苏新中证800自由现金流指数型证券投资基金

2026年第3季度报告

2026年09月30日

基金管理人:苏新基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

报告送出日期:2026年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	苏新中证 800 自由现金流指数
基金主代码	024624
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 08 月 04 日
报告期末基金份额总额	214,726,551.07 份
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证 800 自由现金流指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。在条件允许的情况下，本基金也可以适当参与中证 800 自由现金流指数所包含指数成份股以外的其他个股（非标的指数成份股及备选成份股），以更好地跟踪指数。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。本基金的投资策略主要包括：股票（含存托凭证）投资策略、债券投资策略、股指期货交易策略、资产支持证券投

	资策略、可转换债券与可交换债券投资策略、参与转融通证券出借业务策略。	
业绩比较基准	中证 800 自由现金流指数收益率*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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	苏新基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	苏新中证 800 自由现金流指数 A	苏新中证 800 自由现金流指数 C
下属分级基金的交易代码	024624	024625
报告期末下属分级基金的份额总额	113,487,728.53 份	101,238,822.54 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）	
	苏新中证 800 自由现金流指数 A	苏新中证 800 自由现金流指数 C
1.本期已实现收益	-1,484,328.78	-1,486,353.97
2.本期利润	5,203,126.16	4,057,782.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0447	0.0406
4.期末基金资产净值	114,810,183.28	101,945,503.90
5.期末基金份额净值	1.0117	1.0070

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，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。

3.2 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

苏新中证 800 自由现金流指数 A 净值表现

阶段	净值增长率①	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	4.39%	0.97%	2.72%	0.98%	1.67%	-0.01%

过去六个月	-11.59%	0.92%	-13.73%	0.93%	2.14%	-0.01%
过去一年	-0.42%	0.98%	-2.49%	0.99%	2.07%	-0.01%
自基金合同生效起至今	1.17%	0.93%	4.75%	0.98%	-3.58%	-0.05%

苏新中证 800 自由现金流指数 C 净值表现

阶段	净值增长率①	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	4.28%	0.96%	2.72%	0.98%	1.56%	-0.02%
过去六个月	-11.77%	0.92%	-13.73%	0.93%	1.96%	-0.01%
过去一年	-0.82%	0.98%	-2.49%	0.99%	1.67%	-0.01%
自基金合同生效起至今	0.70%	0.93%	4.75%	0.98%	-4.05%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：本基金合同于 2025 年 8 月 4 日生效，按照基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林茂政	指数及量化业务管理部-基金经理	2025-08-04	-	7 年	香港科技大学理学硕士，具有基金从业资格。2019 年 7 月进入平安证券股份有限公司资产管理部任投资经理助理。2020 年 5 月起任上海千象资产管理有限公司股票量化研究员。2020 年 12 月起先后任国海证券股份有限公司证券资产管理分公司投资分析员、投资经理。2024 年 4 月起进入苏新基金管理有限公司工作。2024 年 12 月至今任苏新中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。2025 年 3 月至今任苏新中证 A500 指数增强型

					证券投资基金基金经理。2025 年 5 月至今任苏新上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。2025 年 8 月至今任苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金基金经理。2025 年 11 月至今任苏新睿见量化选股股票型证券投资基金基金经理。2026 年 5 月至今任苏新睿哲量化选股混合型证券投资基金基金经理。2026 年 6 月至今任苏新中证 800 指数增强型证券投资基金基金经理。2026 年 7 月至今任苏新睿盈量化选股股票型证券投资基金基金经理。
鲍浩政	指数及量化业务管理部-基金经理	2026-07-03	-	6 年	上海财经大学金融硕士，具有基金从业资格。2020 年 7 月进入上银基金管理有限公司任助理研究员。2022 年 4 月起进入高盛咨询（北京）有限公司上海分公司从事量化研究工作。2022 年 8 月起在高盛工银理财有限责任公司历任量化研究员、量化研究员/备岗投资经理。2025 年 9 月起进入苏新基金管理有限公司工作，历任权益投资部基金经理助理、指数及量化业务管理部基金经理助理。2026 年 7 月至今任苏新中证 A500 指数增强型证券投资基金、苏新上证科创板综合指数增强型证券投资基金、苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则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，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《苏新基金管理有限公司公平交易管理办法》，涵盖了投资研究、交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合。公司通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现，同时，对公平交易的过程和结果进行监督。本报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易制度，公平对待各投资组合，不存在不公平交易和利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量 5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，A 股市场呈现"高位回落、成长补跌、防御占优"的格局。二季度科技成长板块的强势上涨在三季度遭遇大幅调整，市场风险偏好显著收缩，主要指数普遍下跌，前期涨幅居前的成长板块跌幅居前。指数表现方面，上证指数三季度下跌 6.16%，表现相对抗跌；沪深 300 下跌 12.49%，万得全 A 下跌 13.33%。中小盘成长指数跌幅显著，中证 500 和中证 1000 分别下跌 17.67%和 17.15%。前期涨幅较大的科技成长板块成为重灾区，科创综指和创业板指分别下跌 27.98%和 27.80%，成长风格与大盘价值之间的分化在三季度出现明显收敛乃至逆转。市场成交额较二季度明显回落。三季度累计成交额达 147.91 万亿元，日均成交额 2.28 万亿元，较二季度日均 2.88 万亿元明显缩量，市场活跃度有所降温，资金避险情绪升温。行业层面，市场风格发生显著切换。前期强势的科技板块集体补跌，半导体产品、半导体材料与设备、通信设备、电脑与外围设备等板块跌幅居前，相比之下，防御性与部分周期板块表现相对占优，生命科学工具和服务、房地产服务、综合消费者服务、石油天然气等板块逆势上涨，市场呈现明显的"高低切换"特征。

本基金采用指数化投资策略，在紧密跟踪中证 800 自由现金流指数的基础上，力争跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末苏新中证 800 自由现金流指数 A 基金份额净值为 1.0117 元，本报告期内，该类基

金份额净值增长率为 4.39%，同期业绩比较基准收益率为 2.72%；截至报告期末苏新中证 800 自由现金流指数 C 基金份额净值为 1.0070 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.28%，同期业绩比较基准收益率为 2.72%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	204,169,956.17	93.91
	其中：股票	204,169,956.17	93.91
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	12,295,239.35	5.66
8	其他资产	946,751.25	0.44
9	合计	217,411,946.77	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	30,451,931.00	14.05
C	制造业	121,117,498.90	55.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,799,448.00	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	12,116,136.00	5.59
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,494,059.00	15.91
J	金融业	991,926.15	0.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,391,961.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	203,362,960.05	93.82

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	26,258.01	0.01
C	制造业	780,738.11	0.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	806,996.12	0.37

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	600938	中国海油	627,900	20,984,418.00	9.68
2	601728	中国电信	3,266,100	20,511,108.00	9.46
3	600519	贵州茅台	15,700	19,760,334.00	9.12
4	600104	上汽集团	1,345,000	14,633,600.00	6.75
5	601600	中国铝业	1,229,200	10,976,756.00	5.06
6	000651	格力电器	279,500	10,699,260.00	4.94
7	600050	中国联通	2,174,700	9,198,981.00	4.24
8	601877	正泰电器	326,900	8,156,155.00	3.76
9	601633	长城汽车	584,718	8,028,178.14	3.70
10	000338	潍柴动力	307,800	7,725,780.00	3.56

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	301716	鸿富诚	415	235,791.64	0.11
2	301666	大普微	418	138,416.52	0.06
3	301686	中塑股份	506	81,266.69	0.04
4	001246	力勤资源	1,292	78,276.28	0.04
5	301569	联亚药业	6,027	42,189.00	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	946,751.25
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	946,751.25

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301666	大普微	138,416.52	0.06	网下新股限售
2	301569	联亚药业	42,189.00	0.02	新股未上市
3	001246	力勤资源	19,434.92	0.01	网下新股限售
4	301716	鸿富诚	16,989.84	0.01	网下新股限售
5	301686	中塑股份	5,818.59	0.00	网下新股限售

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	苏新中证 800 自由现金流指数 A	苏新中证 800 自由现金流指数 C
报告期期初基金份额总额	122,346,630.54	101,737,773.39
报告期期间基金总申购份额	20,924,488.02	17,057,893.60
减：报告期期间基金总赎回份额	29,783,390.03	17,556,844.45
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	113,487,728.53	101,238,822.54

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

注：无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金基金合同

2、苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金托管协议

3、苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金招募说明书

4、关于准予苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金注册的批复

5、报告期内披露的各项公告

6、法律法规要求备查的其他文件

9.2 存放地点

苏新基金管理有限公司办公地点：上海市虹口区公平路 18 号 1 栋 6 楼。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（www.susingfund.com）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

咨询电话：400-622-8862

苏新基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日