

苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金

2026 年中期报告

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 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8月28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1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39
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	39
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	39
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	39
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	39

§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	43
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	43
10.8 其他重大事件	44
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
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	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	44
§ 12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	45
12.3 查阅方式	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	224,084,403.93 份	
基金合同存续期	不定期	
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

2.2 基金产品说明

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。
--	--

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		苏新基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张玉梅	罗琦
	联系电话	021-60160867	020-66338888
	电子邮箱	zhangym002@susingfund.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		400-622-8862	95575
传真		021-61390352	020-87553363-6847
注册地址		中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路728号20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		上海市虹口区公平路18号-1栋6层	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
邮政编码		200082	510627
法定代表人		卢凯	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	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.susingfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	苏新基金管理有限公司	上海市虹口区公平路18号-1栋6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）	
	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
本期已实现收益	3,328,568.34	4,113,986.46
本期利润	-19,969,888.07	-13,014,167.57
加权平均基金份额本期利润	-0.1357	-0.1093

本期加权平均净值利润率	-12.02%	-9.69%
本期基金份额净值增长率	-11.36%	-11.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-3,770,781.40	-3,491,898.03
期末可供分配基金份额利润	-0.0308	-0.0343
期末基金资产净值	118,575,849.14	98,245,875.36
期末基金份额净值	0.9692	0.9657
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-3.08%	-3.43%

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

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，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

苏新中证 800 自由现金流指数 A 净值表现

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	-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	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	-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

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

苏新基金管理有限公司是苏州银行股份有限公司联合 CapitalLand Fund Management Pte. Ltd.（凯德基金管理有限公司）和苏州工业园区经济发展有限公司共同发起设立的基金公司，注册资本人民币 3 亿元。苏州银行出资额 1.68 亿元，出资比例 56%；凯德基金出资额 7200 万元，出资比例 24%；苏州工业园区经济发展有限公司出资额 6000 万元，出资比例 20%。

苏新基金于 2022 年 11 月 25 日获得中国证监会《关于核准设立苏新基金管理有限公司的批复》，于 2023 年 2 月 6 日取得营业执照，正式组建成立，并于 2024 年 4 月 22 日取得中国证监会核发的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。

截至 2026 年 6 月 30 日，公司旗下管理 10 只证券投资基金。

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		
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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：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 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

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 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

2026 年上半年，A 股市场呈现“科技主导、分化明显”的格局。一季度市场整体偏弱波动，二季度在科技产业趋势催化下风险偏好显著提升，成长风格占优，主要指数普遍收涨。指数表现方面，上证指数上半年累计上涨 3.16%；科创综指上半年表现突出，二季度单季大幅上涨 55.71%，成为市场较亮眼的指数。中小盘成长同样表现强劲，中证 500 和中证 1000 上半年分别上涨 20.97%和 15.99%，万得全 A 上涨 11.52%；而上证 50 逆势下跌 1.38%，大小盘风格剪刀差较大。成交活跃度方面，上半年市场成交额维持高位并逐季放量。一季度累计成交额 144.51 万亿元，日均成交额

2.58 万亿元；二季度累计成交额 173.02 万亿元，日均成交额 2.88 万亿元，较一季度增长约 11.6%。上半年全市场累计成交额约 317.53 万亿元，日均成交额约 2.73 万亿元，市场活跃度持续维持在历史较高水平。行业层面，市场风格延续结构性分化。电子和通讯板块在二季度强势领涨，叠加一季度能源设备与服务、煤炭及消费用燃料的优异表现，科技与部分周期资源品成为上半年主线。相比之下，消费板块贯穿一二季度整体疲软，石油石化、农林牧渔等周期板块在二季度跌幅居前。

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。

4.4.2 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-11.36%，同期业绩比较基准收益率为-11.44%；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-11.53%，同期业绩比较基准收益率为-11.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，A 股市场可能会从上半年的“分化明显”逐步走向“适度收敛”。上半年科技成长风格累计涨幅较大，科创综指单季涨幅超过 55%，部分赛道交易拥挤度已处于历史高位，7 月初的快速调整也印证了高集中度下的脆弱性。随着中报业绩窗口开启，市场关注点有望从单纯的主题驱动转向业绩验证，具备真实盈利支撑的科技龙头与估值处于低位的价值板块均可能迎来再平衡机会。流动性方面，上半年日均成交额维持在较高水平，居民资产配置向权益市场转移的趋势未变，这为市场提供了相对充裕的增量资金。但我们 also 注意到，海外货币政策节奏、国内经济复苏斜率等变量仍存在不确定性，市场波动率可能维持在偏高水平。

策略层面，我们将在保持量化模型纪律性的基础上，适度控制单一风格因子的暴露度，加强对风格因子拥挤度及配置权重的监控，以提升组合在不同市场环境下的适应性，力争在控制风险的前提下为持有人创造长期超额收益。

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。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。本基金管理人建立估值决策委员会，负责建立健全估值决策体系，配备有投资、研究、交易、会计、风控和合规等岗位的资深人员。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责

任。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。

本报告期内，上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、《基金合同》的约定以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

无。

§ 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，本基金托管人在对苏新中证 800 自由现金流指数型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，苏新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真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对苏新基金管理有限公司编制和披露的苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金 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：苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金

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	16,889,433.62	27,434,993.04
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	204,486,480.92	376,529,640.17
其中：股票投资		204,486,480.92	376,529,640.17
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证 券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		729,048.74	32,601,602.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		222,104,963.28	436,566,235.95
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		-	-
应付赎回款		5,025,411.55	10,973,619.58
应付管理人报酬		110,085.02	183,959.39
应付托管费		22,016.98	36,791.86
应付销售服务费		37,991.52	57,989.81
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	87,733.71	47,500.00
负债合计		5,283,238.78	11,299,860.64

净资产：			
实收基金	6.4.7.7	224,084,403.93	389,238,796.01
未分配利润	6.4.7.8	-7,262,679.43	36,027,579.30
净资产合计		216,821,724.50	425,266,375.31
负债和净资产总计		222,104,963.28	436,566,235.95

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 224,084,403.93 份。其中苏新中证 800 自由现金流指数 A 基金份额净值 0.9692 元，基金份额总额 122,346,630.54 份；苏新中证 800 自由现金流指数 C 基金份额净值 0.9657 元，基金份额总额 101,737,773.39 份。

2、本基金合同于 2025 年 8 月 4 日生效。

6.2 利润表

会计主体：苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金

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
一、营业总收入		-31,717,297.72
1. 利息收入		68,249.89
其中：存款利息收入	6.4.7.9	68,249.89
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）		8,583,948.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,626,402.14
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
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	2,957,546.31
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	-40,426,610.44
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	57,114.38
减：二、营业总支出		1,266,757.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	750,402.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	150,080.53
3. 销售服务费		269,711.82
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	96, 562. 71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-32, 984, 055. 64
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-32, 984, 055. 64
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-32, 984, 055. 64

6.3 净资产变动表

会计主体：苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金

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	389, 238, 796. 01	36, 027, 579. 30	425, 266, 375. 31
二、本期期初净资产	389, 238, 796. 01	36, 027, 579. 30	425, 266, 375. 31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-165, 154, 392. 08	-43, 290, 258. 73	-208, 444, 650. 81
（一）、综合收益总额	-	-32, 984, 055. 64	-32, 984, 055. 64
（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）	-165, 154, 392. 08	-10, 306, 203. 09	-175, 460, 595. 17
其中：1. 基金申购款	316, 771, 974. 07	49, 302, 637. 08	366, 074, 611. 15
2. 基金赎回款	-481, 926, 366. 15	-59, 608, 840. 17	-541, 535, 206. 32
（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	224, 084, 403. 93	-7, 262, 679. 43	216, 821, 724. 50

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：

卢凯	曹秋荣	陶浩然
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

苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金（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[2025]1148 号文《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》准予注册，由基金管理人苏新基金管理有限公司向社会公开募集。本基金募集期间为 2025 年 7 月 21 日起至 2025 年 7 月 31 日，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,297,861,056.38 元，在募集期间产生的利息为人民币 341,135.33 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,298,202,191.71 元，折合 1,298,202,191.71 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2025）验字第 80012827_B04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，基金合同于 2025 年 8 月 4 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为苏新基金管理有限公司，注册登记机构为苏新基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括中证 800 自由现金流指数的成份股（含存托凭证）及备选成份股（含存托凭证）、其他股票（含创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可根据法律法规和基金合同的约定，参与融资融券业务中的融资业务及转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：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%

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颁布的《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〉》、《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颁布的其他相关规定。

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于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.6.2、增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及财

政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品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，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。

6.4.6.3、城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

6.4.6.4、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.5、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2015〕101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	2,581,710.33
等于：本金	2,579,658.18
加：应计利息	2,052.15
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	14,307,723.29
等于：本金	14,307,503.53
加：应计利息	219.76
减：坏账准备	-
合计	16,889,433.62

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	226,836,259.96	-	204,486,480.92	-22,349,779.04
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	226,836,259.96	-	204,486,480.92	-22,349,779.04

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 其他资产

注：无。

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	87,562.71
其他应付	171.00
合计	87,733.71

6.4.7.7 实收基金

苏新中证 800 自由现金流指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	205,073,363.91	205,073,363.91
本期申购	180,587,645.37	180,587,645.37
本期赎回（以“-”号填列）	-263,314,378.74	-263,314,378.74
本期末	122,346,630.54	122,346,630.54

苏新中证 800 自由现金流指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	184,165,432.10	184,165,432.10
本期申购	136,184,328.70	136,184,328.70
本期赎回（以“-”号填列）	-218,611,987.41	-218,611,987.41

本期末	101,737,773.39	101,737,773.39
-----	----------------	----------------

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

苏新中证 800 自由现金流指数 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,504,979.09	2,649,356.04	19,154,335.13
本期期初	16,504,979.09	2,649,356.04	19,154,335.13
本期利润	3,328,568.34	-23,298,456.41	-19,969,888.07
本期基金份额交易产生的变动数	-5,944,845.03	2,989,616.57	-2,955,228.46
其中：基金申购款	31,048,970.50	-2,823,479.32	28,225,491.18
基金赎回款	-36,993,815.53	5,813,095.89	-31,180,719.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,888,702.40	-17,659,483.80	-3,770,781.40

苏新中证 800 自由现金流指数 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,494,956.97	2,378,287.20	16,873,244.17
本期期初	14,494,956.97	2,378,287.20	16,873,244.17
本期利润	4,113,986.46	-17,128,154.03	-13,014,167.57
本期基金份额交易产生的变动数	-7,464,545.43	113,570.80	-7,350,974.63
其中：基金申购款	22,979,945.62	-1,902,799.72	21,077,145.90
基金赎回款	-30,444,491.05	2,016,370.52	-28,428,120.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,144,398.00	-14,636,296.03	-3,491,898.03

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	64,726.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,523.54
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	68,249.89

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

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	662,553,709.88
减：卖出股票成本总额	656,287,161.74
减：交易费用	640,146.00
买卖股票差价收入	5,626,402.14

6.4.7.11 债券投资收益

注：无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：无。

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	2,957,546.31
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	2,957,546.31

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	-40,426,610.44
——股票投资	-40,426,610.44
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—

2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-40,426,610.44

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	56,892.69
转换费收入	221.69
合计	57,114.38

6.4.7.18 信用减值损失

注：无。

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	23,555.34
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	13,500.00
合计	96,562.71

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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

本基金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
苏新基金管理有限公司（以下简称“苏新基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）	基金托管人、基金销售机构
苏州银行股份有限公司（以下简称“苏州银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
CapitaLand Fund Management Pte. Ltd.（凯德基金管理有限公司）	基金管理人的股东
苏州工业园区经济发展有限公司	基金管理人的股东
东吴证券股份有限公司（以下简称“东吴证券”）	其他关联方、基金销售机构

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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东吴证券	272,910,717.89	23.00%

6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券交易

注：无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 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
东吴证券	53,516.71	23.00%	-	-

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，以扣除由中国证券登记结算

有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、本基金采用券商结算模式，券商不为本基金提供证券研究综合服务，其为本基金提供的服务按中国证监会相关规定执行。

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
当期发生的基金应支付的管理费	750,402.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	335,322.97
应支付基金管理人的净管理费	415,079.89

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50%的年费率计提。

计算方法如下：

$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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
当期发生的基金应支付的托管费	150,080.53

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。

计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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		
	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	合计
苏州银行	-	100,679.24	100,679.24
东吴证券	-	23,599.13	23,599.13
广发证券	-	50,353.98	50,353.98
合计	-	174,632.35	174,632.35

注：基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。计算方法如下

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

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	
	期末余额	当期利息收入
广发证券	2,581,710.33	64,726.35

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

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：股票										
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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301666	大普微	2026 年 04 月 08 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	46.08	463.33	418	19,261.44	193,671.94	-
301682	宏明电子	2026 年 03 月 18 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	69.66	160.06	240	16,718.40	38,414.40	-
001257	盛龙股份	2026 年 03 月 24 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	7.82	20.74	1,140	8,914.80	23,643.60	-
603459	红板科技	2026 年 03 月 31 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	17.70	84.32	185	3,274.50	15,599.20	-
301669	高特电子	2026 年 06 月 02 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301696	三瑞智能	2026 年	1-6 个月	网下新股	24.68	86.80	178	4,393.04	15,450.40	-

		03 月 31 日	(含)	限售						
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	1-6 个 月 (含)	网下 新股 限售	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301531	春光集团	2026 年 04 月 28 日	1-6 个 月 (含)	网下 新股 限售	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 04 月 22 日	1-6 个 月 (含)	网下 新股 限售	13.91	32.47	346	4,812.86	11,234.62	-
001365	天海电子	2026 年 05 月 11 日	1-6 个 月 (含)	网下 新股 限售	27.19	31.31	294	7,993.86	9,205.14	-
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	1-6 个 月 (含)	网下 新股 限售	30.38	38.99	206	6,258.28	8,031.94	-
301683	慧谷新材	2026 年 03 月 24 日	1-6 个 月 (含)	网下 新股 限售	78.38	121.77	59	4,624.42	7,184.43	-
301513	尚水智能	2026 年 04 月	1-6 个 月 (含)	网下 新股 限售	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-

		10 日								
001237	惠康 科技	2026 年 05 月 15 日	1-6 个 月 (含)	网下 新股 限售	53.26	58.74	119	6,337.94	6,990.06	-
601112	振石 股份	2026 年 01 月 21 日	1-6 个 月 (含)	网下 新股 限售	11.18	17.59	286	3,197.48	5,030.74	-
603352	至信 股份	2026 年 01 月 08 日	1-6 个 月 (含)	网下 新股 限售	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰 克	2026 年 04 月 09 日	1-6 个 月 (含)	网下 新股 限售	33.49	33.93	51	1,707.99	1,730.43	-
001312	福恩 股份	2026 年 04 月 14 日	1-6 个 月 (含)	网下 新股 限售	18.38	16.78	103	1,893.14	1,728.34	-
603284	林平 发展	2026 年 02 月 03 日	1-6 个 月 (含)	网下 新股 限售	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟 股份	2026 年 01 月 27 日	1-6 个 月 (含)	网下 新股 限售	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要有信用风险、流动性风险及市场风险等。本基金的基金管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理职能部门以及各个部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为本部门风险控制的第一责任人，投资组合经理是相应投资组合风险控制的第一责任人。公司全体员工是本岗位风险控制的直接责任人，负责具体风险控制职责的实施。本基金的基金管理人设立风险控制职能部门，负责执行公司风险管理战略和决策，对投资组合的风险进行独立地监控、评估及报告。

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。本基金的银行存款存放于信用良好的银行。本基金对现券交易对手方采用黑名单方式管理，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约可能性较小；在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，同时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严格的债券库制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险主要来自于基金份额持有人要求赎回其持有的基金份额，因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。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采取了一系列管理措施，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金进行流动性风险管理。本基金的基金管理人采用监控投资组合资产持仓集中度、流动性受限资产比例、7 个工作日可变现资产与净资产比例等方式防范流动性风险。此外，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金持有的资产主要为银行存款、股票等，其中银行存款主要为活期存款，股票主要为在交易所公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。

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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动现金流在很大程度上独立于市场利率变化。

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	16,889,433.62	-	-	-	16,889,433.62
交易性金融	-	-	-	204,486,480.92	204,486,480.92

资产					
应收申购款	-	-	-	729,048.74	729,048.74
资产总计	16,889,433.62	-	-	205,215,529.66	222,104,963.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,025,411.55	5,025,411.55
应付管理人报酬	-	-	-	110,085.02	110,085.02
应付托管费	-	-	-	22,016.98	22,016.98
应付销售服务费	-	-	-	37,991.52	37,991.52
其他负债	-	-	-	87,733.71	87,733.71
负债总计	-	-	-	5,283,238.78	5,283,238.78
利率敏感度缺口	16,889,433.62	-	-	199,932,290.88	216,821,724.50
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	27,434,993.04	-	-	-	27,434,993.04
交易性金融资产	-	-	-	376,529,640.17	376,529,640.17
应收申购款	-	-	-	32,601,602.74	32,601,602.74
资产总计	27,434,993.04	-	-	409,131,242.91	436,566,235.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,973,619.58	10,973,619.58
应付管理人报酬	-	-	-	183,959.39	183,959.39
应付托管费	-	-	-	36,791.86	36,791.86
应付销售服务费	-	-	-	57,989.81	57,989.81
其他负债	-	-	-	47,500.00	47,500.00
负债总计	-	-	-	11,299,860.64	11,299,860.64
利率敏感度缺口	27,434,993.04	-	-	397,831,382.27	425,266,375.31

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债券资产（不含可转债、可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。本基金所面临的其他价格风险可能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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

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	204,486,480.92	94.31	376,529,640.17	88.54
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	204,486,480.92	94.31	376,529,640.17	88.54

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 800 自由现金流指数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
	下降 5%	-10,228,715.53	-16,211,994.35
	上升 5%	10,228,715.53	16,211,994.35

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	204,089,861.58	376,440,923.66
第二层次	-	-
第三层次	396,619.34	88,716.51
合计	204,486,480.92	376,529,640.17

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行业等情况，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的输入值所属的最低层次，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

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异较小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	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	其他各项资产	729,048.74	0.33
9	合计	222,104,963.28	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	-	-
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

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

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

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	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
11	600482	中国动力	128,776	4,223,852.80	1.95
12	601699	潞安环能	292,000	4,169,760.00	1.92

13	000039	中集集团	510,900	4,143,399.00	1.91
14	002602	世纪华通	287,300	4,050,930.00	1.87
15	002027	分众传媒	722,400	3,496,416.00	1.61
16	002532	天山铝业	311,100	3,338,103.00	1.54
17	603885	吉祥航空	314,900	3,240,321.00	1.49
18	002001	新 和 成	112,000	3,183,040.00	1.47
19	600415	小商品城	290,100	2,947,416.00	1.36
20	601156	东航物流	159,300	2,567,916.00	1.18
21	002558	巨人网络	81,600	2,248,896.00	1.04
22	600801	华新建材	140,700	2,194,920.00	1.01
23	600256	广汇能源	421,500	2,082,210.00	0.96
24	000999	华润三九	91,800	2,064,582.00	0.95
25	601880	辽港股份	1,433,600	1,978,368.00	0.91
26	688819	天能股份	87,750	1,948,050.00	0.90
27	300972	万辰集团	10,800	1,872,828.00	0.86
28	000975	山金国际	105,800	1,798,600.00	0.83
29	603233	大参林	119,500	1,796,085.00	0.83
30	601216	君正集团	393,300	1,754,118.00	0.81
31	600398	海澜之家	326,600	1,708,118.00	0.79
32	600295	鄂尔多斯	158,800	1,702,336.00	0.79
33	600546	山煤国际	151,700	1,658,081.00	0.76
34	603444	吉比特	4,500	1,612,890.00	0.74
35	600380	健康元	155,600	1,465,752.00	0.68
36	000513	丽珠集团	48,600	1,404,054.00	0.65
37	603565	中谷物流	126,036	1,236,413.16	0.57
38	603939	益丰药房	67,600	1,215,448.00	0.56
39	000423	东阿阿胶	25,300	1,147,608.00	0.53
40	600132	重庆啤酒	27,100	1,119,230.00	0.52
41	601001	晋控煤业	61,400	1,067,746.00	0.49
42	603766	隆鑫通用	89,300	1,065,349.00	0.49
43	601000	唐山港	203,900	846,185.00	0.39
44	600131	国网信通	57,800	843,880.00	0.39
45	600535	天士力	62,900	832,167.00	0.38
46	603816	顾家家居	35,000	782,600.00	0.36
47	600004	白云机场	104,400	757,944.00	0.35
48	002773	康弘药业	33,200	678,940.00	0.31
49	001386	马可波罗	47,000	665,520.00	0.31
50	300002	神州泰岳	58,900	460,009.00	0.21

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

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	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
6	301696	三瑞智能	178	15,450.40	0.01
7	301687	新广益	195	15,167.10	0.01
8	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
9	301599	理奇智能	346	11,234.62	0.01
10	001365	天海电子	294	9,205.14	0.00
11	001393	维通利	206	8,031.94	0.00
12	301683	慧谷新材	59	7,184.43	0.00
13	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
14	001237	惠康科技	119	6,990.06	0.00
15	601112	振石股份	286	5,030.74	0.00
16	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
17	603293	埃泰克	51	1,730.43	0.00
18	001312	福恩股份	103	1,728.34	0.00
19	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
20	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

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	600938	中国海油	41,881,753.00	9.85
2	601728	中国电信	34,695,063.00	8.16
3	601633	长城汽车	24,263,873.69	5.71
4	601600	中国铝业	20,365,363.00	4.79
5	000651	格力电器	19,752,892.00	4.64
6	600104	上汽集团	18,047,275.00	4.24
7	002415	海康威视	16,714,597.75	3.93
8	601877	正泰电器	15,135,640.00	3.56
9	002352	顺丰控股	13,559,664.00	3.19
10	000100	TCL 科技	12,285,122.00	2.89
11	601816	京沪高铁	11,336,569.00	2.67
12	000708	中信特钢	9,692,639.00	2.28
13	600031	三一重工	9,222,899.00	2.17
14	601919	中远海控	8,966,370.00	2.11
15	002027	分众传媒	8,473,835.00	1.99

16	002714	牧原股份	7,833,980.00	1.84
17	000568	泸州老窖	7,613,984.06	1.79
18	600019	宝钢股份	7,544,065.00	1.77
19	600482	中国动力	7,248,912.00	1.70
20	600415	小商品城	7,244,197.00	1.70

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600938	中国海油	62,454,514.00	14.69
2	600104	上汽集团	46,385,078.00	10.91
3	601728	中国电信	34,771,609.87	8.18
4	000651	格力电器	34,579,960.00	8.13
5	601919	中远海控	27,426,263.00	6.45
6	002714	牧原股份	21,784,018.00	5.12
7	600019	宝钢股份	20,347,434.75	4.78
8	601600	中国铝业	19,435,840.00	4.57
9	601877	正泰电器	16,455,981.00	3.87
10	000100	TCL 科技	15,557,034.00	3.66
11	000568	泸州老窖	14,435,019.10	3.39
12	601633	长城汽车	13,907,127.00	3.27
13	002648	卫星化学	13,731,062.72	3.23
14	600482	中国动力	13,315,269.00	3.13
15	002352	顺丰控股	12,727,460.00	2.99
16	600352	浙江龙盛	12,710,664.60	2.99
17	601212	白银有色	12,475,598.00	2.93
18	600585	海螺水泥	11,097,840.50	2.61
19	601816	京沪高铁	11,039,105.00	2.60
20	000959	首钢股份	10,900,286.00	2.56
21	000039	中集集团	10,671,903.50	2.51
22	000708	中信特钢	10,654,093.00	2.51
23	000792	盐湖股份	10,418,706.00	2.45
24	000807	云铝股份	10,079,655.00	2.37
25	600415	小商品城	9,792,248.23	2.30
26	000933	神火股份	9,569,040.00	2.25
27	600096	云天化	9,159,724.85	2.15

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	524,670,612.93
卖出股票收入（成交）总额	662,553,709.88

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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约定备选库之外的股票。

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	-
2	应收清算款	-
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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	729,048.74

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	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

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的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
苏新中 证 800 自由现 金流指 数 A	1,780	68,734.06	4,656,533.87	3.81%	117,690,096.67	96.19%
苏新中 证 800 自由现 金流指 数 C	1,484	68,556.45	17,131,264.12	16.84%	84,606,509.27	83.16%
合计	3,264	68,653.31	21,787,797.99	9.72%	202,296,605.94	90.28%

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属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	苏新中证 800 自由现金 流指数 A	253,085.62	0.21%
	苏新中证 800 自由现金 流指数 C	20,000.00	0.02%
	合计	273,085.62	0.12%

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	苏新中证 800 自由现金流指数 A	10~50
	苏新中证 800 自由现金流指数 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式	苏新中证 800 自由现金流指数	0

基金	A	
	苏新中证 800 自由现金流指数 C	0
	合计	0

§ 9 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
基金合同生效日（2025 年 08 月 04 日）基金份额总额	733,043,061.82	565,159,129.89
本报告期期初基金份额总额	205,073,363.91	184,165,432.10
本报告期基金总申购份额	180,587,645.37	136,184,328.70
减：本报告期基金总赎回份额	263,314,378.74	218,611,987.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	122,346,630.54	101,737,773.39

§ 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

- 1、本报告期内，本基金管理人未发生高管变动。
- 2、本报告期内，本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

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、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未改变。

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改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金管理人在开展基金管理业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金管理人相关从业人员在开展基金管理业务过程中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

注：报告期内，本基金托管人的专门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

注：报告期内，本基金托管人的专门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	
中山证券有限责任公司	2	508,028,477.34	42.81%	99,642.98	42.82%	-
开源证券股份有限公司	2	405,672,819.50	34.19%	79,563.11	34.19%	-
东吴证券股份有限公司	2	272,910,717.89	23.00%	53,516.71	23.00%	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

2、本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

3、本基金报告期内无其他新增或停止使用的交易单元。

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
中山证券有限责任公司	0	0%	0	0%	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	0	0%	0	0%	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	0	0%	0	0%	-	-	-	-

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	苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金 2025 年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	苏新基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告(2025 年度)	中国证监会规定媒介	2026-03-30
3	苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
4	苏新中证 800 自由现金流指数型证券投资基金 2026 年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
5	《苏新基金管理有限公司对外行使表决权(2025 年度)情况信息披露》	中国证监会规定媒介	2026-04-22

§ 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

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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。

12.3 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
二〇二六年八月三十一日