

天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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:2026 年 08 月 31 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。

基金托管人广发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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	73
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	73
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	73
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	73
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
7.12 投资组合报告附注	74
§8 基金份额持有人信息	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75

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.....	76
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	76
§9 开放式基金份额变动.....	76
§10 重大事件揭示	76
10.1 基金份额持有人大会决议	76
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	77
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
10.4 基金投资策略的改变	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	77
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	78
10.8 其他重大事件	79
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
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.....	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§12 备查文件目录.....	80
12.1 备查文件目录	80
12.2 存放地点.....	80
12.3 查阅方式.....	81

§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	33,507,412.71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	11,960,328.04份	21,547,084.67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		400-986-8888	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（新金融大厦）16层02单元3号房间	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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告置备地点	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 (2026年01月01日-2026年06月30日)	
	天弘中证800A	天弘中证800C
本期已实现收益	1,194,430.43	2,111,740.94
本期利润	2,064,367.11	3,499,700.06
加权平均基金份额本期利润	0.1603	0.1451
本期加权平均净值利润率	10.55%	9.77%
本期基金份额净值增长率	11.03%	10.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	天弘中证800A	天弘中证800C
期末可供分配利润	7,388,132.28	12,503,370.77
期末可供分配基金份额利润	0.6177	0.5803
期末基金资产净值	19,348,460.32	34,050,455.44
期末基金份额净值	1.6177	1.5803
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	天弘中证800A	天弘中证800C
基金份额累计净值增长率	61.77%	58.03%

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		
过去三个月	13.69%	1.27%	13.02%	1.27%	0.67%	0.00%
过去六个月	11.03%	1.18%	10.59%	1.18%	0.44%	0.00%
过去一年	33.18%	1.03%	31.40%	1.04%	1.78%	-0.01%
过去三年	42.03%	1.10%	33.43%	1.12%	8.60%	-0.02%
过去五年	14.60%	1.07%	3.99%	1.09%	10.61%	-0.02%
过去七年	78.18%	1.11%	40.39%	1.12%	37.79%	-0.01%
过去十年	111.85%	1.09%	52.65%	1.10%	59.20%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今	61.77%	1.22%	24.47%	1.23%	37.30%	-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
过去三个月	13.63%	1.27%	13.02%	1.27%	0.61%	0.00%
过去六个月	10.92%	1.18%	10.59%	1.18%	0.33%	0.00%
过去一年	32.92%	1.03%	31.40%	1.04%	1.52%	-0.01%
过去三年	41.19%	1.10%	33.43%	1.12%	7.76%	-0.02%
过去五年	13.47%	1.07%	3.99%	1.09%	9.48%	-0.02%
过去七年	75.69%	1.11%	40.39%	1.12%	35.30%	-0.01%
过去十年	107.47%	1.09%	52.65%	1.10%	54.82%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今	58.03%	1.22%	24.47%	1.23%	33.56%	-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-2026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-2026年06月30日)



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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2026年06月30日，公司共管理运作267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		
尤聪	本基金基金经理	2025年11月14日	-	13年	女，计算金融与风险管理专业硕士。历任华盛顿大学资产管理公司量化研究员、北美信托银行信用风险管理顾问、北美信托资产管理公司股票量化投资经理。2021年10月加盟本公司。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规有关规定及基金合同相关约定进行操作，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的有关规定以及基金合同的相关约定，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

报告期内本基金秉承合规第一、风控第一的原则，在运作过程中严格遵守基金合同，采取被动复制的方式跟踪标的指数，追求基金净值增长率与基准指数的高度正相关及跟踪误差最小化。

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回、打新以及成分股调整等因素。当申赎情况可能对指数跟踪效果产生影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪标的指数。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2026年06月30日，天弘中证800A基金份额净值为1.6177元，天弘中证800C基金份额净值为1.5803元。报告期内份额净值增长率天弘中证800A为11.03%，同期业绩比较基准增长率为10.59%；天弘中证800C为10.92%，同期业绩比较基准增长率为10.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026年上半年，国内宏观经济整体温和修复，呈现外需强、内需弱、结构分化显著的格局，股票市场同步走出结构性分化行情。

外需是本轮经济修复的核心支撑，上半年出口增速大幅超预期，高技术产品出口实现显著增长。展望下半年，我国出口韧性有望维持，增长增量仍集中于技术与资本密集型领域，主要不确定性扰动来自欧盟对华贸易政策调整及中东地缘冲突。内需整体偏弱、复苏节奏温和。消费端受高基数拖累，上半年社零增速逐月走弱、整体小幅增长；伴随基数效应逐步消退，下半年社零同比增速有望回暖。当前居民收入增速高于消费支出增速，叠加居民储蓄意愿偏高，居民部门资产负债表仍处于修复阶段，消费复苏力度相对有限。投资端结构性分化特征明显。上半年房地产投资持续下行，专项债发行节奏偏慢，拖累基建整体增速表现平淡。下半年随着专项债发行提速，叠加超长期特别国债、政策性金融工具落地见效，基建投资将持续发挥托底经济的作用。制造业投资延续分化格局，传统产能持续出清，高技术产业投资保持高增，成为制造业投资的核心支撑，该结构性趋势预计下半年延续。

2026年上半年，股票市场映射出宏观经济新旧动能转换的结构性特征，资金在弱复苏环境下对高景气度与确定性形成明显的倾向性。行业景气度成为市场核心定价主线，资金高度聚焦科技赛道，成长风格大幅占优，价值、红利及微盘板块表现相对偏弱。展望下半年，市场定价逻辑或将切换，由前期风险偏好驱动的估值扩张，转向以基本面和业绩兑现为核心的定价体系。高景气赛道将全面进入业绩验证估值的阶段，业绩兑现能力将直接决定行情的持续性；若业绩如期落地兑现，前期偏高估值将得到有效消化，长线资金仍将持续沉淀布局。与此同时，下半年市场极致的风格分化格局有望收敛，处于估值底部的传统行业若出现业绩企稳、边际改善的信号，将在市场风格再平衡的趋势下吸引资金回流，迎来估值修复行情与优质配置机会。中证800指数覆盖沪深市场中具有较强代表性的中大市值公司，较为均衡地反映了经济转型中的新兴动能与传统产业的修复机遇。在市场更加重视盈利质量与估值匹配度的阶段，宽基指数的分散化配置价值有

望得到体现，投资者可关注经济基本面改善、企业业绩修复和市场风格再平衡带来的影响。

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，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。

本基金托管人根据法律法规要求履行基金估值及净值计算的复核责任。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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2026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：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,976,947.00	3,024,655.86
结算备付金		9,476.69	54,859.64
存出保证金		18,786.04	6,273.74
交易性金融资产	6.4.7.2	50,770,163.47	51,026,381.76
其中：股票投资		50,769,163.42	51,025,381.74
基金投资		-	-
债券投资		1,000.05	1,000.02
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		116,992.16	502,070.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-

资产总计		53,892,365.36	54,614,241.14
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06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		0.02	269,429.33
应付赎回款		398,343.49	425,169.12
应付管理人报酬		21,854.87	22,309.94
应付托管费		4,370.95	4,461.97
应付销售服务费		5,624.57	5,548.95
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	63,255.70	124,978.65
负债合计		493,449.60	851,897.96
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	33,507,412.71	37,426,680.31
未分配利润	6.4.7.8	19,891,503.05	16,335,662.87
净资产合计		53,398,915.76	53,762,343.18
负债和净资产总计		53,892,365.36	54,614,241.14

注：报告截止日2026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1.6177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1.5803元；基金份额总额33,507,412.71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11,960,328.04份，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额21,547,084.67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：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		5,823,861.69	1,015,134.99
1.利息收入		11,587.44	10,673.77
其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,587.44	10,673.77
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）		3,542,974.29	-465,095.16
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,078,978.10	-1,084,940.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,946.09	148.41
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	462,050.10	619,696.67
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	2,257,895.80	1,468,657.76
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	11,404.16	898.62
减：二、营业总支出		259,794.52	241,880.03

1.管理人报酬		137,306.83	128,123.85
2.托管费		27,461.34	25,624.77
3.销售服务费		35,515.10	26,304.88
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	59,511.25	61,826.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,564,067.17	773,254.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,564,067.17	773,254.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,564,067.17	773,254.96

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：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月01日至2026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	37,426,680.31	16,335,662.87	53,762,343.18
二、本期期初净资产	37,426,680.31	16,335,662.87	53,762,343.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号	-3,919,267.60	3,555,840.18	-363,427.42

填列)			
(一)、综合收益总额	-	5,564,067.17	5,564,067.17
(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)	-3,919,267.60	-2,008,226.99	-5,927,494.59
其中: 1.基金申购款	25,067,891.53	12,327,288.72	37,395,180.25
2.基金赎回款	-28,987,159.13	-14,335,515.71	-43,322,674.84
(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	33,507,412.71	19,891,503.05	53,398,915.76
项 目	上年度可比期间 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	-6,378,012.38	-1,164,428.41	-7,542,440.79

产减少以“-”号填列)			
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

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	迟哲	薄贺龙
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘中证800指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）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发布的《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》、《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》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

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2026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2026年06月30日的财务状况以及2026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》、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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对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。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。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按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) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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 2026年06月30日
活期存款	2,976,947.00
等于：本金	2,976,314.08
加：应计利息	632.92
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	2,976,947.00

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		40,949,116.72	-	50,769,163.42	9,820,046.70
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,000.00	0.05	1,000.05	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,000.00	0.05	1,000.05	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		40,950,116.72	0.05	50,770,163.47	9,820,046.70

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 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	37.82
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	3,710.51
其中：交易所市场	3,710.51
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	59,507.37
合计	63,255.70

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 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,601,893.16	13,601,893.16
本期申购	3,351,582.86	3,351,582.86
本期赎回（以“-”号填列）	-4,993,147.98	-4,993,147.98
本期末	11,960,328.04	11,960,328.04

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 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,824,787.15	23,824,787.15
本期申购	21,716,308.67	21,716,308.67
本期赎回（以“-”号填列）	-23,994,011.15	-23,994,011.15
本期末	21,547,084.67	21,547,084.67

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	7,249,528.89	-1,032,903.87	6,216,625.02
本期期初	7,249,528.89	-1,032,903.87	6,216,625.02
本期利润	1,194,430.43	869,936.68	2,064,367.11
本期基金份额交易产生的变动数	-930,468.33	37,608.48	-892,859.85
其中：基金申购款	1,878,347.93	-126,140.50	1,752,207.43
基金赎回款	-2,808,816.26	163,748.98	-2,645,067.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,513,490.99	-125,358.71	7,388,132.28

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	11,981,676.65	-1,862,638.80	10,119,037.85
本期期初	11,981,676.65	-1,862,638.80	10,119,037.85
本期利润	2,111,740.94	1,387,959.12	3,499,700.06
本期基金份额交易产生的变动数	-1,283,919.40	168,552.26	-1,115,367.14
其中：基金申购款	11,432,961.52	-857,880.23	10,575,081.29
基金赎回款	-12,716,880.92	1,026,432.49	-11,690,448.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,809,498.19	-306,127.42	12,503,370.77

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	11,532.41
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	30.43
其他	24.60
合计	11,587.44

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 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	16,461,892.25
减：卖出股票成本总额	13,367,250.31
减：交易费用	15,663.84
买卖股票差价收入	3,078,978.10

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 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	0.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,945.92
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	1,946.09

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 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）	4,446.24

成交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,500.00
减：应计利息总额	0.14
减：交易费用	0.18
买卖债券差价收入	1,945.92

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	462,050.10
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	462,050.10

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	2,257,895.80
——股票投资	2,257,895.80
——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	2,257,895.80

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	7,972.27
基金转换费收入	3,431.89
合计	11,404.16

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 2026年01月01日至2026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	-
存托服务费	3.88
合计	59,511.25

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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额	成交金额	占当期股票成交总额

		的比例		的比例
广发证券股份有限公司	15,618,774.48	57.18%	9,558,525.73	75.57%

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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025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	3,436.24	77.28%	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 2026年01月01日至2026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	3,247.65	57.18%	2,159.04	58.19%

公司				
关联方名称	上年度可比期间 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%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以未包含印花税、经手费、证管费和过户费等费用的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，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01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	137,306.83	128,123.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	59,240.96	55,540.08
应支付基金管理人的净管理费	78,065.87	72,583.77

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 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	27,461.34	25,624.77

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 2026年01月01日至2026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	-	6,589.79	6,589.79
广发证券 股份有限 公司	-	168.82	168.82
合计	-	6,758.61	6,758.61
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 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	-	150.46	150.46

公司			
合计	-	5,533.95	5,533.95

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。

3、根据《公开募集证券投资基金销售费用管理规定》，自该规定施行之日起，或对于已发售基金，自其完成基金合同修订及相关调整之日起，投资人通过基金管理人认购/申购的或者通过代销机构认购/申购且持续持有期限超过一年的基金份额不收取销售服务费。本基金按照该法规要求对不应收取的销售服务费将在投资者赎回基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者。

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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	2,976,947.00	11,532.41	2,539,029.79	10,637.23

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，本基金持有广发证券的股票3,800股（上年度末：4,300股），估值总额为人民币88,920.00元（上年度末：94,686.00元），占基金净资产的比例为0.17%（上年度末：0.18%）；本报告期末，本基金持有君正集团的股票4,300股（上年度末：5,000股），估值总额为人民币19,178.00元（上年度末：24,100.00元），占基金净资产的比例为0.04%（上年度末：0.04%）；本报告期末，本基金持有托管人的重要关联方吉林敖东的股票1,243股（上年度末：1,443股），估值总额为人民币22,038.39元（上年度末：28,181.79元），占基金净资产的比例为0.04%（上年度末：0.05%）；本报告期末，本基金持有托管人的重要关联方辽宁成大的股票0股（上年度末：1,300股），估值总额为人民币0.00元（上年度末：14,534.00元），占基金净资产的比例为0.00%（上年度末：0.03%）。

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（2026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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026-06-10	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	10	1,000.00	1,000.05	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项	879.53	2026-07-13	890.99	200	133,754.00	175,906.00	-

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

截至本报告期末2026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质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026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质押的债券。

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借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性很小；

在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	1,000.05	1,000.02
未评级	-	-
合计	1,000.05	1,000.02

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上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。

本基金于报告期末的卖出回购金融资产款（若有）计息且利息金额不重大；本基金所承担的其他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，因此账面余额约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 2026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	2,976,947.00	-	-	-	2,976,947.00
结算备付金	9,476.69	-	-	-	9,476.69
存出保证金	18,786.04	-	-	-	18,786.04
交易性金融资产	-	-	1,000.05	50,769,163.42	50,770,163.47
应收申购款	-	-	-	116,992.16	116,992.16
资产总计	3,005,209.73	-	1,000.05	50,886,155.58	53,892,365.36
负债					
应付清算款	-	-	-	0.02	0.02

应付赎回款	-	-	-	398,343.49	398,343.49
应付管理人报酬	-	-	-	21,854.87	21,854.87
应付托管费	-	-	-	4,370.95	4,370.95
应付销售服务费	-	-	-	5,624.57	5,624.57
其他负债	-	-	-	63,255.70	63,255.70
负债总计	-	-	-	493,449.60	493,449.60
利率敏感度缺口	3,005,209.73	-	1,000.05	50,392,705.98	53,398,915.76
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	3,024,655.86	-	-	-	3,024,655.86
结算备付金	54,859.64	-	-	-	54,859.64
存出保证金	6,273.74	-	-	-	6,273.74
交易性金融资产	-	-	1,000.02	51,025,381.74	51,026,381.76
应收申购款	-	-	-	502,070.14	502,070.14
资产总计	3,085,789.24	-	1,000.02	51,527,451.88	54,614,241.14
负债					
应付清算款	-	-	-	269,429.33	269,429.33
应付赎回款	-	-	-	425,169.12	425,169.12
应付管理人报酬	-	-	-	22,309.94	22,309.94
应付托管费	-	-	-	4,461.97	4,461.97
应付销售服务费	-	-	-	5,548.95	5,548.95
其他负债	-	-	-	124,978.65	124,978.65
负债总计	-	-	-	851,897.96	851,897.96
利率敏感度缺口	3,085,789.24	-	1,000.02	50,675,553.92	53,762,343.18

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2026年06月30日，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.00%(2025年12月31日：0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2025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 2026年06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	50,769,163.42	95.08	51,025,381.74	94.91
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	50,769,163.42	95.08	51,025,381.74	94.91

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,972,036.29	2,855,034.79
	业绩比较基准下降5%	-2,972,036.29	-2,855,034.79

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06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	50,593,257.42	50,777,172.99
第二层次	176,906.05	249,208.77
第三层次	-	-
合计	50,770,163.47	51,026,381.76

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值的最低层次，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2026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(2025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	50,769,163.42	94.20
	其中：股票	50,769,163.42	94.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,000.05	0.00
	其中：债券	1,000.05	0.00
	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	2,986,423.69	5.54

8	其他各项资产	135,778.20	0.25
9	合计	53,892,365.36	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	253,516.00	0.47
B	采矿业	1,959,949.14	3.67
C	制造业	34,003,751.37	63.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,250,996.40	2.34
E	建筑业	500,675.34	0.94
F	批发和零售业	315,639.58	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	1,053,338.74	1.97
H	住宿和餐饮业	10,794.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,080,611.32	5.77
J	金融业	7,134,534.45	13.36
K	房地产业	176,375.96	0.33
L	租赁和商务服务业	310,741.40	0.58
M	科学研究和技术服务业	495,604.78	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	50,376.76	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	82,761.18	0.15
R	文化、体育和娱乐业	89,497.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	50,769,163.42	95.08

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	300308	中际旭创	1,380	1,752,600.00	3.28
2	300750	宁德时代	3,360	1,320,513.60	2.47
3	300502	新易盛	1,732	1,051,324.00	1.97
4	600519	贵州茅台	800	948,392.00	1.78
5	688256	寒武纪	498	794,583.90	1.49
6	603986	兆易创新	852	694,380.00	1.30
7	601318	中国平安	13,545	646,638.30	1.21
8	600036	招商银行	15,700	557,350.00	1.04
9	601899	紫金矿业	20,900	525,426.00	0.98
10	002371	北方华创	575	508,622.00	0.95
11	000333	美的集团	6,186	467,228.58	0.87
12	002475	立讯精密	6,482	456,332.80	0.85
13	688008	澜起科技	1,393	431,690.70	0.81
14	002384	东山精密	1,600	419,760.00	0.79
15	688012	中微公司	890	416,965.00	0.78
16	600900	长江电力	15,500	410,285.00	0.77
17	688041	海光信息	1,100	407,330.00	0.76
18	000725	京东方 A	46,100	400,148.00	0.75
19	688981	中芯国际	2,498	396,732.36	0.74
20	603259	药明康德	3,128	389,467.28	0.73
21	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.71
22	601138	工业富联	5,000	360,750.00	0.68

23	601166	兴业银行	21,500	356,040.00	0.67
24	600030	中信证券	12,360	355,102.80	0.67
25	300059	东方财富	16,077	327,649.26	0.61
26	600183	生益科技	1,865	323,391.00	0.61
27	600276	恒瑞医药	5,715	297,408.60	0.56
28	601398	工商银行	41,000	289,870.00	0.54
29	300274	阳光电源	1,816	288,780.32	0.54
30	300408	三环集团	1,700	283,730.00	0.53
31	002594	比亚迪	3,500	278,950.00	0.52
32	300476	胜宏科技	800	277,144.00	0.52
33	601211	国泰海通	14,474	263,426.80	0.49
34	002463	沪电股份	1,700	259,760.00	0.49
35	300394	天孚通信	796	240,933.28	0.45
36	000988	华工科技	1,300	239,993.00	0.45
37	600176	中国巨石	3,101	226,000.88	0.42
38	601288	农业银行	36,900	223,983.00	0.42
39	688521	芯原股份	600	222,684.00	0.42
40	601328	交通银行	34,300	220,549.00	0.41
41	000651	格力电器	5,800	217,500.00	0.41
42	600522	中天科技	3,500	212,380.00	0.40
43	301308	江波龙	300	211,140.00	0.40
44	300604	长川科技	600	204,852.00	0.38
45	603019	中科曙光	1,900	203,737.00	0.38
46	600919	江苏银行	18,850	203,203.00	0.38
47	688347	华虹宏力	600	201,780.00	0.38
48	603993	洛阳钼业	11,200	196,560.00	0.37
49	600150	中国船舶	5,799	195,948.21	0.37
50	600887	伊利股份	8,100	194,076.00	0.36
51	001309	德明利	200	188,580.00	0.35
52	000338	潍柴动力	6,900	188,025.00	0.35
53	600584	长电科技	1,800	186,390.00	0.35

54	000858	五 粮 液	2,497	184,778.00	0.35
55	688120	华海清科	560	180,420.80	0.34
56	688072	拓荆科技	200	175,906.00	0.33
57	688361	中科飞测	400	172,000.00	0.32
58	601816	京沪高铁	37,700	170,781.00	0.32
59	002916	深南电路	357	163,470.30	0.31
60	600309	万华化学	2,380	162,815.80	0.30
61	002415	海康威视	4,675	159,885.00	0.30
62	300124	汇川技术	2,400	159,192.00	0.30
63	000100	TCL科技	26,760	155,743.20	0.29
64	601688	华泰证券	7,501	154,670.62	0.29
65	002281	光迅科技	600	154,164.00	0.29
66	600111	北方稀土	3,200	153,760.00	0.29
67	002008	大族激光	1,000	150,110.00	0.28
68	000063	中兴通讯	4,100	148,379.00	0.28
69	600000	浦发银行	17,100	147,231.00	0.28
70	600089	特变电工	6,450	145,125.00	0.27
71	601857	中国石油	16,600	144,088.00	0.27
72	300136	信维通信	1,200	143,100.00	0.27
73	300857	协创数据	420	142,758.00	0.27
74	002028	思源电气	800	138,400.00	0.26
75	601088	中国神华	3,500	136,640.00	0.26
76	300433	蓝思科技	2,500	134,150.00	0.25
77	600031	三一重工	7,600	131,328.00	0.25
78	300014	亿纬锂能	1,945	126,483.35	0.24
79	000001	平安银行	12,500	125,625.00	0.24
80	002142	宁波银行	4,225	125,440.25	0.23
81	300223	北京君正	500	124,450.00	0.23
82	601601	中国太保	4,350	124,062.00	0.23
83	000792	盐湖股份	4,100	123,779.00	0.23
84	002050	三花智控	2,813	123,293.79	0.23

85	002714	牧原股份	3,500	122,465.00	0.23
86	002353	杰瑞股份	800	122,000.00	0.23
87	600549	厦门钨业	1,430	121,836.00	0.23
88	300475	香农芯创	400	120,000.00	0.22
89	600406	XD国电南	5,136	117,357.60	0.22
90	601668	中国建筑	26,580	115,357.20	0.22
91	000657	中钨高新	1,200	114,864.00	0.22
92	002436	兴森科技	2,200	112,090.00	0.21
93	601229	上海银行	12,770	110,843.60	0.21
94	300666	江丰电子	300	110,580.00	0.21
95	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.20
96	300760	迈瑞医疗	800	108,664.00	0.20
97	601919	中远海控	8,100	107,406.00	0.20
98	002602	世纪华通	7,600	107,160.00	0.20
99	300054	鼎龙股份	1,000	105,970.00	0.20
100	601988	中国银行	18,400	105,248.00	0.20
101	688200	华峰测控	200	105,020.00	0.20
102	601939	建设银行	10,900	104,967.00	0.20
103	603501	豪威集团	1,100	104,335.00	0.20
104	601728	中国电信	20,000	103,800.00	0.19
105	300285	国瓷材料	1,000	103,180.00	0.19
106	600016	民生银行	31,940	102,846.80	0.19
107	601012	隆基绿能	7,837	102,821.44	0.19
108	601225	陕西煤业	5,000	101,750.00	0.19
109	600105	永鼎股份	1,500	101,220.00	0.19
109	300033	同花顺	420	101,220.00	0.19
110	600660	福耀玻璃	2,000	100,880.00	0.19
111	600999	招商证券	4,740	100,014.00	0.19
112	002230	科大讯飞	2,400	98,016.00	0.18
113	600690	海尔智家	4,800	97,968.00	0.18
114	002352	顺丰控股	3,100	96,906.00	0.18

115	601985	中国核电	10,600	95,718.00	0.18
116	002938	鹏鼎控股	900	94,842.00	0.18
117	600941	中国移动	1,100	94,743.00	0.18
118	002460	赣锋锂业	1,441	94,241.40	0.18
119	600926	杭州银行	6,520	94,214.00	0.18
120	688777	中控技术	800	94,000.00	0.18
121	601169	北京银行	19,000	93,100.00	0.17
122	002709	天赐材料	1,808	92,985.44	0.17
123	603799	华友钴业	1,900	91,694.00	0.17
124	000977	浪潮信息	1,300	91,000.00	0.17
125	600160	巨化股份	1,700	90,117.00	0.17
126	000021	深科技	1,400	89,978.00	0.17
127	002409	雅克科技	400	89,800.00	0.17
128	000776	广发证券	3,800	88,920.00	0.17
129	688019	安集科技	260	88,259.60	0.17
130	688037	芯源微	200	87,810.00	0.16
131	688126	沪硅产业	2,200	87,758.00	0.16
132	688082	盛美上海	200	86,400.00	0.16
133	000425	徐工机械	10,500	84,945.00	0.16
134	002202	金风科技	3,551	84,868.90	0.16
135	000938	紫光股份	2,923	84,357.78	0.16
136	600938	中国海油	3,100	84,165.00	0.16
137	601600	中国铝业	10,200	83,844.00	0.16
138	300498	温氏股份	6,800	83,776.00	0.16
139	002851	麦格米特	500	83,590.00	0.16
140	688017	绿的谐波	200	83,572.00	0.16
141	600028	中国石化	18,700	83,402.00	0.16
142	300548	长芯博创	300	83,400.00	0.16
143	300346	南大光电	900	83,385.00	0.16
144	300442	润泽科技	1,000	83,070.00	0.16
145	600460	士兰微	1,500	81,990.00	0.15

146	002600	领益智造	4,700	81,498.00	0.15
147	601766	中国中车	15,600	81,120.00	0.15
148	600050	中国联通	20,100	80,400.00	0.15
149	002049	紫光国微	900	79,875.00	0.15
150	002466	天齐锂业	1,300	79,716.00	0.15
151	601009	南京银行	7,900	78,131.00	0.15
152	688702	盛科通信	200	77,998.00	0.15
153	002185	华天科技	3,400	75,854.00	0.14
154	300620	光库科技	200	75,640.00	0.14
155	002407	多氟多	1,500	75,345.00	0.14
156	002837	英维克	940	74,786.40	0.14
157	600498	烽火通信	1,012	74,483.20	0.14
158	601628	中国人寿	2,100	74,235.00	0.14
159	300661	圣邦股份	515	73,892.20	0.14
160	688313	仕佳光子	400	73,860.00	0.14
161	002179	中航光电	1,588	73,365.60	0.14
162	002138	顺络电子	1,000	73,100.00	0.14
163	600879	航天电子	3,400	72,386.00	0.14
164	002241	歌尔股份	3,202	72,141.06	0.14
165	601872	招商轮船	4,100	72,037.00	0.13
166	601006	大秦铁路	15,300	70,533.00	0.13
167	601658	邮储银行	14,200	70,006.00	0.13
168	000568	泸州老窖	900	69,768.00	0.13
169	603288	海天味业	2,097	69,536.52	0.13
170	000408	藏格矿业	1,000	69,320.00	0.13
171	601100	恒立液压	644	69,268.64	0.13
172	605117	德业股份	652	69,229.36	0.13
173	300390	天华新能	740	69,197.40	0.13
174	601818	光大银行	23,900	69,071.00	0.13
175	600905	三峡能源	18,400	68,264.00	0.13
176	688469	芯联集成	6,400	67,904.00	0.13

177	688172	燕东微	800	66,928.00	0.13
178	300395	菲利华	500	66,865.00	0.13
179	600489	中金黄金	3,700	66,785.00	0.13
180	000630	铜陵有色	10,500	66,780.00	0.13
181	002625	光启技术	2,200	66,704.00	0.12
182	601336	新华保险	1,101	65,685.66	0.12
183	600118	中国卫星	800	65,640.00	0.12
184	301526	国际复材	1,400	65,338.00	0.12
185	600893	航发动力	1,700	65,178.00	0.12
186	600010	包钢股份	29,100	64,893.00	0.12
187	002273	水晶光电	1,818	64,502.64	0.12
188	601888	中国中免	1,200	64,452.00	0.12
189	300567	精测电子	200	63,520.00	0.12
190	600809	山西汾酒	580	63,434.60	0.12
191	300058	蓝色光标	4,600	63,296.00	0.12
192	300037	新宙邦	680	63,138.00	0.12
193	600958	东方证券	6,684	63,096.96	0.12
194	300373	扬杰科技	400	62,892.00	0.12
195	002027	分众传媒	12,960	62,726.40	0.12
196	605358	立昂微	800	62,080.00	0.12
197	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.12
198	688002	睿创微纳	400	61,876.00	0.12
199	601689	拓普集团	1,095	61,779.90	0.12
200	688099	晶晨股份	600	61,740.00	0.12
201	601127	赛力斯	1,000	61,250.00	0.11
202	688271	联影医疗	601	60,839.23	0.11
203	600019	宝钢股份	11,192	60,772.56	0.11
204	000807	云铝股份	2,700	59,778.00	0.11
205	688506	百利天恒	200	58,806.00	0.11
206	688396	华润微	600	58,530.00	0.11
207	600760	中航沈飞	1,424	58,526.40	0.11

208	601838	成都银行	3,300	58,410.00	0.11
209	688411	海博思创	200	58,240.00	0.11
210	300450	先导智能	1,420	57,822.40	0.11
211	688052	纳芯微	200	57,662.00	0.11
212	600104	上汽集团	5,900	57,584.00	0.11
213	600875	东方电气	2,000	57,540.00	0.11
214	605589	圣泉集团	900	57,213.00	0.11
215	600989	宝丰能源	2,800	56,924.00	0.11
216	601727	上海电气	8,100	56,700.00	0.11
217	603893	瑞芯微	300	56,508.00	0.11
218	300751	迈为股份	200	56,492.00	0.11
219	600362	江西铜业	1,300	56,290.00	0.11
220	000960	锡业股份	1,300	55,497.00	0.10
221	601825	沪农商行	7,400	55,426.00	0.10
222	600988	赤峰黄金	2,100	55,272.00	0.10
223	002001	新 和 成	1,944	55,248.48	0.10
224	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.10
225	601390	中国中铁	13,200	55,044.00	0.10
226	600885	宏发股份	1,594	54,977.06	0.10
227	002126	银轮股份	1,100	54,780.00	0.10
228	002738	中矿资源	920	54,270.80	0.10
229	601995	中金公司	1,500	54,225.00	0.10
230	002422	科伦药业	1,400	53,928.00	0.10
231	600392	盛和资源	1,810	53,883.70	0.10
232	600795	国电电力	11,500	53,705.00	0.10
233	600547	山东黄金	2,316	53,476.44	0.10
234	601377	兴业证券	8,850	53,454.00	0.10
235	603256	宏和科技	200	53,066.00	0.10
236	688183	生益电子	400	52,960.00	0.10
237	600378	昊华科技	700	52,766.00	0.10
238	600601	方正科技	3,800	52,592.00	0.10

239	600585	海螺水泥	3,101	52,561.95	0.10
240	600015	华夏银行	8,200	52,398.00	0.10
241	000538	云南白药	1,103	52,249.11	0.10
242	601669	中国电建	11,100	52,170.00	0.10
243	603296	华勤技术	700	51,989.00	0.10
244	002648	卫星化学	2,180	51,208.20	0.10
245	000166	申万宏源	11,620	51,128.00	0.10
246	601916	浙商银行	19,400	51,022.00	0.10
247	688235	百济神州	200	50,922.00	0.10
248	600141	兴发集团	1,080	50,727.60	0.09
249	000831	中国稀土	900	49,941.00	0.09
250	688220	翱捷科技	400	49,728.00	0.09
251	601066	中信建投	1,700	49,419.00	0.09
252	300570	太辰光	200	49,342.00	0.09
253	601179	中国西电	3,300	49,236.00	0.09
254	600482	中国动力	1,500	49,200.00	0.09
255	300015	爱尔眼科	5,943	49,089.18	0.09
256	601698	中国卫通	1,600	48,400.00	0.09
257	300316	晶盛机电	800	48,320.00	0.09
258	600346	恒力石化	2,720	48,171.20	0.09
259	601868	中国能建	17,999	48,057.33	0.09
260	002195	岩山科技	7,279	47,604.66	0.09
261	001389	广合科技	200	47,450.00	0.09
262	600497	驰宏锌锗	3,900	47,229.00	0.09
263	601998	中信银行	6,800	47,124.00	0.09
264	002558	巨人网络	1,700	46,852.00	0.09
265	002812	恩捷股份	700	46,837.00	0.09
266	605499	东鹏饮料	377	46,533.11	0.09
267	300803	指南针	500	45,835.00	0.09
268	000625	长安汽车	6,368	45,658.56	0.09
269	600066	宇通客车	1,700	45,577.00	0.09

270	301358	湖南裕能	600	45,522.00	0.09
271	600426	华鲁恒升	1,890	45,208.80	0.08
272	600157	永泰能源	28,000	45,080.00	0.08
273	002532	天山铝业	4,200	45,066.00	0.08
274	002261	拓维信息	1,600	44,816.00	0.08
275	002311	海大集团	1,000	44,610.00	0.08
276	000157	中联重科	6,400	44,608.00	0.08
277	600221	海航控股	33,000	44,550.00	0.08
278	300418	昆仑万维	1,100	44,396.00	0.08
279	600711	盛屯矿业	4,000	43,880.00	0.08
280	600436	片仔癀	400	43,712.00	0.08
281	688578	艾力斯	400	43,680.00	0.08
282	002340	格林美	6,600	43,626.00	0.08
283	600011	华能国际	5,700	43,263.00	0.08
284	600909	华安证券	3,890	43,217.90	0.08
285	688213	思特威	400	42,828.00	0.08
286	688111	金山办公	200	42,610.00	0.08
287	600048	XD保利发	9,200	42,596.00	0.08
288	600438	通威股份	3,500	42,385.00	0.08
289	600570	恒生电子	1,986	42,083.34	0.08
290	002236	大华股份	2,550	42,049.50	0.08
291	002493	荣盛石化	3,900	41,925.00	0.08
291	000783	长江证券	4,300	41,925.00	0.08
292	600143	金发科技	2,700	41,715.00	0.08
293	300017	网宿科技	3,200	41,632.00	0.08
294	601077	渝农商行	6,800	41,548.00	0.08
295	600115	中国东航	10,900	41,529.00	0.08
296	002131	利欧股份	8,700	41,325.00	0.08
297	600886	国投电力	3,100	41,261.00	0.08
298	002203	海亮股份	1,800	41,130.00	0.08
299	600188	兖矿能源	2,300	40,871.00	0.08

300	601555	东吴证券	5,147	40,764.24	0.08
301	600352	浙江龙盛	3,300	39,963.00	0.07
302	002966	苏州银行	5,720	39,811.20	0.07
303	603659	璞泰来	1,375	39,778.75	0.07
304	003816	中国广核	10,100	39,491.00	0.07
305	601058	赛轮轮胎	3,400	39,202.00	0.07
306	601360	三六零	4,500	39,105.00	0.07
307	300759	康龙化成	1,350	39,055.50	0.07
308	601233	桐昆股份	1,800	38,970.00	0.07
309	002736	国信证券	3,900	38,961.00	0.07
310	000301	东方盛虹	3,400	38,930.00	0.07
311	002074	国轩高科	1,400	38,514.00	0.07
312	300339	润和软件	1,000	38,510.00	0.07
313	601901	方正证券	5,300	38,160.00	0.07
313	600563	法拉电子	200	38,160.00	0.07
314	002850	科达利	200	37,860.00	0.07
315	688036	传音控股	640	37,728.00	0.07
316	688122	西部超导	600	37,686.00	0.07
317	600026	中远海能	2,100	37,674.00	0.07
318	688629	华丰科技	200	37,502.00	0.07
319	002472	双环传动	900	37,359.00	0.07
320	600009	上海机场	1,600	36,960.00	0.07
321	000768	中航西飞	1,800	36,864.00	0.07
322	601108	财通证券	4,200	36,330.00	0.07
323	688617	惠泰医疗	200	36,312.00	0.07
324	601111	中国国航	6,000	36,300.00	0.07
325	603308	应流股份	600	36,240.00	0.07
326	300207	欣旺达	1,900	36,081.00	0.07
327	601788	光大证券	2,500	36,075.00	0.07
328	301200	大族数控	100	36,065.00	0.07
329	003031	中瓷电子	200	36,060.00	0.07

330	301611	珂玛科技	200	36,014.00	0.07
331	600196	复星医药	1,600	35,952.00	0.07
332	603444	吉比特	100	35,842.00	0.07
333	301269	华大九天	300	35,826.00	0.07
334	002517	恺英网络	2,200	35,750.00	0.07
335	600029	南方航空	6,900	35,742.00	0.07
336	688387	信科移动	1,800	35,712.00	0.07
337	000975	山金国际	2,100	35,700.00	0.07
338	002821	凯莱英	220	35,640.00	0.07
339	600415	小商品城	3,500	35,560.00	0.07
340	002797	第一创业	5,400	35,478.00	0.07
341	600674	川投能源	2,500	35,425.00	0.07
342	601456	国联民生	4,000	35,360.00	0.07
343	601881	中国银河	2,800	35,196.00	0.07
344	600219	南山铝业	8,800	35,112.00	0.07
345	601186	中国铁建	5,900	35,105.00	0.07
346	601877	正泰电器	1,400	35,098.00	0.07
347	688301	奕瑞科技	280	34,720.00	0.07
348	688234	天岳先进	200	34,702.00	0.06
349	600233	圆通速递	2,200	34,650.00	0.06
350	002155	湖南黄金	1,450	34,611.50	0.06
351	002601	龙佰集团	2,100	34,608.00	0.06
352	601117	中国化学	4,700	34,545.00	0.06
353	300001	特锐德	900	34,047.00	0.06
354	601991	大唐发电	4,800	33,984.00	0.06
355	601198	东兴证券	2,500	33,975.00	0.06
356	301236	软通动力	800	33,960.00	0.06
357	300458	全志科技	860	33,935.60	0.06
358	688676	金盘科技	400	33,856.00	0.06
359	601958	金钼股份	1,200	33,732.00	0.06
360	600372	中航机载	3,100	33,635.00	0.06

361	300115	长盈精密	1,200	33,528.00	0.06
362	688608	恒玄科技	200	33,438.00	0.06
363	601878	浙商证券	3,500	33,250.00	0.06
364	002465	海格通信	2,600	33,202.00	0.06
365	000703	恒逸石化	2,438	33,083.66	0.06
366	688343	云天励飞	400	32,664.00	0.06
367	002920	德赛西威	400	32,600.00	0.06
368	603156	养元饮品	664	32,582.48	0.06
369	000963	华东医药	1,147	32,253.64	0.06
370	601665	齐鲁银行	5,500	31,735.00	0.06
371	300866	安克创新	300	31,350.00	0.06
372	600884	杉杉股份	2,300	31,165.00	0.06
373	600741	华域汽车	2,000	31,040.00	0.06
374	002402	和而泰	1,200	30,996.00	0.06
375	688047	龙芯中科	200	30,934.00	0.06
376	300496	中科创达	500	30,895.00	0.06
377	601162	天风证券	9,100	30,667.00	0.06
378	603290	斯达半导	200	30,588.00	0.06
379	300024	机器人	1,580	30,541.40	0.06
380	689009	九号公司	800	30,520.00	0.06
380	002304	洋河股份	800	30,520.00	0.06
381	300012	华测检测	2,200	30,492.00	0.06
382	002056	横店东磁	1,000	30,480.00	0.06
383	600707	彩虹股份	1,800	30,402.00	0.06
384	002130	沃尔核材	1,600	30,336.00	0.06
385	000060	中金岭南	4,000	30,280.00	0.06
386	000878	云南铜业	1,900	30,172.00	0.06
387	002429	兆驰股份	2,900	30,131.00	0.06
388	688188	柏楚电子	280	29,876.00	0.06
389	603179	新泉股份	600	29,790.00	0.06
390	002414	高德红外	2,244	29,755.44	0.06

391	002271	东方雨虹	2,500	29,675.00	0.06
392	601099	太平洋	8,800	29,656.00	0.06
393	001979	招商蛇口	4,600	29,578.00	0.06
394	603979	金诚信	500	29,515.00	0.06
395	688728	格科微	1,400	29,456.00	0.06
396	603650	彤程新材	300	29,394.00	0.06
397	601898	中煤能源	2,400	29,232.00	0.05
398	000895	双汇发展	1,300	29,120.00	0.05
399	002487	大金重工	500	28,985.00	0.05
400	600109	国金证券	3,300	28,974.00	0.05
401	600298	安琪酵母	800	28,960.00	0.05
402	300454	深信服	300	28,860.00	0.05
403	300073	当升科技	600	28,824.00	0.05
404	600256	广汇能源	5,800	28,652.00	0.05
405	000893	亚钾国际	700	28,623.00	0.05
406	688385	复旦微电	400	28,516.00	0.05
407	603087	甘李药业	500	28,380.00	0.05
408	002756	永兴材料	500	28,320.00	0.05
408	000733	振华科技	500	28,320.00	0.05
409	000034	神州数码	1,020	28,305.00	0.05
410	002432	九安医疗	400	28,272.00	0.05
411	300724	捷佳伟创	400	28,240.00	0.05
412	600699	均胜电子	1,300	28,093.00	0.05
413	002444	巨星科技	900	27,990.00	0.05
414	600060	海信视像	1,000	27,870.00	0.05
415	300748	金力永磁	900	27,765.00	0.05
416	601319	中国人保	4,100	27,716.00	0.05
417	002078	太阳纸业	2,200	27,478.00	0.05
418	688187	时代电气	400	27,464.00	0.05
419	600023	浙能电力	5,200	27,352.00	0.05
420	601021	春秋航空	600	27,348.00	0.05

421	603379	三美股份	360	27,320.40	0.05
422	300142	沃森生物	2,100	27,279.00	0.05
423	300474	景嘉微	450	27,216.00	0.05
423	000423	东阿阿胶	600	27,216.00	0.05
424	600021	上海电力	1,800	27,126.00	0.05
425	300763	锦浪科技	300	27,105.00	0.05
426	601577	长沙银行	3,100	27,001.00	0.05
427	300623	捷捷微电	600	26,994.00	0.05
428	601128	常熟银行	4,638	26,993.16	0.05
429	300953	震裕科技	200	26,740.00	0.05
430	002157	正邦科技	9,500	26,695.00	0.05
431	000661	长春高新	400	26,640.00	0.05
432	601615	明阳智能	2,300	26,611.00	0.05
433	688169	石头科技	280	26,591.60	0.05
434	601696	中银证券	2,100	26,565.00	0.05
435	603119	浙江荣泰	400	26,536.00	0.05
436	002335	科华数据	625	26,531.25	0.05
437	600039	四川路桥	3,380	26,431.60	0.05
438	601800	中国交建	4,600	26,266.00	0.05
439	300919	中伟新材	600	26,250.00	0.05
440	300432	富临精工	1,300	26,117.00	0.05
441	600600	青岛啤酒	500	26,115.00	0.05
442	688322	奥比中光	200	26,110.00	0.05
443	688331	荣昌生物	200	26,052.00	0.05
444	000002	万 科 A	8,701	25,754.96	0.05
445	301536	星宸科技	200	25,742.00	0.05
446	603606	东方电缆	620	25,736.20	0.05
447	002252	上海莱士	5,900	25,606.00	0.05
448	603129	春风动力	100	25,580.00	0.05
449	000728	国元证券	3,400	25,466.00	0.05
450	688599	天合光能	1,800	25,416.00	0.05

451	688223	晶科能源	5,331	25,322.25	0.05
452	002831	裕同科技	701	24,927.56	0.05
453	688568	XD中科星	600	24,882.00	0.05
454	603688	石英股份	300	24,783.00	0.05
455	603160	汇顶科技	400	24,684.00	0.05
456	002064	华峰化学	2,600	24,674.00	0.05
457	600588	用友网络	2,661	24,427.98	0.05
458	601633	长城汽车	1,600	24,144.00	0.05
459	603260	合盛硅业	500	24,130.00	0.05
460	603345	安井食品	300	24,057.00	0.05
461	603920	世运电路	500	24,020.00	0.04
462	300679	电连技术	400	23,996.00	0.04
463	001203	大中矿业	800	23,960.00	0.04
464	001965	招商公路	2,600	23,816.00	0.04
465	603369	今世缘	1,000	23,710.00	0.04
466	000786	北新建材	1,300	23,517.00	0.04
467	688266	泽璟制药	200	23,332.00	0.04
468	302132	中航成飞	400	23,328.00	0.04
469	000519	中兵红箭	1,100	23,177.00	0.04
470	603806	福斯特	1,375	23,086.25	0.04
471	002025	航天电器	300	22,866.00	0.04
472	600027	华电国际	5,100	22,695.00	0.04
473	688615	合合信息	200	22,620.00	0.04
474	600177	雅戈尔	3,000	22,590.00	0.04
475	601618	中国中冶	9,200	22,448.00	0.04
476	600516	方大炭素	3,633	22,415.61	0.04
477	688065	凯赛生物	468	22,393.80	0.04
478	300383	光环新网	1,800	22,392.00	0.04
479	600171	上海贝岭	700	22,358.00	0.04
480	300628	亿联网络	660	22,321.20	0.04
481	002673	西部证券	3,400	22,066.00	0.04

482	000623	吉林敖东	1,243	22,038.39	0.04
483	000559	万向钱潮	1,700	21,981.00	0.04
484	300677	英科医疗	560	21,935.20	0.04
485	600642	申能股份	2,500	21,825.00	0.04
486	600918	中泰证券	4,100	21,812.00	0.04
487	000617	中油资本	3,300	21,747.00	0.04
488	002624	完美世界	1,750	21,735.00	0.04
489	603225	新凤鸣	1,100	21,615.00	0.04
489	600061	国投资本	3,300	21,615.00	0.04
490	600637	东方明珠	2,590	21,522.90	0.04
491	002318	久立特材	900	21,510.00	0.04
492	601699	XD潞安环	1,500	21,420.00	0.04
493	601607	上海医药	1,390	21,406.00	0.04
494	600025	华能水电	2,400	21,336.00	0.04
495	002739	儒意电影	2,200	21,120.00	0.04
496	300251	光线传媒	1,900	21,071.00	0.04
496	002085	万丰奥威	1,900	21,071.00	0.04
497	603596	伯特利	847	21,039.48	0.04
498	300832	新产业	500	21,000.00	0.04
499	000750	国海证券	5,700	20,976.00	0.04
500	000983	山西焦煤	3,600	20,880.00	0.04
501	688375	国博电子	200	20,860.00	0.04
502	001696	宗申动力	1,000	20,810.00	0.04
503	600085	同仁堂	900	20,799.00	0.04
504	002065	东华软件	2,900	20,706.00	0.04
505	600499	科达制造	1,500	20,700.00	0.04
506	300699	光威复材	720	20,628.00	0.04
507	600100	同方股份	3,000	20,550.00	0.04
508	600930	华电新能	4,300	20,511.00	0.04
509	600369	西南证券	5,100	20,502.00	0.04
510	688114	华大智造	400	20,432.00	0.04

511	000155	川能动力	1,700	20,366.00	0.04
512	688180	君实生物	600	20,292.00	0.04
513	002266	浙富控股	4,000	20,240.00	0.04
514	600595	中孚实业	3,600	20,232.00	0.04
515	300003	乐普医疗	1,700	20,145.00	0.04
516	603699	纽威股份	400	20,120.00	0.04
516	002044	美年健康	4,000	20,120.00	0.04
517	000629	钒钛股份	6,000	20,040.00	0.04
518	600515	海南机场	7,300	20,002.00	0.04
519	688318	财富趋势	280	19,966.80	0.04
520	000032	深桑达 A	800	19,960.00	0.04
521	300627	华测导航	700	19,880.00	0.04
522	000999	华润三九	883	19,858.67	0.04
523	600862	中航高科	1,100	19,833.00	0.04
524	601016	节能风电	5,080	19,710.40	0.04
525	600536	中国软件	700	19,684.00	0.04
526	600985	淮北矿业	1,400	19,670.00	0.04
527	688772	珠海冠宇	1,000	19,630.00	0.04
528	000415	渤海租赁	4,800	19,536.00	0.04
529	000400	许继电气	900	19,530.00	0.04
530	300002	神州泰岳	2,500	19,525.00	0.04
531	300558	贝达药业	300	19,521.00	0.04
532	688472	阿特斯	1,800	19,476.00	0.04
533	601717	中创智领	1,400	19,474.00	0.04
534	601059	信达证券	1,200	19,428.00	0.04
535	601212	白银有色	3,800	19,304.00	0.04
536	601997	贵阳银行	3,760	19,288.80	0.04
537	002223	鱼跃医疗	750	19,245.00	0.04
538	000039	中集集团	2,370	19,220.70	0.04
539	601216	君正集团	4,300	19,178.00	0.04
540	601001	晋控煤业	1,100	19,129.00	0.04

541	603766	隆鑫通用	1,600	19,088.00	0.04
542	000683	博源化工	3,300	19,008.00	0.04
543	600803	新奥股份	1,200	18,960.00	0.04
544	600704	物产中大	4,000	18,880.00	0.04
545	000050	深天马 A	1,900	18,829.00	0.04
546	600863	华能蒙电	4,000	18,800.00	0.04
547	600521	华海药业	1,300	18,720.00	0.04
548	300999	金龙鱼	800	18,608.00	0.03
549	002430	杭氧股份	600	18,576.00	0.03
550	688538	和辉光电	7,113	18,493.80	0.03
551	600845	宝信软件	1,108	18,426.04	0.03
552	600018	上港集团	3,900	18,408.00	0.03
553	601990	南京证券	2,800	18,396.00	0.03
554	600873	梅花生物	2,500	18,375.00	0.03
555	603077	和邦生物	7,900	18,328.00	0.03
556	603728	鸣志电器	300	18,276.00	0.03
557	000729	燕京啤酒	1,800	18,234.00	0.03
558	601799	星宇股份	200	18,124.00	0.03
559	600332	白云山	900	18,036.00	0.03
560	000830	鲁西化工	1,500	18,000.00	0.03
561	603605	珀莱雅	300	17,976.00	0.03
562	000967	盈峰环境	1,700	17,901.00	0.03
563	600363	联创光电	500	17,890.00	0.03
563	000887	中鼎股份	1,000	17,890.00	0.03
564	600765	中航重机	1,380	17,829.60	0.03
565	600166	福田汽车	6,100	17,751.00	0.03
566	002007	华兰生物	1,455	17,736.45	0.03
567	600312	平高电气	1,000	17,660.00	0.03
568	300487	蓝晓科技	300	17,655.00	0.03
569	600348	华阳股份	2,300	17,595.00	0.03
570	002683	广东宏大	600	17,574.00	0.03

571	300122	智飞生物	1,500	17,535.00	0.03
572	002939	长城证券	2,100	17,514.00	0.03
573	002410	广联达	2,140	17,462.40	0.03
574	600153	建发股份	2,200	17,446.00	0.03
575	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.03
576	002841	视源股份	500	17,265.00	0.03
577	600737	中粮糖业	1,400	17,262.00	0.03
578	603341	龙旗科技	400	16,996.00	0.03
579	603568	伟明环保	1,102	16,948.76	0.03
580	600901	江苏金租	2,940	16,905.00	0.03
581	600578	京能电力	2,600	16,770.00	0.03
582	600316	洪都航空	600	16,764.00	0.03
583	601611	中国核建	1,500	16,725.00	0.03
584	603298	杭叉集团	700	16,702.00	0.03
585	688297	中无人机	400	16,620.00	0.03
586	002603	以岭药业	1,100	16,500.00	0.03
587	000708	中信特钢	1,300	16,406.00	0.03
588	000921	海信家电	600	16,392.00	0.03
589	002926	华西证券	2,000	16,340.00	0.03
590	600486	扬农化工	320	16,224.00	0.03
591	600398	海澜之家	3,100	16,213.00	0.03
592	000591	太阳能	3,500	16,100.00	0.03
593	301165	锐捷网络	200	16,090.00	0.03
594	000596	古井贡酒	201	16,039.80	0.03
595	000062	深圳华强	500	15,910.00	0.03
596	000737	北方铜业	1,200	15,864.00	0.03
597	000528	柳工	2,100	15,855.00	0.03
598	601018	宁波港	5,000	15,750.00	0.03
599	688009	中国通号	3,300	15,708.00	0.03
600	300896	爱美客	180	15,696.00	0.03
601	600435	北方导航	1,400	15,680.00	0.03

602	601000	唐山港	3,778	15,678.70	0.03
603	000951	中国重汽	800	15,608.00	0.03
604	600208	衢州发展	5,500	15,565.00	0.03
605	600008	首创环保	5,700	15,504.00	0.03
606	688336	三生国健	290	15,399.00	0.03
607	600170	上海建工	6,900	15,318.00	0.03
608	600998	九州通	3,250	15,242.50	0.03
609	000932	华菱钢铁	4,380	15,198.60	0.03
610	000987	越秀资本	1,935	15,131.70	0.03
611	002152	广电运通	1,600	15,008.00	0.03
612	002262	恩华药业	800	15,000.00	0.03
613	600329	达仁堂	400	14,888.00	0.03
614	600161	天坛生物	1,282	14,845.56	0.03
615	600995	南网储能	1,200	14,760.00	0.03
616	600282	南钢股份	3,200	14,688.00	0.03
617	000997	新大陆	900	14,670.00	0.03
618	000738	航发控制	800	14,632.00	0.03
619	600820	隧道股份	2,801	14,593.21	0.03
620	601106	中国一重	4,400	14,520.00	0.03
621	000009	中国宝安	2,320	14,453.60	0.03
622	603885	吉祥航空	1,400	14,406.00	0.03
623	688363	华熙生物	400	14,308.00	0.03
624	600483	福能股份	1,400	14,266.00	0.03
625	601238	广汽集团	2,800	14,224.00	0.03
626	603486	科沃斯	280	14,210.00	0.03
627	600546	山煤国际	1,300	14,209.00	0.03
628	300413	芒果超媒	970	14,191.10	0.03
629	002500	山西证券	2,730	14,086.80	0.03
630	600583	海油工程	2,800	14,084.00	0.03
631	688281	华秦科技	280	14,064.40	0.03
632	300676	华大基因	400	14,024.00	0.03

633	688166	博瑞医药	400	14,004.00	0.03
634	603939	益丰药房	778	13,988.44	0.03
635	000582	北部湾港	1,300	13,949.00	0.03
636	688303	大全能源	800	13,944.00	0.03
637	688248	南网科技	200	13,836.00	0.03
638	002312	川发龙蟒	1,500	13,755.00	0.03
639	601666	XD平煤股	1,900	13,585.00	0.03
640	600763	通策医疗	400	13,552.00	0.03
641	601567	三星电气	900	13,446.00	0.03
642	603816	顾家家居	600	13,416.00	0.03
643	000723	美锦能源	4,000	13,400.00	0.03
644	001280	中国铀业	200	13,340.00	0.02
645	000513	丽珠集团	461	13,318.29	0.02
646	600535	天士力	1,000	13,230.00	0.02
647	600380	健康元	1,404	13,225.68	0.02
648	600390	五矿资本	2,900	13,224.00	0.02
649	603392	万泰生物	487	13,134.39	0.02
650	601880	辽港股份	9,500	13,110.00	0.02
651	600511	国药股份	500	13,020.00	0.02
652	688582	芯动联科	200	13,000.00	0.02
653	601399	国机重装	3,700	12,950.00	0.02
653	003022	联泓新科	500	12,950.00	0.02
654	600977	中国电影	1,000	12,920.00	0.02
655	601156	东航物流	800	12,896.00	0.02
656	600602	云赛智联	800	12,864.00	0.02
657	603565	中谷物流	1,300	12,753.00	0.02
658	603338	浙江鼎力	300	12,750.00	0.02
659	600562	国睿科技	600	12,732.00	0.02
660	600685	中船防务	500	12,720.00	0.02
661	600906	财达证券	1,700	12,682.00	0.02
662	600038	中直股份	500	12,645.00	0.02

663	601865	福莱特	1,200	12,612.00	0.02
664	600816	建元信托	5,100	12,444.00	0.02
665	600132	重庆啤酒	300	12,390.00	0.02
666	601155	新城控股	1,200	12,312.00	0.02
667	601236	红塔证券	1,800	12,276.00	0.02
668	301606	绿联科技	200	12,204.00	0.02
669	000598	兴蓉环境	1,900	12,198.00	0.02
670	300718	长盛轴承	200	12,194.00	0.02
671	002244	滨江集团	1,600	12,160.00	0.02
672	002299	圣农发展	800	12,128.00	0.02
673	600970	中材国际	1,700	12,121.00	0.02
674	688295	中复神鹰	200	12,108.00	0.02
675	600967	内蒙一机	1,100	11,935.00	0.02
676	002120	韵达股份	1,864	11,855.04	0.02
677	300146	汤臣倍健	1,300	11,752.00	0.02
678	600131	国网信通	800	11,680.00	0.02
679	000883	湖北能源	2,700	11,664.00	0.02
680	000739	普洛药业	700	11,662.00	0.02
681	300144	宋城演艺	2,000	11,620.00	0.02
682	603737	三棵树	480	11,568.00	0.02
683	002568	百润股份	680	11,505.60	0.02
684	601608	中信重工	2,400	11,448.00	0.02
685	300735	光弘科技	500	11,370.00	0.02
686	000800	一汽解放	1,900	11,305.00	0.02
687	600095	湘财股份	1,500	11,295.00	0.02
688	000027	深圳能源	1,800	11,160.00	0.02
689	300100	双林股份	400	11,112.00	0.02
690	600566	XD济川药	500	11,095.00	0.02
691	601866	中远海发	5,000	11,050.00	0.02
692	000088	盐田港	2,700	11,043.00	0.02
693	600801	华新建材	700	10,920.00	0.02

694	600126	杭钢股份	1,780	10,911.40	0.02
695	688778	厦钨新能	200	10,880.00	0.02
695	688278	特宝生物	200	10,880.00	0.02
696	601118	海南橡胶	2,200	10,824.00	0.02
697	600754	锦江酒店	600	10,794.00	0.02
698	002583	海能达	1,400	10,766.00	0.02
699	600871	石化油服	5,200	10,556.00	0.02
700	002984	森麒麟	800	10,456.00	0.02
701	603000	人民网	700	10,353.00	0.02
702	603899	晨光股份	500	10,315.00	0.02
703	600517	国网英大	2,200	10,296.00	0.02
704	000709	河钢股份	5,300	10,282.00	0.02
705	600655	豫园股份	2,500	10,275.00	0.02
706	688563	航材股份	200	10,246.00	0.02
707	688018	乐鑫科技	80	10,233.60	0.02
708	002773	康弘药业	500	10,225.00	0.02
709	603858	步长制药	700	10,220.00	0.02
710	688708	佳驰科技	200	10,160.00	0.02
711	001286	陕西能源	1,000	10,140.00	0.02
712	600350	山东高速	900	10,017.00	0.02
713	601598	中国外运	2,000	9,920.00	0.02
714	000825	太钢不锈	2,900	9,889.00	0.02
715	002423	中粮资本	1,200	9,876.00	0.02
716	601136	首创证券	700	9,765.00	0.02
717	600598	北大荒	900	9,756.00	0.02
718	688561	奇安信	400	9,592.00	0.02
719	000429	粤高速 A	700	9,555.00	0.02
720	300957	贝泰妮	300	9,453.00	0.02
721	600004	白云机场	1,300	9,438.00	0.02
722	600663	陆家嘴	1,500	9,420.00	0.02
723	600582	天地科技	2,100	9,345.00	0.02

724	603589	口子窖	500	9,340.00	0.02
725	601966	玲珑轮胎	900	9,171.00	0.02
726	603233	大参林	600	9,018.00	0.02
727	600848	上海临港	1,200	8,988.00	0.02
728	300888	稳健医疗	320	8,956.80	0.02
729	603175	超颖电子	100	8,909.00	0.02
730	601098	中南传媒	900	8,856.00	0.02
731	601928	凤凰传媒	1,000	8,790.00	0.02
732	003021	兆威机电	100	8,735.00	0.02
733	003035	南网能源	1,500	8,730.00	0.02
734	600968	海油发展	2,600	8,658.00	0.02
735	601808	中海油服	800	8,648.00	0.02
736	600295	鄂尔多斯	800	8,576.00	0.02
737	603833	欧派家居	280	8,430.80	0.02
738	002508	老板电器	570	8,333.40	0.02
739	600098	广州发展	1,400	8,274.00	0.02
740	600688	上海石化	2,800	8,204.00	0.02
741	603786	科博达	200	8,182.00	0.02
742	301498	乖宝宠物	200	8,118.00	0.02
743	000537	绿发电力	1,100	8,041.00	0.02
744	688425	铁建重工	2,000	8,040.00	0.02
745	600062	华润双鹤	500	8,020.00	0.02
746	688192	迪哲医药	200	7,986.00	0.01
747	002153	石基信息	1,100	7,953.00	0.01
748	002032	苏泊尔	200	7,920.00	0.01
749	688349	三一重能	520	7,893.60	0.01
750	600808	马钢股份	3,100	7,750.00	0.01
751	001391	国货航	1,900	7,733.00	0.01
752	002670	国盛证券	700	7,700.00	0.01
753	688709	成都华微	200	7,618.00	0.01
754	000539	粤电力 A	1,100	7,491.00	0.01

755	601298	青岛港	900	7,245.00	0.01
756	600292	电投水电	600	7,224.00	0.01
757	301301	川宁生物	900	7,146.00	0.01
758	000959	首钢股份	2,000	7,020.00	0.01
759	600764	中国海防	400	6,972.00	0.01
760	002265	建设工业	400	6,960.00	0.01
761	600377	宁沪高速	600	6,942.00	0.01
762	002608	江苏国信	1,000	6,900.00	0.01
763	688520	神州细胞	200	6,842.00	0.01
764	600339	中油工程	2,200	6,754.00	0.01
765	600606	绿地控股	5,400	6,534.00	0.01
766	000785	居然智家	3,200	6,400.00	0.01
767	600032	浙江新能	900	6,345.00	0.01
768	601139	深圳燃气	1,100	6,226.00	0.01
769	000937	冀中能源	1,540	6,129.20	0.01
770	300140	节能环保	1,200	5,964.00	0.01
771	603529	爱玛科技	300	5,853.00	0.01
772	603658	安图生物	200	5,804.00	0.01
773	000898	鞍钢股份	3,100	5,797.00	0.01
774	688475	萤石网络	200	5,470.00	0.01
775	601228	广州港	1,900	5,358.00	0.01
776	601019	山东出版	800	5,120.00	0.01
777	600927	永安期货	400	4,980.00	0.01
778	002461	珠江啤酒	600	4,542.00	0.01
779	603049	中策橡胶	100	4,481.00	0.01
780	688819	天能股份	200	4,440.00	0.01
781	002945	华林证券	300	4,029.00	0.01
782	600299	安迪苏	500	3,925.00	0.01
783	601112	振石股份	200	3,646.00	0.01
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

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	534,808.00	0.99
2	688498	源杰科技	296,956.00	0.55
3	600519	贵州茅台	283,970.00	0.53
4	300750	宁德时代	263,495.00	0.49
5	000988	华工科技	199,623.00	0.37
6	688521	芯原股份	138,077.70	0.26
7	688072	拓荆科技	133,754.00	0.25
8	001309	德明利	128,540.00	0.24
9	601318	中国平安	124,927.00	0.23
10	601899	紫金矿业	121,236.00	0.23
11	002602	世纪华通	119,606.00	0.22
12	688615	合合信息	119,317.84	0.22
13	300502	新易盛	118,658.00	0.22
14	300308	中际旭创	113,466.00	0.21
15	300757	罗博特科	94,705.00	0.18
16	600036	招商银行	92,396.00	0.17
17	601869	长飞光纤	90,870.00	0.17
18	301308	江波龙	90,654.00	0.17
19	688361	中科飞测	88,997.82	0.17
20	300666	江丰电子	86,732.00	0.16

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	688256	寒武纪	564,414.00	1.05
2	300750	宁德时代	485,855.00	0.90
3	300308	中际旭创	426,016.00	0.79
4	600519	贵州茅台	401,766.00	0.75
5	600487	亨通光电	297,612.00	0.55
6	300502	新易盛	291,266.00	0.54
7	601318	中国平安	240,556.00	0.45
8	601899	紫金矿业	218,935.00	0.41
9	600036	招商银行	191,813.00	0.36
10	688525	佰维存储	187,338.72	0.35
11	000333	美的集团	157,768.00	0.29
12	688615	合合信息	135,782.00	0.25
13	600900	长江电力	132,204.00	0.25
14	002384	东山精密	125,860.00	0.23
15	002156	通富微电	122,009.00	0.23
16	002475	立讯精密	120,805.00	0.22
17	601166	兴业银行	118,730.00	0.22
18	300757	罗博特科	113,137.00	0.21
19	688041	海光信息	108,892.00	0.20
20	601088	中国神华	108,444.00	0.20

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	10,853,136.19
卖出股票收入（成交）总额	16,461,892.25

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,000.05	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000.05	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113704	春风转债	10	1,000.05	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【招商银行股份有限公司】于2025年09月12日收到国家金融监督管理总局出具公开处罚、公开批评的通报。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，均为基金合同约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	18,786.04
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	116,992.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	135,778.20

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	2,3 92	5,000.14	-	-	11,960,328.04	100.00%
天弘 中证8 00C	16, 090	1,339.16	4,189,213.62	19.4 4%	17,357,871.05	80.56%
合计	18, 340	1,827.01	4,189,213.62	12.5 0%	29,318,199.09	87.50%

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	25.28	0.00%
	天弘中证800 C	2,086.99	0.01%

	合计	2,112.27	0.01%
--	----	----------	-------

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
	天弘中证800C	0
	合计	0

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	13,601,893.16	23,824,787.15
本报告期基金总申购份额	3,351,582.86	21,716,308.67
减：本报告期基金总赎回份额	4,993,147.98	23,994,011.15
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,960,328.04	21,547,084.67

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，本基金托管人不涉及公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及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

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	天弘基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026年06月26日
采取调查或处罚等措施的机构	国家外汇管理局天津市分局
受到调查或处罚等措施类型	行政处罚
受到的具体措施类型	警告、罚款
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（报告报送的部分内容缺失）
受到处罚的依据	《中华人民共和国外汇管理条例》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人已通过补充报送、优化流程等方式完成整改，整改成果已经国家外汇管理局天津市分局验收通过。
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门相关从业人员无受调查或处罚等情况。

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	
东方财富证券	2	11,696,253.96	42.82%	2,431.73	42.82%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	15,618,774.48	57.18%	3,247.65	57.18%	-
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		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	1,010.00	22.72%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	3,436.24	77.28%	-	-	-	-	-	-
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2025年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2025年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
3	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（2025年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-31
4	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
5	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-27
6	2025年度天弘基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026-04-30
7	天弘基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金	中国证监会规定媒介	2026-05-29

	销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告		
8	天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2026-06-13
9	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	2026-06-26
10	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	2026-06-26

§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，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日