	0.10
229	002273	水晶光电	2,518	50,284.46	0.10
230	600196	复星医药	2,000	50,180.00	0.10
231	601021	春秋航空	900	50,085.00	0.10
232	601717	郑煤机	3,000	49,860.00	0.10
233	601319	中国人保	5,700	49,647.00	0.10
234	301269	华大九天	400	49,552.00	0.10
235	002916	深南电路	457	49,269.17	0.10
236	003816	中国广核	13,500	49,140.00	0.10
237	300896	爱美客	280	48,946.80	0.10
238	002465	海格通信	3,500	48,790.00	0.10
239	600482	中国动力	2,100	48,447.00	0.10
240	600096	云天化	2,200	48,334.00	0.10
241	300017	网宿科技	4,500	48,240.00	0.10
242	600515	海南机场	13,600	48,144.00	0.10
243	002493	荣盛石化	5,800	48,024.00	0.10

244	603392	万泰生物	787	48,007.00	0.10
245	603338	浙江鼎力	1,000	47,400.00	0.10
246	002595	豪迈科技	800	47,376.00	0.10
247	689009	九号公司	800	47,336.00	0.10
248	601633	长城汽车	2,200	47,256.00	0.10
249	600460	XD士兰微	1,900	47,158.00	0.10
250	600879	航天电子	4,500	47,115.00	0.10
251	600928	西安银行	12,000	47,040.00	0.10
252	601128	常熟银行	6,380	47,020.60	0.10
253	300122	智飞生物	2,400	47,016.00	0.10
254	002601	龙佰集团	2,900	47,009.00	0.10
255	000831	中国稀土	1,300	46,956.00	0.10
256	600085	XD同仁堂	1,300	46,878.00	0.10
257	600362	江西铜业	2,000	46,860.00	0.10
258	600536	中国软件	1,000	46,770.00	0.10
259	600885	宏发股份	2,094	46,717.14	0.10
260	601158	重庆水务	10,000	46,400.00	0.10
261	600039	四川路桥	4,680	46,332.00	0.10
262	600079	人福医药	2,202	46,197.96	0.10
263	300002	神州泰岳	3,900	46,020.00	0.10
264	002821	凯莱英	520	45,890.00	0.09
265	002180	纳思达	2,000	45,880.00	0.09
266	300782	卓胜微	640	45,676.80	0.09
267	600109	国金证券	5,200	45,604.00	0.09
268	000997	新大陆	1,400	45,332.00	0.09
269	002850	科达利	400	45,268.00	0.09
270	600233	圆通速递	3,500	45,115.00	0.09
271	000783	长江证券	6,500	45,045.00	0.09
272	000786	北新建材	1,700	45,016.00	0.09
273	688777	中控技术	1,000	44,910.00	0.09
274	002129	TCL中环	5,800	44,544.00	0.09

275	002078	太阳纸业	3,300	44,418.00	0.09
276	001965	招商公路	3,700	44,400.00	0.09
277	002281	光迅科技	900	44,388.00	0.09
278	603596	伯特利	840	44,259.60	0.09
279	000301	东方盛虹	5,300	44,149.00	0.09
280	302132	中航成飞	500	43,970.00	0.09
281	688169	石头科技	280	43,834.00	0.09
282	002472	双环传动	1,300	43,537.00	0.09
283	603129	春风动力	200	43,300.00	0.09
284	601877	正泰电器	1,900	43,073.00	0.09
285	300759	康龙化成	1,750	42,945.00	0.09
286	601618	中国中冶	14,400	42,912.00	0.09
287	688099	晶晨股份	600	42,606.00	0.09
288	002738	中矿资源	1,320	42,451.20	0.09
289	002436	兴森科技	3,200	42,368.00	0.09
290	601933	永辉超市	8,600	42,140.00	0.09
291	002353	杰瑞股份	1,200	42,000.00	0.09
292	603298	杭叉集团	2,000	41,900.00	0.09
293	600161	天坛生物	2,182	41,872.58	0.09
294	000423	东阿阿胶	800	41,840.00	0.09
295	688002	睿创微纳	600	41,832.00	0.09
296	002709	天赐材料	2,308	41,820.96	0.09
297	600862	中航高科	1,600	41,728.00	0.09
298	600600	青岛啤酒	600	41,676.00	0.09
299	300223	北京君正	600	41,520.00	0.09
300	688122	西部超导	800	41,504.00	0.09
301	601615	明阳智能	3,600	41,364.00	0.09
302	300058	蓝色光标	6,300	41,328.00	0.09
303	600143	金发科技	4,000	41,240.00	0.09
304	688223	晶科能源	7,931	41,161.89	0.09
305	601607	上海医药	2,290	40,945.20	0.08

306	002223	鱼跃医疗	1,150	40,940.00	0.08
307	300024	机器人	2,380	40,888.40	0.08
308	603659	璞泰来	2,175	40,846.50	0.08
309	688180	君实生物	1,200	40,776.00	0.08
310	600549	厦门钨业	1,930	40,375.60	0.08
311	600845	宝信软件	1,708	40,342.96	0.08
312	603296	华勤技术	500	40,340.00	0.08
313	000876	新希望	4,300	40,334.00	0.08
314	300136	信维通信	1,800	40,320.00	0.08
315	600580	卧龙电驱	2,039	40,311.03	0.08
316	000166	申万宏源	8,020	40,260.40	0.08
317	002459	晶澳科技	4,028	40,199.44	0.08
318	600188	兖矿能源	3,300	40,161.00	0.08
319	300054	鼎龙股份	1,400	40,152.00	0.08
320	000596	古井贡酒	301	40,078.15	0.08
321	601577	长沙银行	4,000	39,760.00	0.08
322	601898	中煤能源	3,600	39,384.00	0.08
323	002138	顺络电子	1,400	39,368.00	0.08
324	000893	亚钾国际	1,300	39,182.00	0.08
325	688521	芯原股份	401	38,696.50	0.08
326	300383	光环新网	2,700	38,610.00	0.08
327	002938	鹏鼎控股	1,200	38,436.00	0.08
328	002065	东华软件	4,000	38,400.00	0.08
329	300001	特锐德	1,600	38,352.00	0.08
330	603087	甘李药业	700	38,346.00	0.08
331	600023	浙能电力	7,200	38,160.00	0.08
332	002085	万丰奥威	2,400	38,136.00	0.08
333	601665	齐鲁银行	6,000	37,920.00	0.08
333	000426	兴业银锡	2,400	37,920.00	0.08
334	600737	中粮糖业	4,000	37,800.00	0.08
335	601872	招商轮船	6,000	37,560.00	0.08

336	601377	兴业证券	6,050	37,449.50	0.08
337	002414	高德红外	3,644	37,351.00	0.08
338	000932	华菱钢铁	8,480	37,312.00	0.08
339	688578	艾力斯	400	37,216.00	0.08
340	002673	西部证券	4,700	37,036.00	0.08
341	000999	华润三九	1,183	37,004.24	0.08
342	600875	东方电气	2,200	36,828.00	0.08
343	002008	大族激光	1,500	36,555.00	0.08
344	300373	扬杰科技	700	36,330.00	0.08
345	603606	东方电缆	700	36,197.00	0.07
346	300765	新诺威	700	36,183.00	0.07
347	300604	长川科技	800	35,928.00	0.07
348	002444	巨星科技	1,400	35,714.00	0.07
349	002624	完美世界	2,350	35,649.50	0.07
350	603160	汇顶科技	500	35,515.00	0.07
351	300699	光威复材	1,120	35,470.40	0.07
352	300999	金龙鱼	1,200	35,436.00	0.07
353	000750	国海证券	8,600	35,432.00	0.07
354	300316	晶盛机电	1,300	35,295.00	0.07
355	600298	安琪酵母	1,000	35,170.00	0.07
356	300073	当升科技	800	35,096.00	0.07
357	300012	华测检测	3,000	35,070.00	0.07
358	000733	振华科技	700	35,035.00	0.07
359	600909	XD华安证	5,990	34,921.70	0.07
360	002155	湖南黄金	1,950	34,807.50	0.07
361	000983	山西焦煤	5,400	34,560.00	0.07
362	300037	新宙邦	980	34,496.00	0.07
363	300003	乐普医疗	2,500	34,450.00	0.07
364	600025	华能水电	3,600	34,380.00	0.07
365	300496	中科创达	600	34,332.00	0.07
366	600153	建发股份	3,300	34,221.00	0.07

367	300832	新产业	600	34,032.00	0.07
368	601233	桐昆股份	3,200	33,920.00	0.07
369	002007	华兰生物	2,155	33,768.85	0.07
370	688361	中科飞测	400	33,676.00	0.07
371	000776	广发证券	2,000	33,620.00	0.07
372	600369	西南证券	7,700	33,495.00	0.07
373	601198	东兴证券	3,000	33,450.00	0.07
374	600895	张江高科	1,300	33,410.00	0.07
375	300628	亿联网络	960	33,369.60	0.07
376	600529	山东药玻	1,500	33,210.00	0.07
377	603605	珀莱雅	400	33,116.00	0.07
378	000878	云南铜业	2,600	33,072.00	0.07
379	600392	盛和资源	2,510	33,056.70	0.07
380	000009	中国宝安	3,720	33,033.60	0.07
381	300142	沃森生物	3,000	33,000.00	0.07
382	000623	吉林敖东	1,943	32,933.85	0.07
383	300474	景嘉微	450	32,850.00	0.07
383	000617	中油资本	4,500	32,850.00	0.07
384	000519	中兵红箭	1,500	32,835.00	0.07
385	002409	雅克科技	600	32,814.00	0.07
386	603228	景旺电子	784	32,802.56	0.07
387	600637	东方明珠	4,390	32,793.30	0.07
388	300724	捷佳伟创	600	32,580.00	0.07
389	603979	金诚信	700	32,508.00	0.07
390	688249	晶合集成	1,600	32,432.00	0.07
391	000729	燕京啤酒	2,500	32,325.00	0.07
392	601990	南京证券	4,000	32,320.00	0.07
393	600027	华电国际	5,900	32,273.00	0.07
394	600060	海信视像	1,400	32,228.00	0.07
395	603345	安井食品	400	32,168.00	0.07
396	600803	新奥股份	1,700	32,130.00	0.07

397	300413	芒果超媒	1,470	32,075.40	0.07
398	601696	中银证券	3,000	32,070.00	0.07
399	601216	君正集团	5,800	32,016.00	0.07
400	000021	深科技	1,700	31,858.00	0.07
401	600332	白云山	1,200	31,632.00	0.07
402	601997	贵阳银行	5,060	31,574.40	0.07
403	000728	国元证券	4,000	31,560.00	0.07
404	600699	均胜电子	1,800	31,392.00	0.06
405	002410	广联达	2,340	31,379.40	0.06
406	000039	中集集团	3,970	31,204.20	0.06
407	301358	湖南裕能	1,000	31,190.00	0.06
408	601901	方正证券	3,900	30,849.00	0.06
409	002025	航天电器	600	30,846.00	0.06
410	002318	久立特材	1,300	30,407.00	0.06
411	002926	华西证券	3,400	30,396.00	0.06
412	603893	瑞芯微	200	30,372.00	0.06
413	600673	东阳光	2,600	30,238.00	0.06
414	002939	长城证券	3,600	30,168.00	0.06
415	600486	扬农化工	520	30,160.00	0.06
416	600497	驰宏锌锗	5,700	30,153.00	0.06
417	601238	广汽集团	4,000	29,960.00	0.06
418	600398	海澜之家	4,300	29,928.00	0.06
419	688303	大全能源	1,400	29,848.00	0.06
420	605117	德业股份	566	29,805.56	0.06
421	002607	中公教育	9,700	29,682.00	0.06
422	600435	北方导航	1,900	29,621.00	0.06
423	300919	中伟股份	900	29,592.00	0.06
424	002152	广电运通	2,200	29,568.00	0.06
425	688385	复旦微电	600	29,562.00	0.06
426	002080	中材科技	1,500	29,250.00	0.06
427	600155	华创云信	4,200	29,232.00	0.06

428	601059	信达证券	1,700	29,070.00	0.06
429	688599	天合光能	2,000	29,060.00	0.06
430	000738	航发控制	1,400	29,050.00	0.06
431	300558	贝达药业	500	28,975.00	0.06
432	600516	方大炭素	6,233	28,921.12	0.06
433	002044	美年健康	5,600	28,784.00	0.06
434	300763	锦浪科技	500	28,695.00	0.06
435	300748	金力永磁	1,200	28,608.00	0.06
436	002739	万达电影	2,500	28,575.00	0.06
437	600118	中国卫星	1,000	28,570.00	0.06
438	603260	合盛硅业	600	28,440.00	0.06
439	600141	兴发集团	1,380	28,331.40	0.06
440	603179	新泉股份	600	28,182.00	0.06
441	600998	九州通	5,450	28,013.00	0.06
442	600390	五矿资本	4,800	27,984.00	0.06
443	600018	上港集团	4,900	27,979.00	0.06
444	600170	上海建工	11,700	27,963.00	0.06
445	603486	科沃斯	480	27,950.40	0.06
446	601456	国联民生	2,700	27,945.00	0.06
446	600521	华海药业	1,500	27,945.00	0.06
447	000703	恒逸石化	4,738	27,859.44	0.06
448	002958	青农商行	7,700	27,797.00	0.06
449	300285	国瓷材料	1,600	27,760.00	0.06
450	002841	视源股份	800	27,680.00	0.06
451	600380	健康元	2,504	27,619.12	0.06
452	600132	重庆啤酒	500	27,550.00	0.06
453	601155	新城控股	2,000	27,360.00	0.06
454	002244	滨江集团	2,800	27,300.00	0.06
455	002683	广东宏大	800	27,152.00	0.06
456	002500	山西证券	4,630	27,039.20	0.06
457	601179	中国西电	4,400	27,016.00	0.06

458	603379	三美股份	560	26,947.20	0.06
459	603885	吉祥航空	2,000	26,940.00	0.06
460	600026	中远海能	2,600	26,858.00	0.06
461	002203	海亮股份	2,600	26,832.00	0.06
462	000683	博源化工	5,600	26,824.00	0.06
463	600583	海油工程	4,900	26,754.00	0.06
464	600765	中航重机	1,580	26,670.40	0.06
465	600348	华阳股份	4,000	26,640.00	0.06
465	600208	衢州发展	9,000	26,640.00	0.06
466	600872	中炬高新	1,400	26,600.00	0.05
467	000060	中金岭南	5,800	26,564.00	0.05
468	600316	洪都航空	700	26,390.00	0.05
469	603939	益丰药房	1,078	26,378.66	0.05
470	601991	大唐发电	8,300	26,311.00	0.05
471	601000	唐山港	6,478	26,300.68	0.05
472	002984	森麒麟	1,400	26,250.00	0.05
473	600511	国药股份	900	26,244.00	0.05
474	000400	许继电气	1,200	26,124.00	0.05
475	000960	锡业股份	1,700	26,010.00	0.05
476	600816	建元信托	8,800	25,960.00	0.05
477	000708	中信特钢	2,200	25,872.00	0.05
478	300146	汤臣倍健	2,300	25,852.00	0.05
479	000830	鲁西化工	2,500	25,750.00	0.05
480	601611	中国核建	2,800	25,732.00	0.05
481	688472	阿特斯	2,800	25,620.00	0.05
482	300390	天华新能	1,340	25,553.80	0.05
483	002432	九安医疗	700	25,501.00	0.05
484	600498	烽火通信	1,212	25,488.36	0.05
485	600867	通化东宝	3,100	25,420.00	0.05
486	002653	海思科	600	25,332.00	0.05
487	000723	美锦能源	5,800	25,056.00	0.05

488	600859	王府井	1,800	25,002.00	0.05
489	601799	星宇股份	200	25,000.00	0.05
490	688017	绿的谐波	200	24,978.00	0.05
491	601966	玲珑轮胎	1,700	24,939.00	0.05
492	300676	华大基因	500	24,885.00	0.05
493	000887	中鼎股份	1,400	24,626.00	0.05
494	000958	电投产融	3,600	24,624.00	0.05
495	600004	白云机场	2,700	24,570.00	0.05
496	002423	中粮资本	2,000	24,460.00	0.05
497	601666	平煤股份	3,300	24,453.00	0.05
498	603927	中科软	1,260	24,368.40	0.05
499	603806	福斯特	1,875	24,300.00	0.05
499	601880	辽港股份	16,200	24,300.00	0.05
500	601699	潞安环能	2,300	24,265.00	0.05
501	300567	精测电子	400	24,244.00	0.05
502	002385	大北农	6,000	24,240.00	0.05
503	601958	金钼股份	2,200	24,068.00	0.05
504	002056	横店东磁	1,700	24,055.00	0.05
505	000563	陕国投A	6,730	24,026.10	0.05
506	601016	节能风电	8,180	23,640.20	0.05
507	600535	天士力	1,500	23,475.00	0.05
508	605358	立昂微	1,000	23,300.00	0.05
509	600038	中直股份	600	23,286.00	0.05
510	603899	晨光股份	800	23,192.00	0.05
511	002064	华峰化学	3,500	23,135.00	0.05
512	688009	中国通号	4,500	23,130.00	0.05
513	600271	航天信息	2,500	23,100.00	0.05
514	600312	平高电气	1,500	23,085.00	0.05
514	300144	宋城演艺	2,700	23,085.00	0.05
515	600598	北大荒	1,600	23,072.00	0.05
516	000050	深天马A	2,700	23,004.00	0.05

517	002262	恩华药业	1,100	22,858.00	0.05
518	600166	福田汽车	8,400	22,764.00	0.05
519	300677	英科医疗	960	22,732.80	0.05
520	002568	百润股份	880	22,536.80	0.05
521	000629	钒钛股份	8,800	22,528.00	0.05
522	601698	中国卫通	1,100	22,517.00	0.05
523	603077	和邦生物	12,800	22,400.00	0.05
524	002508	老板电器	1,170	22,241.70	0.05
525	603195	公牛集团	460	22,195.00	0.05
526	000987	越秀资本	3,235	22,192.10	0.05
527	000559	万向钱潮	2,900	22,185.00	0.05
528	688065	凯赛生物	468	22,042.80	0.05
529	000636	风华高科	1,600	21,984.00	0.05
530	600563	法拉电子	200	21,818.00	0.05
531	688538	和辉光电	9,314	21,794.76	0.05
532	002507	涪陵榨菜	1,690	21,615.10	0.04
533	600499	科达制造	2,200	21,560.00	0.04
534	600995	南网储能	2,200	21,516.00	0.04
535	002429	兆驰股份	4,900	21,462.00	0.04
536	603833	欧派家居	380	21,451.00	0.04
537	600970	中材国际	2,500	21,450.00	0.04
538	600126	杭钢股份	2,380	21,420.00	0.04
539	603568	伟明环保	1,118	21,331.44	0.04
540	002120	韵达股份	3,164	21,198.80	0.04
541	600021	上海电力	2,400	21,096.00	0.04
542	000591	太阳能	4,800	21,072.00	0.04
543	603589	口子窖	600	20,880.00	0.04
544	300070	碧水源	4,632	20,844.00	0.04
545	000921	海信家电	800	20,560.00	0.04
546	601866	中远海发	8,300	20,501.00	0.04
547	600546	山煤国际	2,300	20,079.00	0.04

548	601098	XD中南传	1,500	19,680.00	0.04
549	000967	盈峰环境	2,800	19,460.00	0.04
550	603156	养元饮品	864	18,282.24	0.04
551	300888	稳健医疗	420	17,262.00	0.04
552	603290	斯达半导	80	6,501.60	0.01
553	300751	迈为股份	56	3,895.36	0.01
554	002756	永兴材料	50	1,587.50	0.00
555	603737	三棵树	28	1,031.80	0.00
556	601236	红塔证券	90	762.30	0.00
557	601162	天风证券	30	147.90	0.00
558	600061	国投资本	16	120.32	0.00
559	601108	财通证券	10	79.10	0.00

### 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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	688256	寒武纪	119,922.00	0.22
2	002371	北方华创	85,220.00	0.15
3	601006	大秦铁路	82,426.00	0.15
4	601058	赛轮轮胎	79,650.00	0.14
5	600036	招商银行	74,324.00	0.13
6	601127	赛力斯	65,755.00	0.12
7	000651	格力电器	60,632.00	0.11
8	600887	伊利股份	58,919.00	0.11
9	000338	潍柴动力	58,000.00	0.11
10	601838	成都银行	56,776.00	0.10

11	600741	华域汽车	56,159.00	0.10
12	600582	天地科技	54,384.00	0.10
13	600028	中国石化	54,173.00	0.10
14	002128	电投能源	54,072.00	0.10
15	601318	XD中国平	53,376.00	0.10
16	601088	中国神华	52,036.00	0.09
17	600873	梅花生物	52,014.00	0.09
18	600177	雅戈尔	50,922.00	0.09
19	600755	厦门国贸	50,000.00	0.09
20	600655	豫园股份	48,966.00	0.09

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	600519	贵州茅台	289,334.00	0.52
2	600036	招商银行	232,174.00	0.42
3	601318	XD中国平	152,494.00	0.28
4	000933	神火股份	147,679.00	0.27
5	002128	电投能源	136,904.00	0.25
6	300750	宁德时代	132,019.00	0.24
7	601988	中国银行	131,820.00	0.24
8	000338	潍柴动力	123,455.00	0.22
9	002625	光启技术	117,748.00	0.21
10	601398	工商银行	112,568.00	0.20
11	600031	三一重工	85,059.00	0.15
12	000157	中联重科	83,484.00	0.15
13	002384	东山精密	83,082.00	0.15

14	688617	惠泰医疗	81,640.00	0.15
15	000333	美的集团	79,452.00	0.14
16	603298	杭叉集团	77,521.00	0.14
17	601658	邮储银行	75,037.00	0.14
18	000425	徐工机械	72,010.00	0.13
19	600887	伊利股份	71,364.00	0.13
20	600755	厦门国贸	70,510.00	0.13

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）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	2,863,986.00
卖出股票收入（成交）总额	9,780,785.12

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，【兴业银行股份有限公司】于2024年07月17日收到国家金融监督管理总局福建监管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	5,095.28
2	应收清算款	677,825.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	58,449.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	741,370.13

## 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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8 00A	2,8 49	7,057.34	-	-	20,106,373.65	100.00%
天弘 中证8 00C	6,2 20	3,240.73	4,189,213.62	20.7 8%	15,968,134.19	79.22%
合计	8,9 55	4,496.23	4,189,213.62	10.4 0%	36,074,507.84	89.60%

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800 A	25,388.73	0.13%
	天弘中证800 C	2,086.32	0.01%
	合计	27,475.05	0.07%

### 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	22,392,931.87	24,248,801.97
本报告期基金总申购份额	2,075,803.12	11,315,739.57
减：本报告期基金总赎回份额	4,362,361.34	15,407,193.73
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	20,106,373.65	20,157,347.81

## §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，未发生管理人的重大人事变动。

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	3,090,789.05	24.43%	642.56	24.43%	-
东兴 证券	1	-	-	-	-	-

广发证券	2	9,558,525.73	75.57%	1,987.70	75.57%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准：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、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，确定选用交易单元的证券公司，再和被选用的证券公司签订证券交易单元租用协议和综合服务协议。

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	199,728.00	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2024年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2025-01-22
2	关于天弘基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会规定媒介	2025-03-19

3	天弘中证800指数型发起式 证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2025-03-21
4	天弘中证800指数型发起式 证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2025-03-21
5	天弘中证800指数型发起式 证券投资基金招募说明书 (更新)	中国证监会规定媒介	2025-03-21
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	2025-03-21
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	2025-03-21
8	天弘中证800指数型发起式 证券投资基金2024年年度报 告	中国证监会规定媒介	2025-03-31
9	天弘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(2024 年下半年度)	中国证监会规定媒介	2025-03-31
10	天弘中证800指数型发起式 证券投资基金2025年第1季 度报告	中国证监会规定媒介	2025-04-22
11	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	2025-06-27
12	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	2025-06-27

## §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

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，为降低投资者的理财成本，基金管理人经与基金托管人协商一致，决定将本基金的指数使用费调整为基金管理人承担，并相应修订相关法律文件，修订后的《基金合同》、《托管协议》等法律文件自2025年3月21日正式生效。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《关于天弘基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》。

## §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指数量型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证800指数量型发起式证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证800指数量型发起式证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证800指数量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印件。

公司网站：[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇二五年八月二十九日