鹏华中证800交易型开放式指数证券投资基金
2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

送出日期：2026年8月28日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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 7
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标和基金净值表现 8
3.1 主要会计数据和财务指标 8
3.2 基金净值表现 8
3.3 其他指标 9
§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遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 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 11
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 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 38
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 39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 59
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 59
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 59

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 59
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 59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 59
7.12 投资组合报告附注 60

§8 基金份额持有人信息 60

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 61
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 61

§9 开放式基金份额变动 61

§10 重大事件揭示 61

10.1 基金份额持有人大会决议 61
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 61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 62
10.4 基金投资策略的改变 62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 62
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 62
10.8 其他重大事件 63

§11 影响投资者决策的其他重要信息 64

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 64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 65

§12 备查文件目录 65

12.1 备查文件目录 65
12.2 存放地点 65
12.3 查阅方式 65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	鹏华中证 800ETF
场内简称	中证 800ETF 鹏华
基金主代码	159800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 6 月 27 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	26,736,802.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 7 月 12 日

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。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。
投资策略	本基金采取完全复制策略，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票投资组合进行相应调整。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 1、股票投资策略 （1）股票投资组合的构建 本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。 （2）股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变

	动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证基金累计报酬率与标的指数同期累计报酬率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。 1）定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。 2）不定期调整 根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整； 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数； 根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 2、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 3、债券投资策略 本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。 本基金可投资可转换债券及可交换债券，可转换债券及可交换债券兼具债权和股权双重属性，本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析，结合本基金的产品定位和投资目标综合开展投资决策。 4、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 5、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

	6、融资及转融通投资策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

注：无。

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		鹏华基金管理有限公司	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高永杰	刘强
	联系电话	0755-81395402	025-83387812
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	liuqiang023506@htsc.com
客户服务电话		4006788533	95597
传真		0755-82021126	025-83387215
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	江苏省南京市江东中路 228 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	江苏省南京市江东中路 228 号
邮政编码		518048	210009
法定代表人		张纳沙	王会清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告置备地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,257,284.96
本期利润	4,047,267.36
加权平均基金份额本期利润	0.1496
本期加权平均净值利润率	10.25%
本期基金份额净值增长率	11.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	14,627,990.83
期末可供分配基金份额利润	0.5471
期末基金资产净值	41,499,031.92
期末基金份额净值	1.5521
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	55.21%

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

(2) 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、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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

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
过去三个月	13.84%	1.30%	13.71%	1.34%	0.13%	-0.04%
过去六个月	11.28%	1.20%	11.12%	1.24%	0.16%	-0.04%
过去一年	32.51%	1.06%	33.18%	1.10%	-0.67%	-0.04%
自基金合同生效起至今	55.21%	1.24%	52.21%	1.28%	3.00%	-0.04%

注：业绩比较基准=中证 800 指数收益率。

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

注：1、本基金基金合同于 2024 年 06 月 27 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模为 15,047 亿元，公司管理着 410 只公募基金，23 只社保基金、养老基金及划转资本组合。历经二十余年基金投资管理实践，公司在基金投资运作、风险控制等方面积累了丰富经验。

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		

时赟超	本基金的基金经理	2025-08-26	-	8 年	时赟超先生,国籍中国,工学硕士,8 年证券从业经验。曾任财通基金管理有限公司量化投资部研究助理。2019 年 11 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部量化研究员、高级量化研究员、资深量化研究员，现担任指数与量化投资部基金经理。2024 年 12 月至今担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理，2024 年 12 月至今担任鹏华智投 800 混合型证券投资基金基金经理，2024 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华安泽混合型证券投资基金基金经理，2025 年 07 月至今担任鹏华创兴增利债券型证券投资基金基金经理，2025 年 08 月至今担任鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 11 月至今担任鹏华中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 100 指数增强型证券投资基金基金经理，2026 年 04 月至今担任鹏华上证科创板 200 指数增强型证券投资基金基金经理，2026 年 06 月至今担任鹏华创业板综合指数增强型证券投资基金基金经理,时赟超先生具备基金从业资格。

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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，本基金运作合规，不存在违反基金合同和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

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等

各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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%的交易共有 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金作为一只被动指数基金，始终坚持严格的投资纪律，以紧密跟踪标的指数、最小化跟踪误差为核心投资目标。在具体运作上，我们采用全复制法构建投资组合，严格按照中证 800 指数成份股及其权重进行配置，确保组合的构成与指数保持高度一致。为应对日常申购赎回的需求，以及充分考虑成份股停牌、流动性变化等因素，对组合进行适时的动态调整。同时建立了完善的组合再平衡机制，定期根据指数成份股调整和权重变化对投资组合进行优化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 11.28%，同期业绩比较基准增长率为 11.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，国内经济仍处于结构调整与新旧动能转换过程中，总量运行有望保持总体平稳，但不同行业之间的景气度和盈利修复节奏预计仍将存在一定差异。政策端，更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策有望继续发力，扩内需的重要性进一步提升，增量政策工具也有望根据经济运行情况适时推出，逆周期调节力度的增强将为下半年需求端改善提供支撑。外部环境方面，近期主要经济体经贸关系及地缘政治风险出现一定程度缓和，若外部环境总体保持稳定，有利于国内经济修复和市场风险偏好的改善。在此背景下，景气度较高、盈利改善趋势较为明确的行业和公司仍具有较高的投资关注价值。

证券市场层面，前期市场波动有所放大，科技成长等板块在经历较快上涨后交易拥挤度有所消化，同时外部地缘政治等因素也阶段性放大了市场情绪波动。但从中长期来看，国内稳定资本市场运行、改善市场预期的政策导向较为明确，监管部门、长期资金以及上市公司等多方面力量共同推动资本市场健康发展。未来，随着资本市场基础制度持续完善、长期资金占比逐步提升，市场运行的稳定性和有效性有望进一步增强。基于此，我们对市场中长期发展保持积极看法，并认为未来权益市场的投资机会仍将更多来源于产业趋势、企业盈利改善以及估值变化带来的结构性机会。总体而言，下半年市场风险偏好有望逐步修复，权益市场仍将呈现较为明显的结构性特征，但相

较前期，行业和风格表现有望更加均衡。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、风控管理部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 14,627,990.83 元，期末基金份额净值 1.5521 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

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，本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

本基金自 2025 年 11 月 26 日至 2026 年 02 月 24 日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的

相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，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，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支进行了复核，未发现基金管理人存在损害本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

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2026 年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、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：鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,061,136.97	1,091,282.69
结算备付金		14,140.02	14,069.22
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	40,407,326.96	36,243,652.67
其中：股票投资		40,407,326.96	36,243,652.67
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	71,999.58	-
资产总计		41,554,603.53	37,349,004.58
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		16,483.83	17,214.02
应付托管费		3,296.80	3,442.78
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	35,790.98	35,144.00
负债合计		55,571.61	55,800.80
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	26,736,802.00	26,736,802.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	14,762,229.92	10,556,401.78
净资产合计		41,499,031.92	37,293,203.78
负债和净资产总计		41,554,603.53	37,349,004.58

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5521 元，基金份额总额 26,736,802.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		4,246,425.34	781,578.62
1.利息收入		1,755.53	7,094.32
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,755.53	7,094.32
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）		2,421,381.92	4,748,869.63
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,074,946.88	4,176,771.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	346,435.04	572,098.06
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,789,982.40	-4,043,460.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	33,305.49	69,075.66
减：二、营业总支出		199,157.98	303,735.87
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	97,628.85	139,468.07
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	19,525.81	27,893.60
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7．税金及附加		-	-
8．其他费用	6.4.7.23	82,003.32	136,374.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,047,267.36	477,842.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,047,267.36	477,842.75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,047,267.36	477,842.75

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	26,736,802.00	-	10,556,401.78	37,293,203.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	26,736,802.00	-	10,556,401.78	37,293,203.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	4,205,828.14	4,205,828.14
（一）、综合收益总额	-	-	4,047,267.36	4,047,267.36
（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）	-	-	158,560.78	158,560.78
其中：1.基金申购款	12,000,000.00	-	5,815,657.19	17,815,657.19
2.基金赎回款	-12,000,000.00	-	-5,657,096.41	-17,657,096.41
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	26,736,802.00	-	14,762,229.92	41,499,031.92
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	74,736,802.00	-	11,549,616.83	86,286,418.83
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	74,736,802.00	-	11,549,616.83	86,286,418.83
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-36,000,000.00	-	-4,913,120.89	-40,913,120.89
（一）、综合收益总额	-	-	477,842.75	477,842.75
（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）	-36,000,000.00	-	-5,390,963.64	-41,390,963.64
其中：1.基金申购款	16,000,000.00	-	2,224,735.94	18,224,735.94
2.基金赎回款	-52,000,000.00	-	-7,615,699.58	-59,615,699.58
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	38,736,802.00	-	6,636,495.94	45,373,297.94

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：

邓召明	聂连杰	郝文高
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

鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]167 号《关于准予鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予，由鹏华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《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定 ，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 590,716,454.00 元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2400195 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 6 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 590,736,802.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 20,348.00 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

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颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、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《公开募集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》和《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及在财务报表附注中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 2026 年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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》和财政部、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[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[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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，截至 2027 年 12 月 31 日适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；对金融同业往来利息收入，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	187,961.75
等于：本金	187,888.65
加：应计利息	73.10
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	873,175.22
等于：本金	873,164.72
加：应计利息	10.50
减：坏账准备	-
合计	1,061,136.97

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	34,911,683.21	-	40,407,326.96	5,495,643.75

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		34,911,683.21	-	40,407,326.96	5,495,643.75

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

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

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	71,999.58
合计	71,999.58

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	34,000.48
其他	1,790.50
合计	35,790.98

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,736,802.00	26,736,802.00

本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-12,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	26,736,802.00	26,736,802.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,503,872.39	-1,947,470.61	10,556,401.78
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	12,503,872.39	-1,947,470.61	10,556,401.78
本期利润	2,257,284.96	1,789,982.40	4,047,267.36
本期基金份额交易产生的变动数	-133,166.52	291,727.30	158,560.78
其中：基金申购款	5,767,983.88	47,673.31	5,815,657.19
基金赎回款	-5,901,150.40	244,053.99	-5,657,096.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,627,990.83	134,239.09	14,762,229.92

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,475.26
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	209.47
结算备付金利息收入	70.80
其他	-
合计	1,755.53

注：1、其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

2、其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	975,081.46
股票投资收益——赎回差价收入	1,099,865.42
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	2,074,946.88

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	11,111,499.76
减：卖出股票成本总额	10,125,014.28
减：交易费用	11,404.02
买卖股票差价收入	975,081.46

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	17,657,096.41
减：现金支付赎回款总额	9,842,175.41
减：赎回股票成本总额	6,715,055.58
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,099,865.42

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

股票投资产生的股利收益	346,435.04
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	346,435.04

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	1,789,982.40
股票投资	1,789,982.40
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,789,982.40

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	33,305.49
合计	33,305.49

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	6,000.60
信息披露费	20,000.54

证券出借违约金	-
登记结算费	48,000.42
存托服务费	2.42
IOPV 计算和发布费	7,999.34
合计	82,003.32

6.4.7.24 分部报告

无。

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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没有发生变化。

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
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金托管人、基金的一级交易商
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金的一级交易商
鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“鹏华中证 800ETF 发起式联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
华泰证券	22,486,601.51	100.00	64,604,518.10	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
华泰证券	4,406.26	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
华泰证券	12,659.14	100.00	-	-

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，以扣除证管费、经手费等费用后的净额列示。佣金率由协议签订方参考市场价格确定。佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》相关要求。

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。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	97,628.85	139,468.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	22,946.05	48,410.75
应支付基金管理人的净管理费	74,682.80	91,057.32

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人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，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	19,525.81	27,893.60

注：支付基金托管人华泰证券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。日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

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

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）

华泰证券	1,227,871.00	4.59	1,282,475.00	4.80
鹏华中证800ETF发起式联接	8,568,204.00	32.05	8,590,604.00	32.13

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华泰证券	1,061,136.97	1,684.73	1,930,332.04	7,024.23

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

2026 年 06 月 30 日，本基金持有 6,100.00 股基金托管人华泰证券发行的 A 股普通股，账面价值为人民币 125,782.00 元，占基金资产净值的比例为 0.30%；本基金持有 3,200.00 股国信证券发行的 A 股普通股，账面价值为人民币 31,968.00 元，占基金资产净值的比例为 0.08%。（2025 年 06 月 30 日，本基金持有 7,900.00 股基金托管人华泰证券发行的 A 股普通股，账面价值为人民币 140,699.00 元，占基金资产净值的比例为 0.31%；本基金持有 4,500.00 股国信证券发行的 A 股普通股，账面价值为人民币 51,840.00 元，占基金资产净值的比例为 0.11%。）

本报告期内，本基金在迷你期间如涉及信息披露费、审计费等固定费用的，上述费用由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。本基金本报告期内基金管理人承担的上述各类费用合计为人民币 19,657.54 元（该金额为未经审计的预估金额）。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌	复牌开盘单	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称			单价	日期	价				
688072	拓荆科技	2026年6月29日	重大事项	832.00	2026年7月13日	890.99	200	134,420.00	166,400.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行或上市交易的其他股票（包含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可依据法律法规的规定，参与融资及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争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务

的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行华泰证券股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2025 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

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或于约定开放日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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所持有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 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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“期末本基金持有的流通受限证券”。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%。

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。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,061,136.97	-	-	-	1,061,136.97
结算备付金	14,140.02	-	-	-	14,140.02
交易性金融资产	-	-	-	40,407,326.96	40,407,326.96
其他资产	-	-	-	71,999.58	71,999.58
资产总计	1,075,276.99	-	-	40,479,326.54	41,554,603.53
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	16,483.83	16,483.83
应付托管费	-	-	-	3,296.80	3,296.80
其他负债	-	-	-	35,790.98	35,790.98
负债总计	-	-	-	55,571.61	55,571.61
利率敏感度缺口	1,075,276.99	-	-	40,423,754.93	41,499,031.92
上年度末 2025 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	1,091,282.69	-	-	-	1,091,282.69
结算备付金	14,069.22	-	-	-	14,069.22
交易性金融资产	-	-	-	36,243,652.67	36,243,652.67
资产总计	1,105,351.91	-	-	36,243,652.67	37,349,004.58
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	17,214.02	17,214.02
应付托管费	-	-	-	3,442.78	3,442.78
其他负债	-	-	-	35,144.00	35,144.00

负债总计	-	-	-	55,800.80	55,800.80
利率敏感度缺口	1,105,351.91	-	-	36,187,851.87	37,293,203.78

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

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注:无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份券和备选成份券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。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个券在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如果法律法规对该比例要求有变更的，可在履行适当程序后以变更后的比例为准。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	40,407,326.96	97.37	36,243,652.67	97.19
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
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	40,407,326.96	97.37	36,243,652.67	97.19

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

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 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	比较基准上涨 5%资产净值变动	1,995,688.45	1,794,921.90
	比较基准下降 5%资产净值变动	-1,995,688.45	-1,794,921.90

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	40,240,926.96
第二层次	166,400.00
第三层次	-
合计	40,407,326.96

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、债券和基金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

无。

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

无。

§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	40,407,326.96	97.24
	其中：股票	40,407,326.96	97.24
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	1,075,276.99	2.59
8	其他各项资产	71,999.58	0.17
9	合计	41,554,603.53	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。2、报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：19,075.00 元，占净值比 0.05%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

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	203,813.00	0.49
B	采矿业	1,597,791.28	3.85
C	制造业	27,057,587.85	65.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,015,775.00	2.45
E	建筑业	403,596.00	0.97
F	批发和零售业	251,873.00	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	838,736.00	2.02
H	住宿和餐饮业	8,995.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,282,391.24	5.50
J	金融业	5,757,236.79	13.87
K	房地产业	143,959.00	0.35
L	租赁和商务服务	254,328.60	0.61

	业		
M	科学研究和技术服务业	415,894.44	1.00
N	水利、环境和公共设施管理业	34,876.20	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	69,337.56	0.17
R	文化、体育和娱乐业	71,136.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	40,407,326.96	97.37

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

注：无。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	1,200	1,524,000.00	3.67
2	300750	宁德时代	2,800	1,100,428.00	2.65
3	300502	新易盛	1,512	917,784.00	2.21
4	600519	贵州茅台	700	829,843.00	2.00
5	603986	兆易创新	700	570,500.00	1.37
6	601318	中国平安	11,100	529,914.00	1.28
7	688256	寒武纪	298	475,473.90	1.15
8	600036	招商银行	12,800	454,400.00	1.09
9	601899	紫金矿业	17,100	429,894.00	1.04
10	002371	北方华创	475	420,166.00	1.01
11	000333	美的集团	5,100	385,203.00	0.93
12	002475	立讯精密	5,300	373,120.00	0.90
13	688012	中微公司	745	349,032.50	0.84
14	002384	东山精密	1,300	341,055.00	0.82
15	688008	澜起科技	1,100	340,890.00	0.82
16	600900	长江电力	12,700	336,169.00	0.81
17	688981	中芯国际	2,100	333,522.00	0.80
18	688041	海光信息	900	333,270.00	0.80
19	000725	京东方 A	38,000	329,840.00	0.79

20	603259	药明康德	2,600	323,726.00	0.78
21	601138	工业富联	4,100	295,815.00	0.71
22	600030	中信证券	10,100	290,173.00	0.70
23	601166	兴业银行	17,500	289,800.00	0.70
24	300059	东方财富	13,100	266,978.00	0.64
25	600276	恒瑞医药	4,700	244,588.00	0.59
26	300274	阳光电源	1,500	238,530.00	0.57
27	601398	工商银行	33,500	236,845.00	0.57
28	300408	三环集团	1,400	233,660.00	0.56
29	600183	生益科技	1,300	225,420.00	0.54
30	002594	比亚迪	2,800	223,160.00	0.54
31	002463	沪电股份	1,400	213,920.00	0.52
32	601211	国泰海通	11,736	213,595.20	0.51
33	300476	胜宏科技	600	207,858.00	0.50
34	300394	天孚通信	616	186,450.88	0.45
35	000988	华工科技	1,000	184,610.00	0.44
36	600176	中国巨石	2,500	182,200.00	0.44
37	601288	农业银行	29,700	180,279.00	0.43
38	601328	交通银行	27,600	177,468.00	0.43
39	000651	格力电器	4,700	176,250.00	0.42
40	300604	长川科技	500	170,710.00	0.41
41	600522	中天科技	2,800	169,904.00	0.41
42	688347	华虹宏力	500	168,150.00	0.41
43	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.40
44	600919	江苏银行	15,200	163,856.00	0.39
45	603019	中科曙光	1,500	160,845.00	0.39
46	603993	洛阳钼业	9,100	159,705.00	0.38
47	600150	中国船舶	4,721	159,522.59	0.38
48	600887	伊利股份	6,600	158,136.00	0.38
49	600584	长电科技	1,500	155,325.00	0.37
50	000338	潍柴动力	5,600	152,600.00	0.37
51	000858	五粮液	2,000	148,000.00	0.36
52	002916	深南电路	320	146,528.00	0.35
53	601088	中国神华	3,700	144,448.00	0.35
54	688521	芯原股份	380	141,033.20	0.34
55	301308	江波龙	200	140,760.00	0.34
56	601816	京沪高铁	30,400	137,712.00	0.33
57	600309	万华化学	2,000	136,820.00	0.33
58	002008	大族激光	900	135,099.00	0.33
59	688120	华海清科	417	134,349.06	0.32
60	300124	汇川技术	2,000	132,660.00	0.32
61	002415	海康威视	3,800	129,960.00	0.31
62	002281	光迅科技	500	128,470.00	0.31

63	601688	华泰证券	6,100	125,782.00	0.30
64	000100	TCL 科技	21,500	125,130.00	0.30
65	600111	北方稀土	2,600	124,930.00	0.30
66	000063	中兴通讯	3,400	123,046.00	0.30
67	300136	信维通信	1,000	119,250.00	0.29
68	600089	特变电工	5,300	119,250.00	0.29
69	600000	浦发银行	13,800	118,818.00	0.29
70	300433	蓝思科技	2,100	112,686.00	0.27
71	300857	协创数据	320	108,768.00	0.26
72	600031	三一重工	6,200	107,136.00	0.26
73	688200	华峰测控	200	105,020.00	0.25
74	002028	思源电气	600	103,800.00	0.25
75	601601	中国太保	3,600	102,672.00	0.25
76	601857	中国石油	11,800	102,424.00	0.25
77	600549	厦门钨业	1,200	102,240.00	0.25
78	000001	平安银行	10,100	101,505.00	0.24
79	002142	宁波银行	3,400	100,946.00	0.24
80	002050	三花智控	2,300	100,809.00	0.24
81	000792	盐湖股份	3,300	99,627.00	0.24
82	300223	北京君正	400	99,560.00	0.24
83	002230	科大讯飞	2,400	98,016.00	0.24
84	002714	牧原股份	2,800	97,972.00	0.24
85	600406	国电南瑞	4,200	95,970.00	0.23
86	001309	德明利	100	94,290.00	0.23
87	601668	中国建筑	21,400	92,876.00	0.22
88	002436	兴森科技	1,800	91,710.00	0.22
89	002353	杰瑞股份	600	91,500.00	0.22
90	300475	香农芯创	300	90,000.00	0.22
91	601229	上海银行	10,300	89,404.00	0.22
92	688037	芯源微	200	87,810.00	0.21
93	601919	中远海控	6,600	87,516.00	0.21
94	000657	中钨高新	900	86,148.00	0.21
95	002602	世纪华通	6,100	86,010.00	0.21
96	688361	中科飞测	200	86,000.00	0.21
97	600660	福耀玻璃	1,700	85,748.00	0.21
98	603501	豪威集团	900	85,365.00	0.21
99	300054	鼎龙股份	800	84,776.00	0.20
100	601939	建设银行	8,800	84,744.00	0.20
101	601988	中国银行	14,800	84,656.00	0.20
102	300014	亿纬锂能	1,300	84,539.00	0.20
103	002851	麦格米特	500	83,590.00	0.20
104	688017	绿的谐波	200	83,572.00	0.20
105	601728	中国电信	16,100	83,559.00	0.20

106	600016	民生银行	25,700	82,754.00	0.20
107	601012	隆基绿能	6,300	82,656.00	0.20
108	300285	国瓷材料	800	82,544.00	0.20
109	600999	招商证券	3,900	82,290.00	0.20
110	688126	沪硅产业	2,048	81,694.72	0.20
111	300760	迈瑞医疗	600	81,498.00	0.20
112	601225	陕西煤业	4,000	81,400.00	0.20
113	600105	永鼎股份	1,200	80,976.00	0.20
114	600690	海尔智家	3,900	79,599.00	0.19
115	000425	徐工机械	9,800	79,282.00	0.19
116	002460	赣锋锂业	1,200	78,480.00	0.19
117	002352	顺丰控股	2,500	78,150.00	0.19
118	688702	盛科通信-U	200	77,998.00	0.19
119	600941	中国移动	900	77,517.00	0.19
120	603799	华友钴业	1,600	77,216.00	0.19
121	002709	天赐材料	1,500	77,145.00	0.19
122	000977	浪潮信息	1,100	77,000.00	0.19
123	601985	中国核电	8,500	76,755.00	0.18
124	600926	杭州银行	5,300	76,585.00	0.18
125	601169	北京银行	15,300	74,970.00	0.18
126	300442	润泽科技	900	74,763.00	0.18
127	600160	巨化股份	1,400	74,214.00	0.18
128	002938	鹏鼎控股	700	73,766.00	0.18
129	300666	江丰电子	200	73,720.00	0.18
130	000021	深科技	1,100	70,697.00	0.17
131	688777	中控技术	600	70,500.00	0.17
132	000776	广发证券	3,000	70,200.00	0.17
133	600938	中国海油	2,500	67,875.00	0.16
134	300498	温氏股份	5,500	67,760.00	0.16
135	300033	同花顺	280	67,480.00	0.16
136	002466	天齐锂业	1,100	67,452.00	0.16
137	601600	中国铝业	8,200	67,404.00	0.16
138	002409	雅克科技	300	67,350.00	0.16
139	600028	中国石化	15,100	67,346.00	0.16
140	600498	烽火通信	900	66,240.00	0.16
141	002600	领益智造	3,800	65,892.00	0.16
142	600460	士兰微	1,200	65,592.00	0.16
143	601766	中国中车	12,600	65,520.00	0.16
144	002837	英维克	819	65,159.64	0.16
145	300346	南大光电	700	64,855.00	0.16
146	600050	中国联通	16,200	64,800.00	0.16
147	601100	恒立液压	600	64,536.00	0.16
148	688111	金山办公	300	63,915.00	0.15

149	300567	精测电子	200	63,520.00	0.15
150	601009	南京银行	6,400	63,296.00	0.15
151	300661	圣邦股份	437	62,700.76	0.15
152	002049	紫光国微	700	62,125.00	0.15
153	000568	泸州老窖	800	62,016.00	0.15
154	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.15
155	688002	睿创微纳	400	61,876.00	0.15
156	688313	仕佳光子	332	61,303.80	0.15
157	688271	联影医疗	600	60,738.00	0.15
158	000938	紫光股份	2,100	60,606.00	0.15
159	002407	多氟多	1,200	60,276.00	0.15
160	002185	华天科技	2,700	60,237.00	0.15
161	601628	中国人寿	1,700	60,095.00	0.14
162	002179	中航光电	1,300	60,060.00	0.14
163	002202	金风科技	2,500	59,750.00	0.14
164	600879	航天电子	2,800	59,612.00	0.14
165	002241	歌尔股份	2,600	58,578.00	0.14
166	688396	华润微	600	58,530.00	0.14
167	002138	顺络电子	800	58,480.00	0.14
168	601872	招商轮船	3,300	57,981.00	0.14
169	688052	纳芯微	200	57,662.00	0.14
170	601006	大秦铁路	12,500	57,625.00	0.14
171	300751	迈为股份	200	56,492.00	0.14
172	603288	海天味业	1,700	56,372.00	0.14
173	601658	邮储银行	11,400	56,202.00	0.14
174	688469	芯联集成-U	5,262	55,829.82	0.13
175	300548	长芯博创	200	55,600.00	0.13
176	601818	光大银行	19,200	55,488.00	0.13
177	000408	藏格矿业	800	55,456.00	0.13
178	601127	赛力斯	900	55,125.00	0.13
179	600905	三峡能源	14,800	54,908.00	0.13
180	600809	山西汾酒	500	54,685.00	0.13
181	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.13
182	600489	中金黄金	3,000	54,150.00	0.13
183	601888	中国中免	1,000	53,710.00	0.13
184	601336	新华保险	900	53,694.00	0.13
185	600893	航发动力	1,400	53,676.00	0.13
186	605117	德业股份	504	53,514.72	0.13
187	300395	菲利华	400	53,492.00	0.13
188	000630	铜陵有色	8,400	53,424.00	0.13
189	300390	天华新能	560	52,365.60	0.13
190	600010	包钢股份	23,400	52,182.00	0.13
191	300058	蓝色光标	3,760	51,737.60	0.12

192	301526	国际复材	1,100	51,337.00	0.12
193	600958	东方证券	5,400	50,976.00	0.12
194	688235	百济神州	200	50,922.00	0.12
195	002027	分众传媒	10,500	50,820.00	0.12
196	601689	拓普集团	900	50,778.00	0.12
197	002273	水晶光电	1,400	49,672.00	0.12
198	600019	宝钢股份	9,100	49,413.00	0.12
199	300570	太辰光	200	49,342.00	0.12
200	600118	中国卫星	600	49,230.00	0.12
201	000807	云铝股份	2,200	48,708.00	0.12
202	002625	光启技术	1,600	48,512.00	0.12
203	601838	成都银行	2,700	47,790.00	0.12
204	600362	江西铜业	1,100	47,630.00	0.11
205	001389	广合科技	200	47,450.00	0.11
206	002738	中矿资源	800	47,192.00	0.11
207	300373	扬杰科技	300	47,169.00	0.11
208	600104	上汽集团	4,800	46,848.00	0.11
209	600989	宝丰能源	2,300	46,759.00	0.11
210	605358	立昂微	600	46,560.00	0.11
211	300037	新宙邦	500	46,425.00	0.11
212	002422	科伦药业	1,200	46,224.00	0.11
213	601727	上海电气	6,500	45,500.00	0.11
214	002001	新和成	1,600	45,472.00	0.11
215	601825	沪农商行	6,000	44,940.00	0.11
216	600885	宏发股份	1,300	44,837.00	0.11
217	002126	银轮股份	900	44,820.00	0.11
218	300450	先导智能	1,100	44,792.00	0.11
219	600988	赤峰黄金	1,700	44,744.00	0.11
220	600392	盛和资源	1,500	44,655.00	0.11
221	605589	圣泉集团	700	44,499.00	0.11
222	000831	中国稀土	800	44,392.00	0.11
223	601390	中国中铁	10,600	44,202.00	0.11
224	600547	山东黄金	1,912	44,148.08	0.11
225	601377	兴业证券	7,200	43,488.00	0.10
226	600795	国电电力	9,300	43,431.00	0.10
227	601995	中金公司	1,200	43,380.00	0.10
228	600601	方正科技	3,100	42,904.00	0.10
229	000960	锡业股份	1,000	42,690.00	0.10
230	000538	云南白药	900	42,633.00	0.10
231	600585	海螺水泥	2,500	42,375.00	0.10
232	002648	卫星化学	1,800	42,282.00	0.10
233	300316	晶盛机电	700	42,280.00	0.10
234	600015	华夏银行	6,600	42,174.00	0.10

235	601669	中国电建	8,900	41,830.00	0.10
236	603296	华勤技术	560	41,591.20	0.10
237	000166	申万宏源	9,400	41,360.00	0.10
238	601916	浙商银行	15,600	41,028.00	0.10
239	300015	爱尔眼科	4,900	40,474.00	0.10
240	601179	中国西电	2,700	40,284.00	0.10
241	002311	海大集团	900	40,149.00	0.10
242	002812	恩捷股份	600	40,146.00	0.10
243	600482	中国动力	1,200	39,360.00	0.09
244	600346	恒力石化	2,200	38,962.00	0.09
245	601868	中国能建	14,500	38,715.00	0.09
246	002195	岩山科技	5,900	38,586.00	0.09
247	002558	巨人网络	1,400	38,584.00	0.09
248	605499	东鹏饮料	312	38,510.16	0.09
249	600426	华鲁恒升	1,600	38,272.00	0.09
250	601998	中信银行	5,500	38,115.00	0.09
251	301358	湖南裕能	500	37,935.00	0.09
252	002850	科达利	200	37,860.00	0.09
253	300620	光库科技	100	37,820.00	0.09
254	601066	中信建投	1,300	37,791.00	0.09
255	600378	昊华科技	500	37,690.00	0.09
256	603893	瑞芯微	200	37,672.00	0.09
257	600141	兴发集团	800	37,576.00	0.09
258	600497	驰宏锌锗	3,100	37,541.00	0.09
259	600066	宇通客车	1,400	37,534.00	0.09
260	688629	华丰科技	200	37,502.00	0.09
261	600875	东方电气	1,300	37,401.00	0.09
262	000625	长安汽车	5,200	37,284.00	0.09
263	600760	中航沈飞	900	36,990.00	0.09
264	688234	天岳先进	211	36,610.61	0.09
265	002261	拓维信息	1,300	36,413.00	0.09
266	600157	永泰能源	22,600	36,386.00	0.09
267	300418	昆仑万维	900	36,324.00	0.09
268	000157	中联重科	5,200	36,244.00	0.09
269	301200	大族数控	100	36,065.00	0.09
270	003031	中瓷电子	200	36,060.00	0.09
271	301611	珂玛科技	200	36,014.00	0.09
272	600221	海航控股	26,500	35,775.00	0.09
273	002340	格林美	5,300	35,033.00	0.08
274	600011	华能国际	4,600	34,914.00	0.08
275	600048	保利发展	7,500	34,725.00	0.08
276	688301	奕瑞科技	280	34,720.00	0.08
277	002236	大华股份	2,100	34,629.00	0.08

278	600909	华安证券	3,100	34,441.00	0.08
279	000783	长江证券	3,500	34,125.00	0.08
280	600711	盛屯矿业	3,100	34,007.00	0.08
281	600143	金发科技	2,200	33,990.00	0.08
282	600438	通威股份	2,800	33,908.00	0.08
283	600570	恒生电子	1,600	33,904.00	0.08
284	300017	网宿科技	2,600	33,826.00	0.08
285	601077	渝农商行	5,500	33,605.00	0.08
286	600115	中国东航	8,800	33,528.00	0.08
287	688608	恒玄科技	200	33,438.00	0.08
288	002493	荣盛石化	3,100	33,325.00	0.08
289	600886	国投电力	2,500	33,275.00	0.08
290	601555	东吴证券	4,200	33,264.00	0.08
291	002131	利欧股份	7,000	33,250.00	0.08
292	600436	片仔癀	300	32,784.00	0.08
293	688578	艾力斯	300	32,760.00	0.08
294	600352	浙江龙盛	2,700	32,697.00	0.08
295	600188	兖矿能源	1,840	32,696.80	0.08
296	000703	恒逸石化	2,400	32,568.00	0.08
297	601233	桐昆股份	1,500	32,475.00	0.08
298	002821	凯莱英	200	32,400.00	0.08
299	601058	赛轮轮胎	2,800	32,284.00	0.08
300	003816	中国广核	8,200	32,062.00	0.08
301	002966	苏州银行	4,600	32,016.00	0.08
302	002203	海亮股份	1,400	31,990.00	0.08
303	002736	国信证券	3,200	31,968.00	0.08
304	603659	璞泰来	1,100	31,823.00	0.08
305	300759	康龙化成	1,100	31,823.00	0.08
306	688036	传音控股	533	31,420.35	0.08
307	688122	西部超导	500	31,405.00	0.08
308	601360	三六零	3,600	31,284.00	0.08
309	002532	天山铝业	2,900	31,117.00	0.07
310	601901	方正证券	4,300	30,960.00	0.07
311	688047	龙芯中科	200	30,934.00	0.07
312	000301	东方盛虹	2,700	30,915.00	0.07
313	300339	润和软件	800	30,808.00	0.07
314	000768	中航西飞	1,500	30,720.00	0.07
315	600026	中远海能	1,700	30,498.00	0.07
316	300001	特锐德	800	30,264.00	0.07
317	002074	国轩高科	1,100	30,261.00	0.07
318	600009	上海机场	1,300	30,030.00	0.07
319	688188	柏楚电子	280	29,876.00	0.07
320	300803	指南针	325	29,792.75	0.07

321	688387	信科移动-U	1,500	29,760.00	0.07
322	301236	软通动力	700	29,715.00	0.07
323	688099	晶晨股份	288	29,635.20	0.07
324	600415	小商品城	2,900	29,464.00	0.07
325	601108	财通证券	3,400	29,410.00	0.07
326	603650	彤程新材	300	29,394.00	0.07
327	002517	恺英网络	1,800	29,250.00	0.07
328	688220	翱捷科技-U	235	29,215.20	0.07
329	600196	复星医药	1,300	29,211.00	0.07
330	002472	双环传动	700	29,057.00	0.07
331	600029	南方航空	5,600	29,008.00	0.07
332	601881	中国银河	2,300	28,911.00	0.07
333	002797	第一创业	4,400	28,908.00	0.07
334	000975	山金国际	1,700	28,900.00	0.07
335	300454	深信服	300	28,860.00	0.07
336	601788	光大证券	2,000	28,860.00	0.07
337	600219	南山铝业	7,200	28,728.00	0.07
338	601186	中国铁建	4,800	28,560.00	0.07
339	300207	欣旺达	1,500	28,485.00	0.07
340	300458	全志科技	720	28,411.20	0.07
341	600233	圆通速递	1,800	28,350.00	0.07
342	600674	川投能源	2,000	28,340.00	0.07
343	002155	湖南黄金	1,180	28,166.60	0.07
344	601958	金钼股份	1,000	28,110.00	0.07
345	002601	龙佰集团	1,700	28,016.00	0.07
346	300115	长盈精密	1,000	27,940.00	0.07
347	601117	中国化学	3,800	27,930.00	0.07
348	603179	新泉股份	560	27,804.00	0.07
349	601991	大唐发电	3,900	27,612.00	0.07
350	601877	正泰电器	1,100	27,577.00	0.07
351	601878	浙商证券	2,900	27,550.00	0.07
352	601698	中国卫通	900	27,225.00	0.07
353	601198	东兴证券	2,000	27,180.00	0.07
354	600372	中航机载	2,500	27,125.00	0.07
355	300763	锦浪科技	300	27,105.00	0.07
356	002465	海格通信	2,100	26,817.00	0.06
357	688169	石头科技	280	26,591.60	0.06
358	603256	宏和科技	100	26,533.00	0.06
359	688183	生益电子	200	26,480.00	0.06
360	688322	奥比中光-W	200	26,110.00	0.06
361	688331	荣昌生物	200	26,052.00	0.06
362	601665	齐鲁银行	4,500	25,965.00	0.06
363	002402	和而泰	1,000	25,830.00	0.06

364	600884	杉杉股份	1,900	25,745.00	0.06
365	301536	星宸科技	200	25,742.00	0.06
366	603129	春风动力	100	25,580.00	0.06
367	600707	彩虹股份	1,500	25,335.00	0.06
368	000963	华东医药	900	25,308.00	0.06
369	300024	机器人	1,300	25,129.00	0.06
370	000060	中金岭南	3,300	24,981.00	0.06
371	300012	华测检测	1,800	24,948.00	0.06
372	002429	兆驰股份	2,400	24,936.00	0.06
373	002444	巨星科技	800	24,880.00	0.06
374	600741	华域汽车	1,600	24,832.00	0.06
375	603688	石英股份	300	24,783.00	0.06
376	300496	中科创达	400	24,716.00	0.06
377	002130	沃尔核材	1,300	24,648.00	0.06
378	000895	双汇发展	1,100	24,640.00	0.06
379	002335	科华数据	580	24,621.00	0.06
380	601162	天风证券	7,300	24,601.00	0.06
381	603156	养元饮品	500	24,535.00	0.06
382	000893	亚钾国际	600	24,534.00	0.06
383	002920	德赛西威	300	24,450.00	0.06
384	001979	招商蛇口	3,800	24,434.00	0.06
385	002056	横店东磁	800	24,384.00	0.06
386	300474	景嘉微	400	24,192.00	0.06
387	603308	应流股份	400	24,160.00	0.06
388	300073	当升科技	500	24,020.00	0.06
389	603920	世运电路	500	24,020.00	0.06
390	601099	太平洋	7,100	23,927.00	0.06
391	301269	华大九天	200	23,884.00	0.06
392	002252	上海莱士	5,500	23,870.00	0.06
393	002414	高德红外	1,800	23,868.00	0.06
394	000878	云南铜业	1,500	23,820.00	0.06
395	002271	东方雨虹	2,000	23,740.00	0.06
396	600109	国金证券	2,700	23,706.00	0.06
397	603979	金诚信	400	23,612.00	0.06
398	601111	中国国航	3,900	23,595.00	0.06
399	688266	泽璟制药-U	200	23,332.00	0.06
400	000034	神州数码	840	23,310.00	0.06
401	601898	中煤能源	1,900	23,142.00	0.06
402	002304	洋河股份	600	22,890.00	0.06
403	002025	航天电器	300	22,866.00	0.06
404	601021	春秋航空	500	22,790.00	0.05
405	603379	三美股份	300	22,767.00	0.05
406	600256	广汇能源	4,600	22,724.00	0.05

407	603087	甘李药业	400	22,704.00	0.05
408	000423	东阿阿胶	500	22,680.00	0.05
409	000733	振华科技	400	22,656.00	0.05
410	002756	永兴材料	400	22,656.00	0.05
411	688615	合合信息	200	22,620.00	0.05
412	600021	上海电力	1,500	22,605.00	0.05
413	300623	捷捷微电	500	22,495.00	0.05
414	601319	中国人保	3,300	22,308.00	0.05
415	600060	海信视像	800	22,296.00	0.05
416	300432	富临精工	1,100	22,099.00	0.05
417	600023	浙能电力	4,200	22,092.00	0.05
418	300142	沃森生物	1,700	22,083.00	0.05
419	601615	明阳智能	1,900	21,983.00	0.05
420	688180	君实生物-U	650	21,983.00	0.05
421	601128	常熟银行	3,762	21,894.84	0.05
422	300919	中伟新材	500	21,875.00	0.05
423	601577	长沙银行	2,500	21,775.00	0.05
424	600298	安琪酵母	600	21,720.00	0.05
425	002157	正邦科技	7,700	21,637.00	0.05
426	600699	均胜电子	1,000	21,610.00	0.05
427	300748	金力永磁	700	21,595.00	0.05
428	601696	中银证券	1,700	21,505.00	0.05
429	688213	思特威-W	200	21,414.00	0.05
430	688385	复旦微电	300	21,387.00	0.05
431	002078	太阳纸业	1,700	21,233.00	0.05
432	002432	九安医疗	300	21,204.00	0.05
433	300724	捷佳伟创	300	21,180.00	0.05
434	688599	天合光能	1,500	21,180.00	0.05
435	688343	云天励飞-U	259	21,149.94	0.05
436	601800	中国交建	3,700	21,127.00	0.05
437	600039	四川路桥	2,700	21,114.00	0.05
438	000002	万科 A	7,100	21,016.00	0.05
439	000728	国元证券	2,800	20,972.00	0.05
440	300866	安克创新	200	20,900.00	0.05
441	600600	青岛啤酒	400	20,892.00	0.05
442	688375	国博电子	200	20,860.00	0.05
443	688187	时代电气	300	20,598.00	0.05
444	600588	用友网络	2,200	20,196.00	0.05
445	000661	长春高新	300	19,980.00	0.05
446	688223	晶科能源	4,203	19,964.25	0.05
447	002831	裕同科技	561	19,949.16	0.05
448	002064	华峰化学	2,100	19,929.00	0.05
449	603606	东方电缆	480	19,924.80	0.05

450	000786	北新建材	1,100	19,899.00	0.05
451	601633	长城汽车	1,300	19,617.00	0.05
452	300677	英科医疗	500	19,585.00	0.05
453	300558	贝达药业	300	19,521.00	0.05
454	603260	合盛硅业	400	19,304.00	0.05
455	001965	招商公路	2,100	19,236.00	0.05
456	600171	上海贝岭	600	19,164.00	0.05
457	688065	凯赛生物	400	19,140.00	0.05
458	600563	法拉电子	100	19,080.00	0.05
459	689009	九号公司-WD	500	19,075.00	0.05
460	603369	今世缘	800	18,968.00	0.05
461	000519	中兵红箭	900	18,963.00	0.05
462	300383	光环新网	1,500	18,660.00	0.04
463	601699	潞安环能	1,300	18,564.00	0.04
464	603160	汇顶科技	300	18,513.00	0.04
465	601607	上海医药	1,200	18,480.00	0.04
466	603806	福斯特	1,100	18,469.00	0.04
467	600642	申能股份	2,100	18,333.00	0.04
468	600027	华电国际	4,100	18,245.00	0.04
469	002673	西部证券	2,800	18,172.00	0.04
470	000559	万向钱潮	1,400	18,102.00	0.04
471	600177	雅戈尔	2,400	18,072.00	0.04
472	601618	中国中冶	7,400	18,056.00	0.04
473	300679	电连技术	300	17,997.00	0.04
474	600516	方大炭素	2,900	17,893.00	0.04
475	300251	光线传媒	1,600	17,744.00	0.04
476	000623	吉林敖东	1,000	17,730.00	0.04
477	600061	国投资本	2,700	17,685.00	0.04
478	300487	蓝晓科技	300	17,655.00	0.04
479	600918	中泰证券	3,300	17,556.00	0.04
480	302132	中航成飞	300	17,496.00	0.04
481	600637	东方明珠	2,100	17,451.00	0.04
482	300896	爱美客	200	17,440.00	0.04
483	002487	大金重工	300	17,391.00	0.04
484	002624	完美世界	1,400	17,388.00	0.04
485	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.04
486	000750	国海证券	4,700	17,296.00	0.04
487	300699	光威复材	600	17,190.00	0.04
488	002065	东华软件	2,400	17,136.00	0.04
489	000617	中油资本	2,600	17,134.00	0.04
490	688676	金盘科技	200	16,928.00	0.04
491	300628	亿联网络	500	16,910.00	0.04
492	600025	华能水电	1,900	16,891.00	0.04

493	600369	西南证券	4,200	16,884.00	0.04
494	600536	中国软件	600	16,872.00	0.04
495	688728	格科微	800	16,832.00	0.04
496	000983	山西焦煤	2,900	16,820.00	0.04
497	300832	新产业	400	16,800.00	0.04
498	000155	川能动力	1,400	16,772.00	0.04
499	688172	燕东微	200	16,732.00	0.04
500	002318	久立特材	700	16,730.00	0.04
501	001696	宗申动力	800	16,648.00	0.04
502	002085	万丰奥威	1,500	16,635.00	0.04
503	002044	美年健康	3,300	16,599.00	0.04
504	300003	乐普医疗	1,400	16,590.00	0.04
505	688568	中科星图	400	16,588.00	0.04
506	600499	科达制造	1,200	16,560.00	0.04
507	600100	同方股份	2,400	16,440.00	0.04
508	300002	神州泰岳	2,100	16,401.00	0.04
509	688472	阿特斯	1,507	16,305.74	0.04
510	600862	中航高科	900	16,227.00	0.04
511	601059	信达证券	1,000	16,190.00	0.04
512	600085	同仁堂	700	16,177.00	0.04
513	600515	海南机场	5,900	16,166.00	0.04
514	603345	安井食品	200	16,038.00	0.04
515	000629	钒钛股份	4,800	16,032.00	0.04
516	000596	古井贡酒	200	15,960.00	0.04
517	601997	贵阳银行	3,100	15,903.00	0.04
518	000415	渤海租赁	3,900	15,873.00	0.04
519	600521	华海药业	1,100	15,840.00	0.04
520	600803	新奥股份	1,000	15,800.00	0.04
521	601212	白银有色	3,100	15,748.00	0.04
522	600595	中孚实业	2,800	15,736.00	0.04
523	603225	新凤鸣	800	15,720.00	0.04
524	601001	晋控煤业	900	15,651.00	0.04
525	601216	君正集团	3,500	15,610.00	0.04
526	000683	博源化工	2,700	15,552.00	0.04
527	601016	节能风电	4,000	15,520.00	0.04
528	600863	华能蒙电	3,300	15,510.00	0.04
529	603766	隆鑫通用	1,300	15,509.00	0.04
530	600765	中航重机	1,200	15,504.00	0.04
531	002430	杭氧股份	500	15,480.00	0.04
532	600985	淮北矿业	1,100	15,455.00	0.04
533	000039	中集集团	1,900	15,409.00	0.04
534	688336	三生国健	290	15,399.00	0.04
535	002223	鱼跃医疗	600	15,396.00	0.04

536	002739	儒意电影	1,600	15,360.00	0.04
537	300627	华测导航	540	15,336.00	0.04
538	601717	中创智领	1,100	15,301.00	0.04
539	603290	斯达半导	100	15,294.00	0.04
540	600486	扬农化工	300	15,210.00	0.04
541	000729	燕京啤酒	1,500	15,195.00	0.04
542	000400	许继电气	700	15,190.00	0.04
543	601990	南京证券	2,300	15,111.00	0.04
544	600704	物产中大	3,200	15,104.00	0.04
545	603699	纽威股份	300	15,090.00	0.04
546	000999	华润三九	670	15,068.30	0.04
547	000032	深桑达A	600	14,970.00	0.04
548	600845	宝信软件	900	14,967.00	0.04
549	000050	深天马A	1,500	14,865.00	0.04
550	603077	和邦生物	6,400	14,848.00	0.04
551	688538	和辉光电-U	5,678	14,762.80	0.04
552	603596	伯特利	592	14,705.28	0.04
553	600873	梅花生物	2,000	14,700.00	0.04
554	002683	广东宏大	500	14,645.00	0.04
555	000738	航发控制	800	14,632.00	0.04
556	600166	福田汽车	5,000	14,550.00	0.04
557	600348	华阳股份	1,900	14,535.00	0.04
558	601611	中国核建	1,300	14,495.00	0.03
559	000830	鲁西化工	1,200	14,400.00	0.03
560	688248	南网科技	208	14,389.44	0.03
561	603298	杭叉集团	600	14,316.00	0.03
562	000887	中鼎股份	800	14,312.00	0.03
563	600363	联创光电	400	14,312.00	0.03
564	600930	华电新能	3,000	14,310.00	0.03
565	600153	建发股份	1,800	14,274.00	0.03
566	688318	财富趋势	200	14,262.00	0.03
567	002939	长城证券	1,700	14,178.00	0.03
568	601456	国联民生	1,600	14,144.00	0.03
569	600312	平高电气	800	14,128.00	0.03
570	688281	华秦科技	280	14,064.40	0.03
571	300122	智飞生物	1,200	14,028.00	0.03
572	600332	白云山	700	14,028.00	0.03
573	300676	华大基因	400	14,024.00	0.03
574	688166	博瑞医药	400	14,004.00	0.03
575	300999	金龙鱼	600	13,956.00	0.03
576	002410	广联达	1,700	13,872.00	0.03
577	002841	视源股份	400	13,812.00	0.03
578	600901	江苏金租	2,400	13,800.00	0.03

579	000967	盈峰环境	1,300	13,689.00	0.03
580	600018	上港集团	2,900	13,688.00	0.03
581	002266	浙富控股	2,700	13,662.00	0.03
582	000921	海信家电	500	13,660.00	0.03
583	600737	中粮糖业	1,100	13,563.00	0.03
584	600578	京能电力	2,100	13,545.00	0.03
585	002603	以岭药业	900	13,500.00	0.03
586	002007	华兰生物	1,100	13,409.00	0.03
587	300953	震裕科技	100	13,370.00	0.03
588	000591	太阳能	2,900	13,340.00	0.03
589	603119	浙江荣泰	200	13,268.00	0.03
590	600398	海澜之家	2,500	13,075.00	0.03
591	002926	华西证券	1,600	13,072.00	0.03
592	688582	芯动联科	200	13,000.00	0.03
593	603568	伟明环保	840	12,919.20	0.03
594	601018	宁波港	4,100	12,915.00	0.03
595	601000	唐山港	3,100	12,865.00	0.03
596	688009	中国通号	2,700	12,852.00	0.03
597	000528	柳工	1,700	12,835.00	0.03
598	603338	浙江鼎力	300	12,750.00	0.03
599	000062	深圳华强	400	12,728.00	0.03
600	600998	九州通	2,700	12,663.00	0.03
601	000708	中信特钢	1,000	12,620.00	0.03
602	000987	越秀资本	1,600	12,512.00	0.03
603	600008	首创环保	4,600	12,512.00	0.03
604	000932	华菱钢铁	3,600	12,492.00	0.03
605	600208	衢州发展	4,400	12,452.00	0.03
606	600170	上海建工	5,600	12,432.00	0.03
607	688772	珠海冠宇	632	12,406.16	0.03
608	600132	重庆啤酒	300	12,390.00	0.03
609	600435	北方导航	1,100	12,320.00	0.03
610	600995	南网储能	1,000	12,300.00	0.03
611	600763	通策医疗	362	12,264.56	0.03
612	600483	福能股份	1,200	12,228.00	0.03
613	002152	广电运通	1,300	12,194.00	0.03
614	603728	鸣志电器	200	12,184.00	0.03
615	688295	中复神鹰	200	12,108.00	0.03
616	603605	珀莱雅	200	11,984.00	0.03
617	600820	隧道股份	2,300	11,983.00	0.03
618	001203	大中矿业	400	11,980.00	0.03
619	600282	南钢股份	2,600	11,934.00	0.03
620	000737	北方铜业	900	11,898.00	0.03
621	601106	中国一重	3,600	11,880.00	0.03

622	000009	中国宝安	1,900	11,837.00	0.03
623	000951	中国重汽	600	11,706.00	0.03
624	300413	芒果超媒	800	11,704.00	0.03
625	601238	广汽集团	2,300	11,684.00	0.03
626	600161	天坛生物	1,000	11,580.00	0.03
627	600583	海油工程	2,300	11,569.00	0.03
628	000513	丽珠集团	400	11,556.00	0.03
629	601666	平煤股份	1,600	11,440.00	0.03
630	000997	新大陆	700	11,410.00	0.03
631	300735	光弘科技	500	11,370.00	0.03
632	002500	山西证券	2,200	11,352.00	0.03
633	601156	东航物流	700	11,284.00	0.03
634	600602	云赛智联	700	11,256.00	0.03
635	002262	恩华药业	600	11,250.00	0.03
636	603816	顾家家居	500	11,180.00	0.03
637	600316	洪都航空	400	11,176.00	0.03
638	600329	达仁堂	300	11,166.00	0.03
639	300100	双林股份	400	11,112.00	0.03
640	002312	川发龙蟒	1,200	11,004.00	0.03
641	600546	山煤国际	1,000	10,930.00	0.03
642	600801	华新建材	700	10,920.00	0.03
643	688278	特宝生物	200	10,880.00	0.03
644	688778	厦钨新能	200	10,880.00	0.03
645	603392	万泰生物	400	10,788.00	0.03
646	603939	益丰药房	600	10,788.00	0.03
647	000582	北部湾港	1,000	10,730.00	0.03
648	000723	美锦能源	3,200	10,720.00	0.03
649	601880	辽港股份	7,700	10,626.00	0.03
650	600562	国睿科技	500	10,610.00	0.03
651	600535	天士力	800	10,584.00	0.03
652	601399	国机重装	3,000	10,500.00	0.03
653	600390	五矿资本	2,300	10,488.00	0.03
654	601567	三星电气	700	10,458.00	0.03
655	600906	财达证券	1,400	10,444.00	0.03
656	600511	国药股份	400	10,416.00	0.03
657	600380	健康元	1,100	10,362.00	0.02
658	003022	联泓新科	400	10,360.00	0.02
659	600977	中国电影	800	10,336.00	0.02
660	000598	兴蓉环境	1,600	10,272.00	0.02
661	601155	新城控股	1,000	10,260.00	0.02
662	688303	大全能源	588	10,248.84	0.02
663	688563	航材股份	200	10,246.00	0.02
664	601236	红塔证券	1,500	10,230.00	0.02

665	688114	华大智造	200	10,216.00	0.02
666	600685	中船防务	400	10,176.00	0.02
667	603486	科沃斯	200	10,150.00	0.02
668	600038	中直股份	400	10,116.00	0.02
669	600816	建元信托	4,100	10,004.00	0.02
670	000739	普洛药业	600	9,996.00	0.02
671	600970	中材国际	1,400	9,982.00	0.02
672	300146	汤臣倍健	1,100	9,944.00	0.02
673	002244	滨江集团	1,300	9,880.00	0.02
674	600967	内蒙一机	900	9,765.00	0.02
675	002120	韵达股份	1,500	9,540.00	0.02
676	000883	湖北能源	2,200	9,504.00	0.02
677	000027	深圳能源	1,500	9,300.00	0.02
678	300144	宋城演艺	1,600	9,296.00	0.02
679	603885	吉祥航空	900	9,261.00	0.02
680	002299	圣农发展	600	9,096.00	0.02
681	601608	中信重工	1,900	9,063.00	0.02
682	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.02
683	601866	中远海发	4,100	9,061.00	0.02
684	600095	湘财股份	1,200	9,036.00	0.02
685	000088	盐田港	2,200	8,998.00	0.02
686	600754	锦江酒店	500	8,995.00	0.02
687	000800	一汽解放	1,500	8,925.00	0.02
688	600566	济川药业	400	8,876.00	0.02
689	603000	人民网	600	8,874.00	0.02
690	601118	海南橡胶	1,800	8,856.00	0.02
691	603565	中谷物流	900	8,829.00	0.02
692	600131	国网信通	600	8,760.00	0.02
693	003021	兆威机电	100	8,735.00	0.02
694	600126	杭钢股份	1,400	8,582.00	0.02
695	600871	石化油服	4,200	8,526.00	0.02
696	603341	龙旗科技	200	8,498.00	0.02
697	002568	百润股份	500	8,460.00	0.02
698	002583	海能达	1,100	8,459.00	0.02
699	600517	国网英大	1,800	8,424.00	0.02
700	601865	福莱特	800	8,408.00	0.02
701	601136	首创证券	600	8,370.00	0.02
702	000709	河钢股份	4,300	8,342.00	0.02
703	688297	中无人机	200	8,310.00	0.02
704	603899	晨光股份	400	8,252.00	0.02
705	002423	中粮资本	1,000	8,230.00	0.02
706	600655	豫园股份	2,000	8,220.00	0.02
707	002773	康弘药业	400	8,180.00	0.02

708	601966	玲珑轮胎	800	8,152.00	0.02
709	001286	陕西能源	800	8,112.00	0.02
710	301165	锐捷网络	100	8,045.00	0.02
711	600004	白云机场	1,100	7,986.00	0.02
712	688192	迪哲医药-U	200	7,986.00	0.02
713	601598	中国外运	1,600	7,936.00	0.02
714	002032	苏泊尔	200	7,920.00	0.02
715	000825	太钢不锈	2,300	7,843.00	0.02
716	002984	森麒麟	600	7,842.00	0.02
717	688709	成都华微	200	7,618.00	0.02
718	600598	北大荒	700	7,588.00	0.02
719	600582	天地科技	1,700	7,565.00	0.02
720	600663	陆家嘴	1,200	7,536.00	0.02
721	603737	三棵树	312	7,519.20	0.02
722	603233	大参林	500	7,515.00	0.02
723	600848	上海临港	1,000	7,490.00	0.02
724	603589	口子窖	400	7,472.00	0.02
725	002508	老板电器	500	7,310.00	0.02
726	603858	步长制药	500	7,300.00	0.02
727	688363	华熙生物	203	7,261.31	0.02
728	601928	凤凰传媒	800	7,032.00	0.02
729	600968	海油发展	2,100	6,993.00	0.02
730	003035	南网能源	1,200	6,984.00	0.02
731	601098	中南传媒	700	6,888.00	0.02
732	688520	神州细胞	200	6,842.00	0.02
733	000429	粤高速 A	500	6,825.00	0.02
734	600688	上海石化	2,300	6,739.00	0.02
735	600350	山东高速	600	6,678.00	0.02
736	001280	中国铀业	100	6,670.00	0.02
737	002670	国盛证券	600	6,600.00	0.02
738	002153	石基信息	900	6,507.00	0.02
739	600098	广州发展	1,100	6,501.00	0.02
740	601808	中海油服	600	6,486.00	0.02
741	600295	鄂尔多斯	600	6,432.00	0.02
742	688425	铁建重工	1,600	6,432.00	0.02
743	600062	华润双鹤	400	6,416.00	0.02
744	300957	贝泰妮	200	6,302.00	0.02
745	600808	马钢股份	2,500	6,250.00	0.02
746	000539	粤电力 A	900	6,129.00	0.01
747	300718	长盛轴承	100	6,097.00	0.01
748	603833	欧派家居	200	6,022.00	0.01
749	688349	三一重能	390	5,920.20	0.01
750	603529	爱玛科技	300	5,853.00	0.01

751	000537	绿发电力	800	5,848.00	0.01
752	603658	安图生物	200	5,804.00	0.01
753	600377	宁沪高速	500	5,785.00	0.01
754	600032	浙江新能	800	5,640.00	0.01
755	601298	青岛港	700	5,635.00	0.01
756	000959	首钢股份	1,600	5,616.00	0.01
757	300888	稳健医疗	200	5,598.00	0.01
758	301301	川宁生物	700	5,558.00	0.01
759	002608	江苏国信	800	5,520.00	0.01
760	688475	萤石网络	200	5,470.00	0.01
761	600606	绿地控股	4,400	5,324.00	0.01
762	600764	中国海防	300	5,229.00	0.01
763	002265	建设工业	300	5,220.00	0.01
764	600339	中油工程	1,700	5,219.00	0.01
765	000785	居然智家	2,600	5,200.00	0.01
766	601139	深圳燃气	900	5,094.00	0.01
767	600927	永安期货	400	4,980.00	0.01
768	600292	电投水电	400	4,816.00	0.01
769	000937	冀中能源	1,210	4,815.80	0.01
770	688561	奇安信-U	200	4,796.00	0.01
771	000898	鞍钢股份	2,500	4,675.00	0.01
772	603049	中策橡胶	100	4,481.00	0.01
773	601019	山东出版	700	4,480.00	0.01
774	688819	天能股份	200	4,440.00	0.01
775	601228	广州港	1,500	4,230.00	0.01
776	603786	科博达	100	4,091.00	0.01
777	001391	国货航	1,000	4,070.00	0.01
778	301498	乖宝宠物	100	4,059.00	0.01
779	002945	华林证券	300	4,029.00	0.01
780	300140	节能环境	700	3,479.00	0.01
781	600299	安迪苏	400	3,140.00	0.01
782	002461	珠江啤酒	400	3,028.00	0.01
783	601112	振石股份	100	1,823.00	0.00
784	001386	马可波罗	100	1,416.00	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

注：无。

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	600519	贵州茅台	436,599.00	1.17
2	601318	中国平安	343,390.00	0.92

3	601899	紫金矿业	318,612.00	0.85
4	600036	招商银行	242,905.00	0.65
5	600900	长江电力	166,152.00	0.45
6	688041	海光信息	166,126.38	0.45
7	601166	兴业银行	157,847.00	0.42
8	000988	华工科技	152,418.00	0.41
9	600030	中信证券	140,624.00	0.38
10	600276	恒瑞医药	135,829.00	0.36
11	688072	拓荆科技	134,420.00	0.36
12	601138	工业富联	124,474.00	0.33
13	603259	药明康德	124,320.00	0.33
14	601398	工商银行	119,101.00	0.32
15	688008	澜起科技	107,574.00	0.29
16	688981	中芯国际	106,782.00	0.29
17	601211	国泰海通	106,181.00	0.28
18	603993	洛阳钼业	99,960.00	0.27
19	601288	农业银行	98,295.00	0.26
20	603986	兆易创新	96,102.00	0.26

注：买入金额按买入成交金额（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	425,827.00	1.14
2	601318	中国平安	333,784.00	0.90
3	601899	紫金矿业	307,775.00	0.83
4	600487	亨通光电	256,486.00	0.69
5	600036	招商银行	247,327.00	0.66
6	600900	长江电力	172,007.00	0.46
7	688041	海光信息	162,760.24	0.44
8	601166	兴业银行	161,945.00	0.43
9	600030	中信证券	139,591.00	0.37
10	688525	佰维存储	139,312.00	0.37
11	600276	恒瑞医药	132,920.00	0.36
12	601398	工商银行	120,990.00	0.32
13	601138	工业富联	120,929.00	0.32
14	603259	药明康德	120,112.00	0.32
15	601211	国泰海通	103,324.00	0.28
16	688008	澜起科技	103,162.00	0.28
17	688981	中芯国际	102,758.00	0.28
18	601288	农业银行	101,264.00	0.27
19	603993	洛阳钼业	95,199.00	0.26
20	601328	交通银行	94,164.00	0.25

注：卖出金额按卖出成交金额（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	11,375,101.75
卖出股票收入（成交）总额	11,111,499.76

注：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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	71,999.58
8	其他	-
9	合计	71,999.58

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

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，投资组合报告中数字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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数	户均持有的	持有人结构

（户）	基金份额	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（%）
597	44,785.26	17,074,123.00	63.86	9,662,679.00	36.14

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
华泰证券股份有限公司-鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	8,568,204.00	32.05

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

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

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 6 月 27 日）基金份额总额	590,736,802.00
本报告期期初基金份额总额	26,736,802.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	12,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	26,736,802.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原副总经理李伟先生因个人原因辞职，经公司第六届董事会第三百三十八次会议审议通过，自 2026 年 4 月 3 日起，李伟先生不再担任公司副总经理。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人的专门托管部门（即资产托管部）及其该部门高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人的专门托管部门（即资产托管部）相关从业人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
华泰证券	6	22,486,601.51	100.00	4,406.26	100.00	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称《规定》），基金管理人制定了相应的管理制度规范交易单元选择的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖

的证券公司，选择标准包括：财务状况良好，经营行为规范；有完备的合规管理流程和制度，风险控制能力较强；研究、交易等服务能力较强，交易设施能够为投资组合提供有效的交易执行；中国证监会或有权机关规定的其他条件等。

2.选择程序如下：

（1）基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；

（2）基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；

（3）基金管理人定期对证券公司进行评价，依据评价结果选择交易单元。

3.根据《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；其他类型基金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。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 15 日
2	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 20 日
3	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 21 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国国际金融股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 25 日
5	鹏华基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 02 日
6	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监	2026 年 03 月 30 日

		会基金电子披露网站	
7	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 04 日
8	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 17 日
9	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 21 日
10	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 05 月 08 日
11	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 05 月 08 日
12	鹏华基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 05 月 30 日
13	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金新增流动性服务商的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 06 月 23 日
14	鹏华基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 06 月 24 日

注：无。

§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	20260101~20260630	8,590,604.00	273,900.00	296,300.00	8,568,204.00	32.05
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金在迷你期间如涉及信息披露费、审计费等固定费用的，上述费用由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

（二）《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

（三）《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告》（原文）。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（http://www.phfund.com.cn）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日