

天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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:2023 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，并由董事长签发。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月29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2023年01月01日起至2023年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	70
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	70
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	70
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	70
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12 投资组合报告附注	71
§8 基金份额持有人信息	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72

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.....	73
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	73
§9 开放式基金份额变动.....	73
§10 重大事件揭示.....	74
10.1 基金份额持有人大会决议.....	74
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.....	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
10.4 基金投资策略的改变.....	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
10.8 其他重大事件.....	75
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
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.....	76
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
§12 备查文件目录.....	77
12.1 备查文件目录.....	77
12.2 存放地点.....	77
12.3 查阅方式.....	77

§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	56,247,784.22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	24,562,800.65份	31,684,983.57份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。本基金产品投资策略主要包括大类资产配置、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略、其他金融工具投资策略等策略。
业绩比较基准	中证800指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	天弘中证800A	天弘中证800C
本期已实现收益	-162,800.61	-242,477.40
本期利润	157,288.93	382,844.28
加权平均基金份额本期利润	0.0066	0.0125
本期加权平均净值利润率	0.57%	1.09%
本期基金份额净值增长率	0.69%	0.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	3,414,636.19	3,779,916.91
期末可供分配基金份额利润	0.1390	0.1193
期末基金资产净值	27,977,436.84	35,464,900.48
期末基金份额净值	1.1390	1.1193
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	13.90%	11.93%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘中证800A

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

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	1.23%	0.80%	0.61%	0.82%	0.62%	-0.02%
过去三个月	-4.30%	0.74%	-4.94%	0.76%	0.64%	-0.02%
过去六个月	0.69%	0.76%	0.05%	0.76%	0.64%	0.00%
过去一年	-10.35%	0.89%	-11.94%	0.90%	1.59%	-0.01%
过去三年	4.61%	1.09%	-4.94%	1.10%	9.55%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今	13.90%	1.26%	-6.72%	1.27%	20.62%	-0.01%

天弘中证800C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.21%	0.80%	0.61%	0.82%	0.60%	-0.02%
过去三个月	-4.35%	0.75%	-4.94%	0.76%	0.59%	-0.01%
过去六个月	0.59%	0.76%	0.05%	0.76%	0.54%	0.00%
过去一年	-10.53%	0.89%	-11.94%	0.90%	1.41%	-0.01%
过去三年	3.99%	1.09%	-4.94%	1.10%	8.93%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今	11.93%	1.26%	-6.72%	1.27%	18.65%	-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-2023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-2023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2023年6月30日，公司共管理运作180只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
贺雨轩	本基金基金经理	2022 年09 月	-	8年	男，通信与信息系统硕士。历任国信证券股份有限公司数据挖掘工程师。2016年10月加盟本公司，历任智能投资部研究员、指数与数量投资部高级研究员等。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为3次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内本基金秉承合规第一、风控至上的原则，在运作过程中严格遵守基金合同，对指数基金采取被动复制策略跟踪指数，完全复制指数，保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

报告期内，本基金跟踪误差严格约束在基金合同的规定范围内，其来源主要是申购赎回、成分股调整、以及成分股分红和打新等因素。当由于申赎或打新锁定等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对指数基金采取被动复制与基于风险控制组合优化相结合的方式跟踪指数。报告期内，本基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年06月30日，天弘中证800A基金份额净值为1.1390元，天弘中证800C基金份额净值为1.1193元。报告期内份额净值增长率天弘中证800A为0.69%，同期业绩比较基准增长率为0.05%；天弘中证800C为0.59%，同期业绩比较基准增长率为0.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022年底，市场整体对于疫后经济活动复苏的强度和速度给予较高预期，但在2023年上半年，伴随宏观上的诸多不确定性因素，这一预期在实际的反映中似乎有些放缓，这也在一定程度上映射到了二级市场，具体表现为当前市场信心较为悲观。我们虽无法对于经济形势、货币环境、政策走向等给出准确的预估。但可以预见在当前时点，社会经济活动恢复是自上而下的、全社会全行业共同向往并为之努力的重要目标。我们也认为，未来一定会逐步看到经济基本面的积极表现。相应地，作为经济的晴雨表，权益资产大概率也会走出较为积极的走势。因此，我们对权益资产保持乐观。

而从指数的估值上看，A股全市场整体的估值水平在各类指标上均处于中低水平，历史经验表明，在类似估值的状态下，机会显著大于风险。我们认为，中证800作为“真正的A股全市场代表指数”（沪深300指数、中证500指数均有明显的市值风格偏向。而中证800更加均衡，且是众多基金或投资产品的业绩基准指数），是实操层面配置A股全市场的优选，具有较高的配置价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜

任能力的基金经理（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对天弘中证800指数型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，天弘基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

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2023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：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,431,051.15	3,420,445.41
结算备付金		22,995.00	16,340.63
存出保证金		9,816.25	13,403.55
交易性金融资产	6.4.7.2	60,004,735.86	58,404,338.35
其中：股票投资		60,004,735.86	58,402,338.32
基金投资		-	-
债券投资		-	2,000.03
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		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券 投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		87,505.48	-
应收股利		-	-
应收申购款		72,369.91	240,634.33

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		63,628,473.65	62,095,162.27
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022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		-	2,000.02
应付赎回款		70,534.63	39,667.23
应付管理人报酬		25,930.99	26,119.54
应付托管费		5,186.19	5,223.92
应付销售服务费		5,791.98	6,050.29
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	78,692.54	144,978.44
负债合计		186,136.33	224,039.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	56,247,784.22	55,220,029.80
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	7,194,553.10	6,651,093.03
净资产合计		63,442,337.32	61,871,122.83
负债和净资产总计		63,628,473.65	62,095,162.27

注：报告截止日2023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1.1390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1.1193元；基金份额总额56,247,784.22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24,562,800.65份，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额31,684,983.57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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		843,459.77	-3,561,053.34
1.利息收入		12,881.36	11,337.01
其中：存款利息收入	6.4.7.9	12,881.36	11,337.01
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-115,408.97	373,040.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-843,156.20	-171,312.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3,916.50	20,590.14
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	723,830.73	523,763.26
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)	6.4.7.16	945,411.22	-3,946,590.65
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	576.16	1,159.36
减：二、营业总支出		303,326.56	262,008.00
1. 管理人报酬		156,536.17	125,228.35
2. 托管费		31,307.25	25,045.62
3. 销售服务费		35,012.47	31,267.26
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	80,470.67	80,466.77
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		540,133.21	-3,823,061.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		540,133.21	-3,823,061.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		540,133.21	-3,823,061.34

6.3 净资产(基金净值)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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06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（基金净值）	55,220,029.80	-	6,651,093.03	61,871,122.83
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	55,220,029.80	-	6,651,093.03	61,871,122.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,027,754.42	-	543,460.07	1,571,214.49
（一）、综合收益总额	-	-	540,133.21	540,133.21
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,027,754.42	-	3,326.86	1,031,081.28
其中：1.基金申购款	16,989,737.17	-	2,743,485.84	19,733,223.01
2.基金赎回款	-15,961,982.75	-	-2,740,158.98	-18,702,141.73
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值	-	-	-	-

变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	56,247,784.22	-	7,194,553.10	63,442,337.32
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06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(基金净值)	37,017,372.81	-	13,860,659.26	50,878,032.07
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	37,017,372.81	-	13,860,659.26	50,878,032.07
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	8,664,478.02	-	-2,070,365.76	6,594,112.26
(一)、综合收益总额	-	-	-3,823,061.34	-3,823,061.34
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	8,664,478.02	-	1,752,695.58	10,417,173.60

其中：1.基金申购款	23,651,188.30	-	4,934,891.52	28,586,079.82
2.基金赎回款	-14,986,710.28	-	-3,182,195.94	-18,168,906.22
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	45,681,850.83	-	11,790,293.50	57,472,144.33

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：

韩歆毅（代）

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘中证800指数型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1339号《关于准予天弘中证800指数型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式发起式基金，存续期限不定，首次募集期间为2015年7月15日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集10,000,000.00元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第959号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》于2015年7月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023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2023年06月30日的财务状况以及2023年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对

基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	3,431,051.15
等于：本金	3,430,375.07
加：应计利息	676.08
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,431,051.15

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	65,341,462.67	-	60,004,735.86	-5,336,726.81
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	65,341,462.67	-	60,004,735.86	-5,336,726.81

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 2023年06月30日

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5.92
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,219.85
其中：交易所市场	6,219.85
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,466.77
其他应付款	8,000.00
合计	78,692.54

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 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,126,849.74	23,126,849.74
本期申购	4,323,652.73	4,323,652.73
本期赎回（以“-”号填列）	-2,887,701.82	-2,887,701.82
本期末	24,562,800.65	24,562,800.65

6.4.7.7.2 天弘中证800C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,093,180.06	32,093,180.06
本期申购	12,666,084.44	12,666,084.44
本期赎回（以“-”号填列）	-13,074,280.93	-13,074,280.93
本期末	31,684,983.57	31,684,983.57

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
本期期初	11,541,963.97	-8,508,016.06	3,033,947.91
本期利润	-162,800.61	320,089.54	157,288.93
本期基金份额交易产生的变动数	709,394.05	-485,994.70	223,399.35
其中：基金申购款	2,141,362.55	-1,390,202.32	751,160.23
基金赎回款	-1,431,968.50	904,207.62	-527,760.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,088,557.41	-8,673,921.22	3,414,636.19

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
本期期初	15,297,646.22	-11,680,501.10	3,617,145.12
本期利润	-242,477.40	625,321.68	382,844.28
本期基金份额交易产生的变动数	-204,178.13	-15,894.36	-220,072.49
其中：基金申购款	5,985,259.83	-3,992,934.22	1,992,325.61
基金赎回款	-6,189,437.96	3,977,039.86	-2,212,398.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,850,990.69	-11,071,073.78	3,779,916.91

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日

活期存款利息收入	12,653.83
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	123.70
其他	103.83
合计	12,881.36

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
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	10,975,166.17
减：卖出股票成本总额	11,795,510.95
减：交易费用	22,811.42
买卖股票差价收入	-843,156.20

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
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	3.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,912.76
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	3,916.50

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
	2023年01月01日至2023年06月30日

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	21,617.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,700.00
减：应计利息总额	3.77
减：交易费用	0.88
买卖债券差价收入	3,912.76

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
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	723,830.73
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	723,830.73

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	945,411.22
——股票投资	945,411.22
——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	945,411.22

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	572.12
基金转换费收入	4.04
合计	576.16

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
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	24,795.19

信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
指数使用费	16,000.00
存托服务费	3.90
合计	80,470.67

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
广发证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	156,536.17	125,228.35
其中：支付销售机构的客户维护费	44,740.64	35,194.56

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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	31,307.25	25,045.62

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	本期 2023年01月01日至2023年06月30日

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司	-	15,219.50	15,219.50
广发证券股份有限公司	-	162.18	162.18
合计	-	15,381.68	15,381.68
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司	-	15,783.17	15,783.17
广发证券股份有限公司	-	169.68	169.68
合计	-	15,952.85	15,952.85

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

日销售服务费=前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘中证800A不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	3,431,051.15	12,653.83	3,180,003.57	11,122.35

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金（因追踪指数成份股而被动）持有广发证券的股票6,700股（上年度末：7,100股），估值总额为人民币98,557.00元（上年度末：109,979.00元），占基金净资产的比例为0.16%（上年度末：0.18%）；持有君正集团的股票7,400股（上年度

末：7,400股），估值总额为人民币30,340.00元（上年度末：29,526.00元），占基金净资产的比例为0.05%（上年度末：0.05%）。

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（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
601298	青岛港	2023-06-28	拟筹划重大资产重组	6.97	2023-07-03	7.40	1,500	9,027.86	10,455.00	-

注:本基金截至2023年06月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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2023年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型指数基金，采用指数复制投资策略，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责拟定公司风险管理战略，经董事会批准后组织实施；组织实施经董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理作出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险管理事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的及时性、经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基

金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人广发证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

新金融工具准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金在参考历史违约率、市场信息及行业实践的基础上，选取隐含评级AA级为低信用风险阈值，并将减值阶段划分如下：在资产负债表日，若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级不低于初始确认隐含评级，或不低于低信用风险阈值，则处于第一阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级低于初始确认隐含评级，且低于低信用风险阈值，则处于第二阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体中债市场隐含评级下调至C，或出现其他认定为违约的情形时，则处于第三阶段。

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	2,000.03
未评级	-	-
合计	-	2,000.03

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,431,051.15	-	-	-	3,431,051.15
结算备付金	22,995.00	-	-	-	22,995.00
存出保证金	9,816.25	-	-	-	9,816.25
交易性金融资产	-	-	-	60,004,735.86	60,004,735.86
应收清算款	-	-	-	87,505.48	87,505.48
应收申购款	-	-	-	72,369.91	72,369.91
资产总计	3,463,862.40	-	-	60,164,611.25	63,628,473.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	70,534.63	70,534.63
应付管理人报酬	-	-	-	25,930.99	25,930.99
应付托管费	-	-	-	5,186.19	5,186.19
应付销售服务费	-	-	-	5,791.98	5,791.98
其他负债	-	-	-	78,692.54	78,692.54
负债总计	-	-	-	186,136.33	186,136.33
利率敏感度缺口	3,463,862.40	-	-	59,978,474.92	63,442,337.32
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	3,420,445.41	-	-	-	3,420,445.41
结算备付金	16,340.63	-	-	-	16,340.63
存出保证金	13,403.55	-	-	-	13,403.55
交易性金融资产	-	-	2,000.03	58,402,338.32	58,404,338.35
应收申购款	-	-	-	240,634.33	240,634.33
资产总计	3,450,189.59	-	2,000.03	58,642,972.65	62,095,162.27
负债					
应付清算款	-	-	-	2,000.02	2,000.02

应付赎回款	-	-	-	39,667.23	39,667.23
应付管理人报酬	-	-	-	26,119.54	26,119.54
应付托管费	-	-	-	5,223.92	5,223.92
应付销售服务费	-	-	-	6,050.29	6,050.29
其他负债	-	-	-	144,978.44	144,978.44
负债总计	-	-	-	224,039.44	224,039.44
利率敏感度缺口	3,450,189.59	-	2,000.03	58,418,933.21	61,871,122.83

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2023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%(2022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(2022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 2023年06月30日		上年度末 2022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	60,004,735.86	94.58	58,402,338.32	94.39
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	60,004,735.86	94.58	58,402,338.32	94.39

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	3,104,233.57	3,088,297.10
	业绩比较基准下降5%	-3,104,233.57	-3,088,297.10

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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	59,994,280.86	58,347,852.32
第二层次	10,455.00	56,486.03
第三层次	-	-
合计	60,004,735.86	58,404,338.35

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023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(2022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	60,004,735.86	94.30
	其中：股票	60,004,735.86	94.30

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,454,046.15	5.43
8	其他各项资产	169,691.64	0.27
9	合计	63,628,473.65	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	526,798.00	0.83
B	采矿业	2,219,811.18	3.50
C	制造业	35,758,793.87	56.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,790,938.50	2.82
E	建筑业	1,155,960.17	1.82
F	批发和零售业	1,540,917.00	2.43
G	交通运输、仓储和邮政业	1,477,214.12	2.33
H	住宿和餐饮业	46,574.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,984,077.58	4.70
J	金融业	9,864,586.59	15.55
K	房地产业	831,763.22	1.31
L	租赁和商务服务业	559,767.10	0.88
M	科学研究和技术服务业	520,356.68	0.82

N	水利、环境和公共设施管理业	78,490.70	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	307,000.05	0.48
R	文化、体育和娱乐业	260,923.70	0.41
S	综合	80,763.40	0.13
	合计	60,004,735.86	94.58

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	XD贵州茅	1,500	2,536,500.00	4.00
2	300750	宁德时代	6,060	1,386,467.40	2.19
3	601318	中国平安	25,245	1,171,368.00	1.85
4	600036	招商银行	28,900	946,764.00	1.49
5	603707	健友股份	55,775	752,962.50	1.19
6	600511	国药股份	19,200	745,920.00	1.18
7	000858	五粮液	4,497	735,574.29	1.16
8	000333	美的集团	11,486	676,755.12	1.07
9	000400	许继电气	28,000	645,400.00	1.02
10	601166	兴业银行	33,900	530,535.00	0.84
11	002594	比亚迪	2,000	516,540.00	0.81
12	601689	拓普集团	6,400	516,480.00	0.81
13	600900	长江电力	22,800	502,968.00	0.79

14	600276	恒瑞医药	9,815	470,138.50	0.74
15	601899	紫金矿业	38,400	436,608.00	0.69
16	600030	中信证券	21,460	424,478.80	0.67
17	600887	伊利股份	14,100	399,312.00	0.63
18	300059	东方财富	27,877	395,853.40	0.62
19	601012	隆基绿能	13,337	382,371.79	0.60
20	000932	华菱钢铁	78,680	375,303.60	0.59
21	601398	工商银行	77,100	371,622.00	0.59
22	000651	格力电器	9,900	361,449.00	0.57
23	600309	万华化学	4,080	358,387.20	0.56
24	002475	立讯精密	10,882	353,120.90	0.56
25	601328	交通银行	60,400	350,320.00	0.55
26	002415	海康威视	10,375	343,516.25	0.54
27	000725	京东方 A	82,500	337,425.00	0.53
28	000568	泸州老窖	1,600	335,312.00	0.53
29	300760	迈瑞医疗	1,100	329,780.00	0.52
30	600893	航发动力	7,600	321,176.00	0.51
31	000063	中兴通讯	6,900	314,226.00	0.50
32	002230	科大讯飞	4,200	285,432.00	0.45
33	601816	京沪高铁	54,000	284,040.00	0.45
34	000513	丽珠集团	7,261	282,525.51	0.45
35	600028	中国石化	44,400	282,384.00	0.45
36	603259	药明康德	4,528	282,139.68	0.44
37	601607	上海医药	12,490	279,900.90	0.44
38	600150	中国船舶	8,300	273,153.00	0.43
39	300274	阳光电源	2,340	272,914.20	0.43
40	300124	汇川技术	4,200	269,682.00	0.43
41	601668	XD中国建	46,080	264,499.20	0.42
42	000739	普洛药业	14,900	264,326.00	0.42
43	002129	TCL中环	7,500	249,000.00	0.39
44	601288	农业银行	69,500	245,335.00	0.39

45	002714	牧原股份	5,820	245,313.00	0.39
46	002352	顺丰控股	5,400	243,486.00	0.38
47	002252	上海莱士	31,900	239,569.00	0.38
48	000001	平安银行	21,300	239,199.00	0.38
49	601888	中国中免	2,100	232,113.00	0.37
50	000792	盐湖股份	11,900	228,123.00	0.36
51	688981	中芯国际	4,500	227,340.00	0.36
52	601138	工业富联	9,000	226,800.00	0.36
53	601088	中国神华	7,200	221,400.00	0.35
54	300308	中际旭创	1,500	221,175.00	0.35
55	002142	宁波银行	8,725	220,742.50	0.35
56	600031	三一重工	13,000	216,190.00	0.34
57	300498	温氏股份	11,580	212,493.00	0.33
58	000002	万科A	15,001	210,314.02	0.33
59	600438	通威股份	6,100	209,291.00	0.33
60	600690	海尔智家	8,800	206,624.00	0.33
61	600048	保利发展	15,800	205,874.00	0.32
62	600406	国电南瑞	8,736	201,801.60	0.32
63	600050	中国联通	42,000	201,600.00	0.32
64	600016	民生银行	53,740	201,525.00	0.32
65	600436	片仔癀	700	200,452.00	0.32
66	600809	山西汾酒	1,080	199,875.60	0.32
67	601857	中国石油	26,400	197,208.00	0.31
68	600941	中国移动	2,100	195,930.00	0.31
69	600837	海通证券	21,000	193,620.00	0.31
70	601601	中国太保	7,450	193,551.00	0.31
71	600000	浦发银行	26,700	193,308.00	0.30
72	002371	北方华创	600	190,590.00	0.30
73	601728	中国电信	33,800	190,294.00	0.30
74	688111	金山办公	402	189,832.44	0.30
75	600089	特变电工	8,500	189,465.00	0.30

76	600919	江苏银行	25,750	189,262.50	0.30
77	300015	爱尔眼科	10,143	188,152.65	0.30
78	603501	韦尔股份	1,900	186,276.00	0.29
79	601766	中国中车	27,700	180,050.00	0.28
80	601988	中国银行	45,900	179,469.00	0.28
81	600905	三峡能源	33,400	179,358.00	0.28
82	603288	海天味业	3,797	177,889.45	0.28
83	601390	中国中铁	22,600	171,308.00	0.27
84	002304	洋河股份	1,300	170,755.00	0.27
85	688301	奕瑞科技	601	169,740.43	0.27
86	002422	科伦药业	5,600	166,208.00	0.26
87	300014	亿纬锂能	2,745	166,072.50	0.26
88	601688	华泰证券	11,801	162,499.77	0.26
89	002460	赣锋锂业	2,641	160,995.36	0.25
90	002459	晶澳科技	3,828	159,627.60	0.25
91	000338	潍柴动力	12,700	158,242.00	0.25
92	002027	分众传媒	22,960	156,357.60	0.25
93	688012	中微公司	997	155,980.65	0.25
94	601985	中国核电	22,000	155,100.00	0.24
95	600104	上汽集团	10,900	154,453.00	0.24
96	600570	恒生电子	3,486	154,394.94	0.24
97	603986	兆易创新	1,452	154,275.00	0.24
98	002466	天齐锂业	2,200	153,802.00	0.24
99	601225	陕西煤业	8,400	152,796.00	0.24
100	601169	北京银行	32,200	149,086.00	0.23
101	002050	三花智控	4,913	148,667.38	0.23
102	000938	紫光股份	4,623	147,242.55	0.23
103	000625	长安汽车	11,268	145,695.24	0.23
104	601211	国泰君安	9,900	138,501.00	0.22
105	000100	TCL科技	34,760	136,954.40	0.22
106	002049	紫光国微	1,460	136,145.00	0.21

107	002179	中航光电	2,988	135,505.80	0.21
108	300896	爱美客	300	133,485.00	0.21
109	601229	上海银行	23,170	133,227.50	0.21
110	601628	中国人寿	3,800	132,848.00	0.21
111	601989	中国重工	27,300	131,586.00	0.21
112	601919	中远海控	13,990	131,506.00	0.21
113	603799	华友钴业	2,821	129,512.11	0.20
114	600660	福耀玻璃	3,600	129,060.00	0.20
115	603019	中科曙光	2,500	127,250.00	0.20
116	600585	海螺水泥	5,301	125,845.74	0.20
117	600886	国投电力	9,700	122,705.00	0.19
118	300122	智飞生物	2,700	119,340.00	0.19
119	002271	东方雨虹	4,350	118,581.00	0.19
120	601658	邮储银行	23,700	115,893.00	0.18
121	002812	恩捷股份	1,200	115,620.00	0.18
122	600111	XD北方稀	4,800	115,104.00	0.18
123	000977	浪潮信息	2,300	111,550.00	0.18
124	600958	东方证券	11,484	111,394.80	0.18
125	601818	光大银行	36,000	110,520.00	0.17
126	600019	宝钢股份	19,592	110,107.04	0.17
127	600999	招商证券	8,040	109,102.80	0.17
128	002709	天赐材料	2,608	107,423.52	0.17
129	300316	晶盛机电	1,500	106,350.00	0.17
130	600760	中航沈飞	2,324	104,580.00	0.16
131	688599	天合光能	2,400	102,264.00	0.16
132	600426	华鲁恒升	3,290	100,772.70	0.16
133	600584	长电科技	3,200	99,744.00	0.16
134	600009	上海机场	2,186	99,288.12	0.16
135	000596	古井贡酒	401	99,199.38	0.16
136	000776	广发证券	6,700	98,557.00	0.16
137	601186	中国铁建	10,000	98,500.00	0.16

138	300142	沃森生物	3,700	97,865.00	0.15
139	600588	用友网络	4,761	97,600.50	0.15
140	688008	澜起科技	1,696	97,384.32	0.15
141	601006	大秦铁路	13,000	96,590.00	0.15
142	601600	中国铝业	17,400	95,526.00	0.15
143	002410	广联达	2,940	95,520.60	0.15
144	000661	长春高新	700	95,410.00	0.15
145	601800	中国交建	8,700	94,917.00	0.15
146	300450	先导智能	2,620	94,765.40	0.15
147	600547	山东黄金	4,016	94,295.68	0.15
148	002920	德赛西威	600	93,486.00	0.15
149	000963	华东医药	2,147	93,115.39	0.15
150	601377	兴业证券	15,150	92,718.00	0.15
151	001979	招商蛇口	7,100	92,513.00	0.15
152	002241	歌尔股份	5,202	92,335.50	0.15
153	000166	申万宏源	19,820	91,568.40	0.14
154	601939	建设银行	14,600	91,396.00	0.14
155	300408	三环集团	3,100	90,985.00	0.14
156	601669	中国电建	15,700	90,118.00	0.14
157	600196	复星医药	2,900	89,610.00	0.14
158	601009	南京银行	11,200	89,600.00	0.14
159	600011	华能国际	9,600	88,896.00	0.14
160	600010	包钢股份	49,600	88,784.00	0.14
161	688036	传音控股	600	88,200.00	0.14
162	300033	同花顺	500	87,640.00	0.14
163	600085	同仁堂	1,500	86,340.00	0.14
164	000768	中航西飞	3,200	85,600.00	0.13
165	300418	昆仑万维	2,100	84,588.00	0.13
166	002311	海大集团	1,800	84,312.00	0.13
167	000538	云南白药	1,603	84,125.44	0.13
168	000988	华工科技	2,200	83,622.00	0.13

169	603659	璞泰来	2,175	83,128.50	0.13
170	600600	青岛啤酒	800	82,904.00	0.13
171	000157	中联重科	12,200	82,350.00	0.13
172	603993	洛阳钼业	15,400	82,082.00	0.13
173	600795	国电电力	21,300	81,579.00	0.13
174	002340	格林美	11,800	81,538.00	0.13
175	002384	东山精密	3,100	80,290.00	0.13
176	601360	三六零	6,300	79,002.00	0.12
177	600372	中航电子	5,200	78,936.00	0.12
178	600745	闻泰科技	1,600	78,240.00	0.12
179	002236	大华股份	3,950	78,012.50	0.12
180	600732	爱旭股份	2,520	77,490.00	0.12
181	002493	荣盛石化	6,600	76,824.00	0.12
182	000733	振华科技	800	76,680.00	0.12
183	600926	杭州银行	6,520	76,610.00	0.12
184	600845	宝信软件	1,507	76,570.67	0.12
185	600157	永泰能源	53,100	75,402.00	0.12
186	600029	南方航空	12,500	75,375.00	0.12
187	688256	寒武纪	399	75,012.00	0.12
188	601868	中国能建	31,999	74,877.66	0.12
189	601117	中国化学	9,000	74,520.00	0.12
190	000425	徐工机械	11,000	74,470.00	0.12
191	603369	今世缘	1,400	73,920.00	0.12
192	600176	中国巨石	5,201	73,646.16	0.12
193	601100	恒立液压	1,144	73,593.52	0.12
194	688777	中控技术	1,160	72,824.80	0.11
195	002202	金风科技	6,851	72,757.62	0.11
196	600015	华夏银行	13,400	72,494.00	0.11
197	600741	华域汽车	3,900	71,994.00	0.11
198	002074	国轩高科	2,600	71,812.00	0.11
199	300782	卓胜微	740	71,506.20	0.11

200	601995	中金公司	2,000	71,040.00	0.11
201	300347	泰格医药	1,100	70,994.00	0.11
202	300012	华测检测	3,600	70,200.00	0.11
203	600079	人福医药	2,602	70,097.88	0.11
204	300003	乐普医疗	3,100	70,091.00	0.11
205	002028	思源电气	1,500	70,080.00	0.11
206	601336	新华保险	1,901	69,899.77	0.11
207	601788	光大证券	4,300	68,327.00	0.11
208	600989	宝丰能源	5,400	68,094.00	0.11
209	601633	长城汽车	2,700	67,959.00	0.11
210	601066	中信建投	2,800	67,760.00	0.11
211	300496	中科创达	700	67,445.00	0.11
212	300724	捷佳伟创	600	67,410.00	0.11
213	600487	亨通光电	4,560	66,849.60	0.11
214	601877	正泰电器	2,400	66,360.00	0.10
215	600346	恒力石化	4,620	66,204.60	0.10
216	600489	中金黄金	6,400	66,112.00	0.10
217	600188	兖矿能源	2,200	65,824.00	0.10
218	000876	新希望	5,601	65,419.68	0.10
219	002180	纳思达	1,900	65,075.00	0.10
220	603806	福斯特	1,739	64,673.41	0.10
221	688169	石头科技	200	64,136.00	0.10
222	300413	芒果超媒	1,870	63,972.70	0.10
223	002001	新和成	4,144	63,817.60	0.10
224	600765	中航重机	2,380	63,093.80	0.10
225	688396	华润微	1,190	62,367.90	0.10
226	000066	中国长城	4,500	62,235.00	0.10
227	600674	川投能源	4,100	61,705.00	0.10
228	601618	中国中冶	15,500	61,535.00	0.10
229	601058	赛轮轮胎	5,400	61,506.00	0.10
230	000786	北新建材	2,500	61,275.00	0.10

231	300037	新宙邦	1,180	61,230.20	0.10
232	000807	云铝股份	4,800	61,104.00	0.10
233	601111	中国国航	7,400	60,976.00	0.10
234	601555	东吴证券	8,747	60,704.18	0.10
235	600885	宏发股份	1,896	60,387.60	0.10
236	300999	金龙鱼	1,500	59,985.00	0.09
237	600352	浙江龙盛	6,400	59,840.00	0.09
238	601901	方正证券	9,000	58,860.00	0.09
239	000895	双汇发展	2,400	58,776.00	0.09
240	601838	成都银行	4,800	58,608.00	0.09
241	600039	四川路桥	5,880	57,682.80	0.09
242	601615	明阳智能	3,400	57,392.00	0.09
243	002007	华兰生物	2,555	57,257.55	0.09
244	002738	中矿资源	1,120	57,052.80	0.09
245	000009	中国宝安	4,720	56,970.40	0.09
246	600233	圆通速递	3,900	56,784.00	0.09
247	688303	大全能源	1,400	56,630.00	0.09
248	300454	深信服	500	56,625.00	0.09
249	002648	卫星化学	3,780	56,548.80	0.09
250	600482	中国动力	2,400	56,256.00	0.09
251	003816	中国广核	18,000	55,980.00	0.09
252	600115	中国东航	11,700	55,692.00	0.09
253	300146	汤臣倍健	2,300	55,154.00	0.09
254	002966	苏州银行	8,420	55,151.00	0.09
255	002736	国信证券	6,300	54,999.00	0.09
256	300285	国瓷材料	2,000	54,800.00	0.09
257	600096	云天化	3,200	54,624.00	0.09
258	600460	士兰微	1,800	54,486.00	0.09
259	002185	华天科技	5,900	54,280.00	0.09
260	600418	江淮汽车	4,300	54,137.00	0.09
261	002385	大北农	8,200	54,120.00	0.09

262	605117	德业股份	360	53,838.00	0.08
263	002841	视源股份	800	53,472.00	0.08
264	600219	南山铝业	17,700	53,454.00	0.08
265	002625	光启技术	3,500	53,410.00	0.08
266	300661	圣邦股份	650	53,384.50	0.08
267	300058	蓝色光标	5,500	53,185.00	0.08
268	300223	北京君正	600	52,986.00	0.08
269	300769	德方纳米	480	52,910.40	0.08
270	002407	多氟多	2,660	52,827.60	0.08
271	002601	龙佰集团	3,200	52,800.00	0.08
272	688126	沪硅产业	2,502	52,291.80	0.08
273	000301	东方盛虹	4,400	52,008.00	0.08
274	600383	金地集团	7,200	51,912.00	0.08
275	300433	蓝思科技	4,400	51,744.00	0.08
276	300568	星源材质	3,000	51,570.00	0.08
277	601108	财通证券	7,110	51,476.40	0.08
278	600415	小商品城	6,000	51,180.00	0.08
279	600332	白云山	1,600	51,008.00	0.08
280	688099	晶晨股份	600	50,592.00	0.08
281	601865	福莱特	1,300	50,063.00	0.08
282	601238	广汽集团	4,800	50,016.00	0.08
283	002624	完美世界	2,950	49,825.50	0.08
284	002008	大族激光	1,900	49,780.00	0.08
285	002821	凯莱英	420	49,501.20	0.08
286	300474	景嘉微	550	49,494.50	0.08
287	000783	长江证券	8,500	49,300.00	0.08
288	300395	菲利华	1,000	49,200.00	0.08
289	603444	吉比特	100	49,111.00	0.08
290	300207	欣旺达	3,000	48,960.00	0.08
291	002223	鱼跃医疗	1,350	48,586.50	0.08
292	600875	东方电气	2,600	48,490.00	0.08

293	601077	渝农商行	13,500	48,465.00	0.08
294	600763	通策医疗	500	48,430.00	0.08
295	000983	山西焦煤	5,300	48,230.00	0.08
296	000933	神火股份	3,700	48,100.00	0.08
297	600862	中航高科	1,900	48,089.00	0.08
298	002240	盛新锂能	1,500	47,805.00	0.08
299	601233	桐昆股份	3,600	47,700.00	0.08
300	600161	天坛生物	1,752	47,566.80	0.07
301	603596	伯特利	600	47,556.00	0.07
302	600027	华电国际	7,100	47,499.00	0.07
303	002156	通富微电	2,100	47,460.00	0.07
304	600754	锦江酒店	1,100	46,574.00	0.07
305	300024	机器人	2,780	46,342.60	0.07
306	601872	招商轮船	8,000	46,320.00	0.07
307	000630	铜陵有色	16,000	46,240.00	0.07
308	002497	雅化集团	2,600	46,228.00	0.07
309	600160	巨化股份	3,350	46,163.00	0.07
310	600132	重庆啤酒	500	46,080.00	0.07
311	601021	春秋航空	800	45,976.00	0.07
312	603688	石英股份	400	45,536.00	0.07
313	603882	金域医学	600	45,300.00	0.07
314	000723	美锦能源	6,000	45,240.00	0.07
315	603486	科沃斯	580	45,106.60	0.07
316	601162	天风证券	15,130	45,087.40	0.07
317	600705	中航产融	11,700	44,811.00	0.07
318	600060	海信视像	1,800	44,550.00	0.07
319	600988	赤峰黄金	3,300	44,418.00	0.07
320	000831	中国稀土	1,500	44,400.00	0.07
321	300628	亿联网络	1,260	44,188.20	0.07
322	601168	西部矿业	4,200	44,142.00	0.07
323	600873	梅花生物	4,900	43,757.00	0.07

324	002409	雅克科技	600	43,728.00	0.07
325	002294	信立泰	1,400	43,666.00	0.07
326	600362	江西铜业	2,300	43,654.00	0.07
327	300751	迈为股份	256	43,361.28	0.07
328	688521	芯原股份	600	43,152.00	0.07
328	300144	宋城演艺	3,480	43,152.00	0.07
329	000975	银泰黄金	3,680	43,056.00	0.07
330	603290	斯达半导	200	43,040.00	0.07
331	002138	顺络电子	1,800	43,038.00	0.07
332	002568	百润股份	1,180	42,893.00	0.07
333	002600	领益智造	6,200	42,842.00	0.07
334	600066	宇通客车	2,900	42,746.00	0.07
335	000617	中油资本	5,900	42,657.00	0.07
336	601878	浙商证券	4,300	42,484.00	0.07
337	600109	国金证券	4,900	42,483.00	0.07
338	603939	益丰药房	1,148	42,476.00	0.07
339	601699	潞安环能	2,600	42,432.00	0.07
340	002465	海格通信	4,100	42,394.00	0.07
341	300136	信维通信	2,100	42,168.00	0.07
342	600918	中泰证券	6,100	42,151.00	0.07
343	300759	康龙化成	1,100	42,108.00	0.07
344	000021	深科技	2,100	41,979.00	0.07
345	603816	顾家家居	1,100	41,965.00	0.07
346	002797	第一创业	7,300	41,756.00	0.07
347	000683	远兴能源	5,800	41,702.00	0.07
348	002439	启明星辰	1,400	41,664.00	0.07
349	300832	新产业	700	41,300.00	0.07
350	600563	法拉电子	300	41,190.00	0.06
351	300253	卫宁健康	3,800	41,116.00	0.06
352	300118	东方日升	1,600	41,008.00	0.06
353	002268	电科网安	1,470	40,968.90	0.06

354	601128	常熟银行	6,000	40,920.00	0.06
355	600839	四川长虹	8,100	40,905.00	0.06
356	601319	中国人保	7,000	40,880.00	0.06
357	600879	航天电子	4,800	40,752.00	0.06
358	002756	永兴材料	650	40,696.50	0.06
359	605358	立昂微	1,100	40,403.00	0.06
360	688002	睿创微纳	899	40,275.20	0.06
361	300073	当升科技	800	40,264.00	0.06
362	601990	南京证券	4,900	40,082.00	0.06
363	601998	中信银行	6,700	40,066.00	0.06
364	600392	盛和资源	3,110	40,025.70	0.06
365	600061	国投资本	5,616	39,985.92	0.06
366	600803	新奥股份	2,100	39,858.00	0.06
367	600642	申能股份	5,700	39,843.00	0.06
368	600298	安琪酵母	1,100	39,831.00	0.06
369	002850	科达利	300	39,675.00	0.06
370	603589	口子窖	800	39,480.00	0.06
371	601696	中银证券	3,700	39,442.00	0.06
372	600884	杉杉股份	2,600	39,364.00	0.06
373	000069	华侨城 A	8,900	39,160.00	0.06
374	600497	XD驰宏锌	7,800	39,156.00	0.06
375	600699	均胜电子	2,200	38,808.00	0.06
376	000729	燕京啤酒	3,100	38,657.00	0.06
377	600177	雅戈尔	6,100	38,491.00	0.06
378	300438	鹏辉能源	800	38,432.00	0.06
379	300017	网宿科技	5,400	38,394.00	0.06
380	002025	航天电器	600	38,280.00	0.06
381	300604	长川科技	800	37,992.00	0.06
382	300601	康泰生物	1,480	37,577.20	0.06
383	600499	科达制造	3,300	37,488.00	0.06
384	002673	西部证券	5,900	37,465.00	0.06

385	300487	蓝晓科技	600	37,452.00	0.06
386	000728	国元证券	5,740	37,424.80	0.06
387	002078	太阳纸业	3,500	37,415.00	0.06
388	600141	兴发集团	1,680	37,329.60	0.06
389	600018	上港集团	7,100	37,275.00	0.06
390	300390	天华新能	1,040	37,232.00	0.06
391	601799	星宇股份	300	37,080.00	0.06
392	600521	华海药业	2,000	36,820.00	0.06
393	000629	钒钛股份	9,400	36,754.00	0.06
394	600549	厦门钨业	1,930	36,727.90	0.06
395	600118	中国卫星	1,300	36,673.00	0.06
396	000591	太阳能	5,400	36,612.00	0.06
397	600325	华发股份	3,700	36,445.00	0.06
398	002938	鹏鼎控股	1,500	36,435.00	0.06
399	600183	生益科技	2,565	36,423.00	0.06
400	603833	欧派家居	380	36,404.00	0.06
401	002195	二三四五	12,479	36,064.31	0.06
402	002273	水晶光电	3,018	36,034.92	0.06
403	600153	建发股份	3,300	36,003.00	0.06
404	000960	锡业股份	2,300	35,765.00	0.06
405	603899	晨光股份	800	35,712.00	0.06
406	600399	抚顺特钢	3,500	35,700.00	0.06
407	600859	王府井	1,800	35,622.00	0.06
408	600637	东方明珠	4,490	35,111.80	0.06
409	603260	合盛硅业	500	35,010.00	0.06
410	300866	安克创新	400	35,000.00	0.06
411	600486	扬农化工	400	34,968.00	0.06
412	600143	金发科技	4,000	34,920.00	0.06
413	000708	中信特钢	2,200	34,848.00	0.05
414	603927	中科软	900	34,704.00	0.05
415	002065	东华软件	4,900	34,594.00	0.05

416	300699	光威复材	1,120	34,552.00	0.05
417	688567	孚能科技	1,600	34,544.00	0.05
418	000519	中兵红箭	1,900	34,371.00	0.05
419	002430	杭氧股份	1,000	34,360.00	0.05
420	600271	航天信息	2,500	34,225.00	0.05
421	000738	航发控制	1,400	34,160.00	0.05
422	601577	长沙银行	4,400	34,144.00	0.05
423	002373	千方科技	2,500	34,100.00	0.05
424	002916	深南电路	452	34,067.24	0.05
425	000997	新大陆	1,800	34,020.00	0.05
426	600166	福田汽车	10,000	34,000.00	0.05
427	002131	利欧股份	14,700	33,810.00	0.05
428	601898	中煤能源	4,000	33,760.00	0.05
429	002368	太极股份	820	33,759.40	0.05
430	600704	物产中大	6,800	33,592.00	0.05
431	002192	融捷股份	500	33,415.00	0.05
432	002281	光迅科技	900	33,381.00	0.05
433	688390	固德威	200	33,372.00	0.05
434	300001	特锐德	1,600	33,248.00	0.05
435	002557	洽洽食品	800	33,240.00	0.05
436	688009	中国通号	5,701	33,065.80	0.05
437	002444	巨星科技	1,500	32,820.00	0.05
438	601997	贵阳银行	6,360	32,817.60	0.05
439	603077	和邦生物	13,500	32,805.00	0.05
440	000703	恒逸石化	4,838	32,801.64	0.05
441	000623	吉林敖东	2,043	32,769.72	0.05
442	600529	山东药玻	1,200	32,664.00	0.05
443	300088	长信科技	5,400	32,562.00	0.05
444	603392	万泰生物	487	32,516.99	0.05
445	601881	中国银河	2,800	32,508.00	0.05
446	600998	九州通	3,129	32,479.02	0.05

447	002683	广东宏大	1,100	32,384.00	0.05
448	600867	通化东宝	3,100	32,364.00	0.05
449	600348	华阳股份	4,050	32,035.50	0.05
450	002531	天顺风能	2,100	31,983.00	0.05
451	002506	协鑫集成	10,900	31,937.00	0.05
452	600970	中材国际	2,500	31,875.00	0.05
453	600546	山煤国际	2,200	31,834.00	0.05
454	600380	健康元	2,504	31,825.84	0.05
455	002532	天山铝业	5,300	31,747.00	0.05
456	002152	广电运通	2,700	31,644.00	0.05
457	000408	藏格矿业	1,400	31,598.00	0.05
458	600739	辽宁成大	2,400	31,560.00	0.05
459	002064	华峰化学	4,600	31,556.00	0.05
460	601016	节能风电	8,580	31,488.60	0.05
461	002739	万达电影	2,500	31,350.00	0.05
462	300763	锦浪科技	300	31,230.00	0.05
463	002203	海亮股份	2,600	31,226.00	0.05
464	600516	方大炭素	5,033	31,204.60	0.05
465	600170	上海建工	11,600	31,204.00	0.05
466	002056	横店东磁	1,700	30,957.00	0.05
467	002507	涪陵榨菜	1,690	30,943.90	0.05
468	600655	豫园股份	4,500	30,870.00	0.05
469	600498	烽火通信	1,512	30,799.44	0.05
470	002080	中材科技	1,500	30,780.00	0.05
471	002299	圣农发展	1,600	30,640.00	0.05
472	688200	华峰测控	200	30,600.00	0.05
473	601216	君正集团	7,400	30,340.00	0.05
474	002120	韵达股份	3,164	30,247.84	0.05
475	601636	旗滨集团	3,500	30,170.00	0.05
476	002353	杰瑞股份	1,200	30,156.00	0.05
477	300919	中伟股份	500	30,125.00	0.05

478	603456	九洲药业	1,100	30,118.00	0.05
479	300383	光环新网	2,800	30,100.00	0.05
480	688385	复旦微电	600	30,060.00	0.05
481	300676	华大基因	500	29,995.00	0.05
482	300748	金力永磁	1,000	29,920.00	0.05
483	000893	亚钾国际	1,300	29,822.00	0.05
484	603185	弘元绿能	400	29,820.00	0.05
485	603517	绝味食品	800	29,720.00	0.05
486	689009	九号公司	800	29,480.00	0.05
487	600863	内蒙华电	7,100	29,465.00	0.05
488	300296	利亚德	4,500	29,385.00	0.05
489	600580	卧龙电驱	1,999	29,205.39	0.05
490	603893	瑞芯微	400	29,140.00	0.05
491	002414	高德红外	3,744	29,090.88	0.05
492	002926	华西证券	3,500	29,085.00	0.05
493	002092	中泰化学	4,500	29,025.00	0.05
494	600535	天士力	2,000	29,020.00	0.05
495	600909	华安证券	6,190	28,907.30	0.05
496	601966	玲珑轮胎	1,300	28,886.00	0.05
497	600820	隧道股份	4,801	28,854.01	0.05
498	601155	新城控股	2,000	28,820.00	0.05
499	000878	云南铜业	2,600	28,730.00	0.05
500	600528	中铁工业	2,900	28,652.00	0.05
501	600025	华能水电	4,000	28,520.00	0.04
502	603195	公牛集团	296	28,433.76	0.04
503	300182	捷成股份	4,500	28,395.00	0.04
504	300595	欧普康视	940	28,378.60	0.04
505	002372	伟星新材	1,380	28,345.20	0.04
506	002595	豪迈科技	800	28,104.00	0.04
507	000039	中集集团	4,070	28,042.30	0.04
508	000750	国海证券	8,360	28,006.00	0.04

509	000547	航天发展	2,797	27,970.00	0.04
510	300682	朗新科技	1,200	27,936.00	0.04
511	600008	首创环保	9,600	27,648.00	0.04
512	002429	兆驰股份	5,000	27,500.00	0.04
513	603737	三棵树	420	27,476.40	0.04
514	000970	中科三环	2,140	27,434.80	0.04
515	603233	大参林	979	27,421.79	0.04
516	000027	深圳能源	4,140	27,282.60	0.04
517	601198	东兴证券	3,400	27,268.00	0.04
518	603712	七一二	900	27,189.00	0.04
519	000060	中金岭南	5,700	27,075.00	0.04
520	688005	容百科技	500	27,010.00	0.04
521	601880	辽港股份	17,300	26,988.00	0.04
522	600329	达仁堂	600	26,934.00	0.04
523	300957	贝泰妮	300	26,664.00	0.04
524	600369	西南证券	7,300	26,645.00	0.04
525	300363	博腾股份	900	26,631.00	0.04
526	300212	易华录	800	26,584.00	0.04
527	000830	鲁西化工	2,500	26,400.00	0.04
528	002500	山西证券	4,730	26,393.40	0.04
529	600390	五矿资本	4,900	26,362.00	0.04
530	603156	养元饮品	1,064	26,280.80	0.04
531	601717	郑煤机	2,100	26,145.00	0.04
532	600398	海澜之家	3,800	26,144.00	0.04
533	600566	济川药业	900	26,136.00	0.04
534	000636	风华高科	1,700	26,078.00	0.04
535	688561	奇安信	500	25,905.00	0.04
536	002936	郑州银行	11,203	25,766.90	0.04
537	600848	上海临港	2,156	25,764.20	0.04
538	300529	健帆生物	1,100	25,498.00	0.04
539	600606	绿地控股	9,234	25,393.50	0.04

540	300070	碧水源	4,732	25,363.52	0.04
541	603658	安图生物	490	25,347.70	0.04
542	600985	淮北矿业	2,200	25,344.00	0.04
543	603858	步长制药	1,224	25,202.16	0.04
544	300009	安科生物	2,516	25,160.00	0.04
545	300244	迪安诊断	980	25,117.40	0.04
546	688187	时代电气	600	25,116.00	0.04
547	003035	南网能源	3,500	24,920.00	0.04
548	000050	深天马 A	2,700	24,786.00	0.04
549	600021	上海电力	2,300	24,771.00	0.04
550	002244	滨江集团	2,800	24,696.00	0.04
551	601456	国联证券	2,700	24,570.00	0.04
552	002508	老板电器	970	24,531.30	0.04
553	601958	金钼股份	2,200	24,530.00	0.04
554	000155	川能动力	1,700	24,480.00	0.04
555	002572	索菲亚	1,400	24,388.00	0.04
556	688538	和辉光电	9,600	24,384.00	0.04
557	601179	中国西电	4,500	24,345.00	0.04
558	300373	扬杰科技	600	24,342.00	0.04
559	002153	石基信息	1,731	24,234.00	0.04
560	601666	平煤股份	3,200	24,128.00	0.04
561	002408	齐翔腾达	3,776	24,053.12	0.04
562	300558	贝达药业	500	24,015.00	0.04
563	002249	大洋电机	4,200	23,940.00	0.04
564	600038	中直股份	600	23,892.00	0.04
565	600673	东阳光	3,300	23,793.00	0.04
566	600895	张江高科	1,700	23,664.00	0.04
567	000887	中鼎股份	1,800	23,562.00	0.04
568	300357	我武生物	700	23,541.00	0.04
569	002019	亿帆医药	1,601	23,374.60	0.04
570	600208	新潮中宝	9,400	23,312.00	0.04

571	600667	太极实业	3,200	23,232.00	0.04
572	002155	湖南黄金	1,900	23,180.00	0.04
573	603160	汇顶科技	500	23,125.00	0.04
574	002958	青农商行	8,500	23,120.00	0.04
575	688029	南微医学	282	22,999.92	0.04
576	600435	XD北方导	2,000	22,980.00	0.04
577	002831	裕同科技	940	22,926.60	0.04
578	688065	凯赛生物	368	22,911.68	0.04
579	601000	唐山港	6,478	22,867.34	0.04
580	002670	国盛金控	2,600	22,828.00	0.04
581	600827	百联股份	1,700	22,729.00	0.04
582	600378	昊华科技	600	22,584.00	0.04
583	600282	南钢股份	6,700	22,579.00	0.04
584	002221	东华能源	2,600	22,490.00	0.04
585	002128	电投能源	1,700	22,474.00	0.04
586	600755	厦门国贸	2,900	22,446.00	0.04
587	601231	环旭电子	1,500	22,440.00	0.04
588	600959	江苏有线	6,524	22,051.12	0.03
589	002939	长城证券	2,700	21,951.00	0.03
590	300115	长盈精密	1,840	21,914.40	0.03
591	600171	上海贝岭	1,200	21,900.00	0.03
592	300026	红日药业	4,000	21,680.00	0.03
593	600517	XD国网英	3,800	21,660.00	0.03
594	603885	吉祥航空	1,400	21,602.00	0.03
595	600906	财达证券	3,000	21,600.00	0.03
596	002030	达安基因	2,158	21,515.26	0.03
597	601866	中远海发	8,700	21,489.00	0.03
598	600598	北大荒	1,600	21,328.00	0.03
599	000778	新兴铸管	5,200	21,216.00	0.03
600	000987	越秀资本	3,335	21,177.25	0.03
601	000598	兴蓉环境	3,900	21,177.00	0.03

602	300677	英科医疗	960	21,120.00	0.03
603	600316	洪都航空	900	21,105.00	0.03
604	300251	光线传媒	2,600	21,034.00	0.03
605	000709	河钢股份	9,300	21,018.00	0.03
606	600582	天地科技	3,600	20,988.00	0.03
607	603218	日月股份	1,100	20,889.00	0.03
608	601665	齐鲁银行	5,300	20,776.00	0.03
609	300776	帝尔激光	320	20,768.00	0.03
610	603883	老百姓	694	20,715.90	0.03
611	601005	重庆钢铁	14,600	20,440.00	0.03
612	002183	怡亚通	4,000	20,400.00	0.03
613	000930	中粮科技	2,512	20,347.20	0.03
614	600315	上海家化	700	20,307.00	0.03
615	688779	长远锂科	1,800	20,286.00	0.03
616	600718	东软集团	1,900	20,254.00	0.03
617	600131	国网信通	1,000	20,190.00	0.03
618	601106	中国一重	6,000	20,160.00	0.03
619	002032	苏泊尔	400	20,000.00	0.03
620	600373	中文传媒	1,500	19,980.00	0.03
621	002985	北摩高科	451	19,898.12	0.03
622	002326	永太科技	1,300	19,877.00	0.03
623	601992	金隅集团	9,100	19,838.00	0.03
624	600663	陆家嘴	2,000	19,740.00	0.03
625	000883	湖北能源	4,300	19,608.00	0.03
626	603267	鸿远电子	300	19,590.00	0.03
627	603568	伟明环保	1,118	19,576.18	0.03
628	002266	浙富控股	4,700	19,411.00	0.03
629	000825	太钢不锈	5,000	19,350.00	0.03
630	600737	中粮糖业	2,400	19,320.00	0.03
631	002690	美亚光电	750	19,312.50	0.03
632	600967	内蒙一机	1,900	19,190.00	0.03

633	002511	中顺洁柔	1,700	18,955.00	0.03
634	601778	晶科科技	3,800	18,772.00	0.03
634	600801	华新水泥	1,520	18,772.00	0.03
635	300850	新强联	500	18,690.00	0.03
636	600297	广汇汽车	8,900	18,512.00	0.03
637	002745	木林森	2,000	18,400.00	0.03
638	688116	天奈科技	400	18,300.00	0.03
639	603225	新凤鸣	1,656	18,298.80	0.03
640	688208	道通科技	602	18,246.62	0.03
641	601928	凤凰传媒	1,600	18,240.00	0.03
642	601808	中海油服	1,300	18,044.00	0.03
643	000877	天山股份	2,200	17,908.00	0.03
644	601698	中国卫通	900	17,892.00	0.03
645	601991	大唐发电	5,400	17,874.00	0.03
646	000012	南玻 A	2,990	17,820.40	0.03
647	000401	冀东水泥	2,400	17,688.00	0.03
648	600871	石化油服	8,900	17,622.00	0.03
649	000800	一汽解放	2,100	17,577.00	0.03
650	300888	稳健医疗	420	17,501.40	0.03
651	601098	XD中南传	1,500	17,400.00	0.03
651	000156	华数传媒	2,000	17,400.00	0.03
652	300861	美畅股份	400	17,348.00	0.03
653	000581	威孚高科	1,100	17,325.00	0.03
654	002468	申通快递	1,601	17,322.82	0.03
655	601718	际华集团	5,800	17,226.00	0.03
656	600500	中化国际	3,080	17,124.80	0.03
657	601118	海南橡胶	3,800	17,024.00	0.03
658	600022	山东钢铁	11,900	16,898.00	0.03
659	600155	华创云信	2,700	16,794.00	0.03
660	002250	联化科技	1,600	16,736.00	0.03
661	000785	居然之家	4,300	16,383.00	0.03

662	600764	中国海防	600	16,332.00	0.03
663	601598	中国外运	3,500	16,310.00	0.03
664	002867	周大生	900	16,002.00	0.03
665	002423	中粮资本	2,000	16,000.00	0.03
666	601608	中信重工	3,800	15,998.00	0.03
667	000089	深圳机场	2,300	15,985.00	0.03
668	600195	中牧股份	1,358	15,861.44	0.03
669	000559	万向钱潮	2,900	15,805.00	0.02
670	600597	光明乳业	1,500	15,600.00	0.02
671	600782	新钢股份	4,200	15,582.00	0.02
672	601236	红塔证券	2,090	15,570.50	0.02
673	688690	纳微科技	400	15,540.00	0.02
674	600062	华润双鹤	880	15,329.60	0.02
675	000937	冀中能源	2,400	15,312.00	0.02
676	600707	彩虹股份	3,200	15,232.00	0.02
677	600339	中油工程	3,700	15,059.00	0.02
678	600901	江苏金租	3,640	15,033.20	0.02
679	603228	景旺电子	584	14,979.60	0.02
680	600409	三友化工	2,700	14,715.00	0.02
681	000898	鞍钢股份	5,260	14,622.80	0.02
682	600259	广晟有色	400	14,456.00	0.02
683	002705	新宝股份	800	14,424.00	0.02
684	601611	中国核建	1,700	14,365.00	0.02
685	601156	东航物流	1,100	14,300.00	0.02
686	000967	盈峰环境	2,800	14,140.00	0.02
687	600095	湘财股份	1,800	14,040.00	0.02
688	000537	广宇发展	1,200	14,004.00	0.02
689	600167	联美控股	1,990	13,870.30	0.02
690	300482	万孚生物	520	13,847.60	0.02
691	600968	海油发展	4,500	13,815.00	0.02
692	600808	马钢股份	5,300	13,621.00	0.02

693	603866	桃李面包	1,343	13,591.16	0.02
694	001914	招商积余	900	13,545.00	0.02
695	600556	天下秀	1,900	13,471.00	0.02
696	002010	传化智联	2,500	13,300.00	0.02
697	002505	鹏都农牧	7,000	13,230.00	0.02
698	000563	陕国投 A	4,330	13,206.50	0.02
699	603650	彤程新材	400	13,120.00	0.02
700	002081	金螳螂	2,900	13,079.00	0.02
701	601568	北元集团	2,480	13,069.60	0.02
702	600126	杭钢股份	2,980	12,933.20	0.02
703	300257	开山股份	800	12,136.00	0.02
704	000959	首钢股份	3,400	11,900.00	0.02
705	002925	盈趣科技	610	11,834.00	0.02
706	002653	海思科	500	11,800.00	0.02
707	600507	方大特钢	2,540	11,760.20	0.02
708	000402	金融街	2,600	11,752.00	0.02
709	002110	三钢闽光	2,750	11,605.00	0.02
710	000415	渤海租赁	5,400	11,340.00	0.02
711	601869	长飞光纤	300	11,103.00	0.02
712	600377	宁沪高速	1,100	10,813.00	0.02
713	301029	怡合达	240	10,723.20	0.02
714	002563	森马服饰	1,700	10,574.00	0.02
715	601187	厦门银行	2,100	10,542.00	0.02
716	601298	青岛港	1,500	10,455.00	0.02
717	603317	天味食品	703	10,270.83	0.02
718	000031	大悦城	2,800	10,248.00	0.02
719	600928	西安银行	2,900	10,208.00	0.02
720	600623	华谊集团	1,600	9,968.00	0.02
721	601139	深圳燃气	1,300	9,477.00	0.01
722	603056	德邦股份	600	9,252.00	0.01
723	002399	海普瑞	800	9,176.00	0.01

724	001289	龙源电力	400	9,000.00	0.01
725	600350	山东高速	1,400	8,918.00	0.01
726	601228	广州港	2,700	8,721.00	0.01
727	001872	招商港口	500	8,635.00	0.01
728	688006	杭可科技	281	8,562.07	0.01
729	601969	海南矿业	1,300	8,554.00	0.01
730	603379	三美股份	360	8,463.60	0.01
731	002945	华林证券	600	8,208.00	0.01
732	000553	安道麦A	900	7,596.00	0.01
733	603355	莱克电气	280	7,114.80	0.01
734	600927	永安期货	400	6,504.00	0.01
735	300741	华宝股份	300	6,426.00	0.01
736	600299	安迪苏	800	6,376.00	0.01
737	001203	大中矿业	500	5,555.00	0.01
738	601828	美凯龙	1,150	5,508.50	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	603707	健友股份	1,063,676.42	1.72
2	600216	浙江医药	903,386.00	1.46
3	600511	国药股份	776,085.00	1.25
4	000400	许继电气	662,219.00	1.07
5	601689	拓普集团	467,188.00	0.76
6	601233	桐昆股份	449,763.00	0.73
7	601607	上海医药	355,794.00	0.58

8	000932	华菱钢铁	353,977.00	0.57
9	600519	贵州茅台	334,103.00	0.54
10	300750	宁德时代	291,613.20	0.47
11	002001	新和成	269,282.00	0.44
12	000739	普洛药业	250,246.00	0.40
13	600893	航发动力	247,521.00	0.40
14	000513	丽珠集团	238,283.00	0.39
15	002252	上海莱士	218,637.00	0.35
16	300274	阳光电源	188,654.00	0.30
17	603501	韦尔股份	178,691.00	0.29
18	688981	中芯国际	161,056.85	0.26
19	688301	奕瑞科技	160,766.75	0.26
20	600104	上汽集团	150,172.00	0.24

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	600216	浙江医药	793,661.00	1.28
2	601233	桐昆股份	432,312.00	0.70
3	600519	贵州茅台	370,154.00	0.60
4	603707	健友股份	318,127.00	0.51
5	300750	宁德时代	294,998.00	0.48
6	000661	长春高新	268,247.00	0.43
7	002001	新和成	254,414.00	0.41
8	002007	华兰生物	199,494.00	0.32
9	300274	阳光电源	187,902.00	0.30
10	300363	博腾股份	179,287.00	0.29

11	603259	药明康德	173,368.00	0.28
12	300630	普利制药	159,889.18	0.26
13	600104	上汽集团	156,747.84	0.25
14	688599	天合光能	154,608.40	0.25
15	603501	韦尔股份	146,079.85	0.24
16	601607	上海医药	128,268.00	0.21
17	000513	丽珠集团	123,597.00	0.20
18	688981	中芯国际	123,378.77	0.20
19	603225	新凤鸣	115,890.00	0.19
20	600036	招商银行	109,590.00	0.18

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	12,452,497.27
卖出股票收入（成交）总额	10,975,166.17

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【兴业银行股份有限公司】分别于**2022年09月09日、2022年09月28日**收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报，于**2023年06月14日**收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具责令改正、公开处罚的通报；**【招商银行股份有限公司】**于**2022年08月31日**收到中国人民银行出具公开批评、公开处罚的通报，于**2022年09月09日**收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；**【中国平安保险(集团)股份有限公司】**于**2022年08月22日**收到国家外汇管理局深圳市分局出具罚款处罚、警告、责令改正的通报。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,816.25
2	应收清算款	87,505.48
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	72,369.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	169,691.64

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800A	3,639	6,749.88	2,499,805.49	10.18%	22,062,995.16	89.82%
天弘中证800C	3,382	9,368.71	12,890,750.89	40.68%	18,794,232.68	59.32%
合计	6,888	8,166.05	15,390,556.38	27.36%	40,857,227.84	72.64%

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	占基金总份额比
----	------	--------	---------

		(份)	例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天弘中证800A	18,555.40	0.08%
	天弘中证800C	2,086.32	0.01%
	合计	20,641.72	0.04%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	天弘中证800A	0
	天弘中证800C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证800A	0
	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	23,126,849.74	32,093,180.06
本报告期基金总申购份额	4,323,652.73	12,666,084.44
减：本报告期基金总赎回份额	2,887,701.82	13,074,280.93
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	24,562,800.65	31,684,983.57

§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，童建林先生任职公司风控负责人，刘荣逵先生任职公司首席信息官，马文辉先生任职公司财务负责人，朱海扬先生不再担任公司副总经理，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》。

在本报告截止日至报告批准送出日之间，韩歆毅先生代任公司总经理，郭树强先生不再担任公司总经理，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，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，无涉及公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方财富证券	2	23,206,597.06	100.00%	10,009.85	100.00%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务。

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

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方财富证券	34,617.41	92.76%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	2,700.00	7.24%	-	-	-	-	-	-

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2022年第4季	中国证监会规定媒介	2023-01-28

	度报告		
2	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	2023-03-24
3	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
4	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-01
5	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-23

§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	20230101-20230630	12,890,750.89	-	-	12,890,750.89	22.92%
产品特有风险							
<p>基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 时，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>(1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；</p> <p>(2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；</p> <p>(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；</p>							

(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；

(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

注：份额占比精度处理方式四舍五入。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日