

苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金

2026 年第 2 季度报告

2026 年 06 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 07 月 21 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7月20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4月1日起至6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	224,084,403.93 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

	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	122,346,630.54 份	101,737,773.39 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 04 月 01 日-2026 年 06 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	-13,326,391.76	-9,992,581.18
2. 本期利润	-27,458,450.55	-20,928,145.02
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1739	-0.1762
4. 期末基金资产净值	118,575,849.14	98,245,875.36
5. 期末基金份额净值	0.9692	0.9657

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	-15.30%	0.83%	-16.02%	0.84%	0.72%	-0.01%
过去六个月	-11.36%	1.05%	-11.44%	1.06%	0.08%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-3.08%	0.93%	1.98%	0.98%	-5.06%	-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	-15.39%	0.83%	-16.02%	0.84%	0.63%	-0.01%
过去六个月	-11.53%	1.05%	-11.44%	1.06%	-0.09%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-3.43%	0.92%	1.98%	0.98%	-5.41%	-0.06%

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

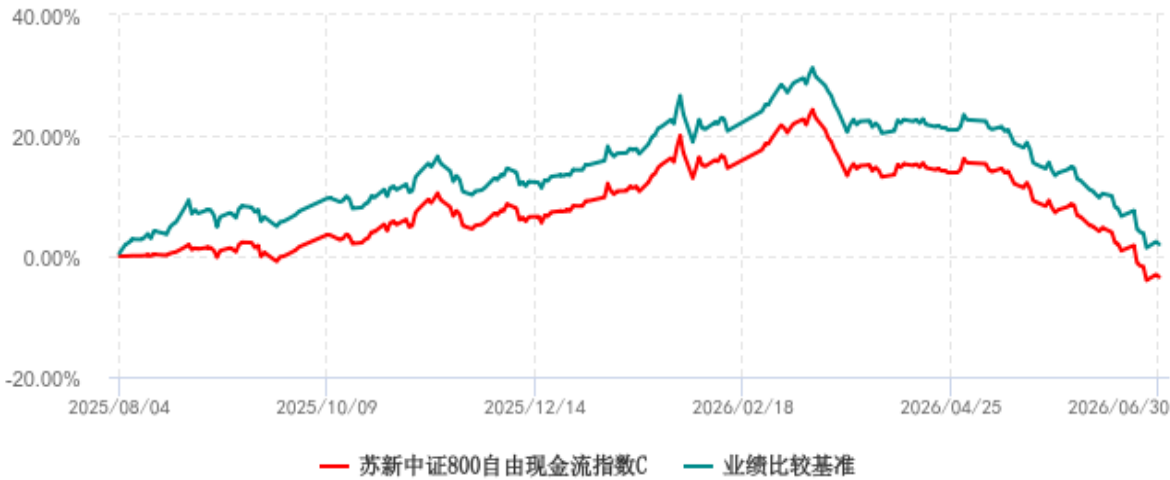
苏新中证800自由现金流指数A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025年08月04日-2026年06月30日)



苏新中证800自由现金流指数C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025年08月04日-2026年06月30日)



注：本基金合同于 2025 年 8 月 4 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；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。
--	--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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 年二季度，A 股市场主要指数呈现“科技主导，分化明显”的格局。上证指数在 4 月 1 日以 3939.57 点开盘，二季度末收于 4094.40 点，季度上涨 5.20%；科创综指与创业板指分别上涨 55.71% 和 36.35%，显著跑赢上证指数。市场成交额较一季度明显提升，二季度累计成交额达 173.02 万亿元，日均成交额 2.88 万亿元，较一季度日均 2.58 万亿元进一步放量，显示市场活跃度持续维持在高位。行业层面，市场风格延续结构性分化，电子和通讯板块强势领涨，建筑材料与机械设备亦有一定涨幅，相比之下，消费板块整体表现相对疲软，石油石化、农林牧渔等周期板块跌幅居前。

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 0.9692 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.30%，同期业绩比较基准收益率为-16.02%；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 0.9657 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.39%，同期业绩比较基准收益率为-16.02%。

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	204,486,480.92	92.07
	其中：股票	204,486,480.92	92.07
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	16,889,433.62	7.60

8	其他资产	729,048.74	0.33
9	合计	222,104,963.28	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	27,153,277.00	12.52
C	制造业	145,764,639.42	67.23
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	4,884,361.00	2.25
G	交通运输、仓储和邮政业	10,627,147.16	4.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,216,605.00	4.25
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,443,832.00	2.97
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	204,089,861.58	94.13

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	23,643.60	0.01
C	制造业	371,392.28	0.17
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	1,583.46	0.00
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	396,619.34	0.18

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	000651	格力电器	539,800	20,242,500.00	9.34
2	601633	长城汽车	1,233,618	18,615,295.62	8.59
3	000100	TCL 科技	2,953,800	17,191,116.00	7.93
4	600938	中国海油	603,200	16,376,880.00	7.55
5	601600	中国铝业	1,519,400	12,489,468.00	5.76
6	002415	海康威视	347,200	11,874,240.00	5.48
7	601877	正泰电器	446,500	11,193,755.00	5.16
8	600031	三一重工	421,500	7,283,520.00	3.36
9	000708	中信特钢	566,500	7,149,230.00	3.30
10	688599	天合光能	304,800	4,303,776.00	1.98

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	301666	大普微	418	193,671.94	0.09
2	301682	宏明电子	240	38,414.40	0.02
3	001257	盛龙股份	1,140	23,643.60	0.01
4	603459	红板科技	185	15,599.20	0.01
5	301669	高特电子	546	15,506.40	0.01

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，天合光能（688599.SH）在报告编制日前一年内曾受到

监管机构的处罚或警示。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规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	729,048.74
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	729,048.74

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	193,671.94	0.09	网下新股限售
2	301682	宏明电子	38,414.40	0.02	网下新股限售
3	001257	盛龙股份	23,643.60	0.01	网下新股限售
4	603459	红板科技	15,599.20	0.01	网下新股限售
5	301669	高特电子	15,506.40	0.01	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	138,029,314.37	103,798,326.11
报告期期间基金总申购份额	94,768,861.99	75,698,296.47
减：报告期期间基金总赎回份额	110,451,545.82	77,758,849.19
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	122,346,630.54	101,737,773.39

§ 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
二〇二六年七月二十一日