

鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资
基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	61
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	61

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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息.....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	63
§ 9 开放式基金份额变动.....	63
§ 10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	64
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	64
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金
基金简称	鹏华启航量化选股混合发起式
基金主代码	025776
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 11 月 5 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,772,626,518.79 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略 本基金采用“自上而下”的资产配置方法，将宏观经济政策、证券市场走势以及资金流向、市场流动性等多因素纳入考量，结合量化风险模型，对股票、债券、现金等大类资产进行动态评估，确定最优配置比例。在战略资产配置基础上，运用战术资产配置灵活调整资产比例，并借助股指期货进行风险对冲与头寸管理，以实现资产配置方案的有效实施，力求在控制总体风险水平的前提下，推动投资组合的稳定增值。同时，持续监控资产配置风险，确保投资策略契合基金投资目标，具备前瞻性和适应性。 2、股票投资策略 （1）多因子策略 本基金采用自主研发的 Alpha 多因子选股模型构建股票投资组合，深入剖析中国 A 股市场特点，从海量历史数据中提取有效信息，构建多维因子库。同时运用先进的因子筛选技术和动态权重分配模型，结合市场环境变化实时调整因子组合，对全市场股票进行量化打分，精选具备超额收益潜力的个股，以实现组合的超额收益。 （2）组合风险优化 在投资组合构建后，密切关注市场信息动态，及时调整组合，并根据市场实际情况对换手率进行适当管控，运用量化风险模型（如 Barra 风险模型）对投资组合实时监测评估，综合考量个股行业分布、市值规模、流动性等因素，动态调整个股权重，控制组合波动率、跟踪误差等风险指标，在风险预算范围内追求收益最大化，确保组合风险收益比始终保持较优状态。 3、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证

	券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。 4、债券投资策略 债券投资旨在优化组合风险收益特征。基金管理人将立足宏观经济与利率走势分析，融合货币政策、财政政策导向及国际利率参照，预判基准利率趋势。运用久期管理、信用评估等多元策略严选债券，合理布局国债、央票、政策性金融债及信用债等，实现稳健收益增厚。 对于可转换债券的投资，本基金将在评估其偿债能力的同时兼顾公司的成长性，以期通过转换条款分享因股价上升带来的高收益；本基金将重点关注可转换债券的转换价值、市场价值与其转换价值的比较、转换期限、公司经营业绩、公司当前股票价格、相关的赎回条件、回售条件等，综合考虑可转换债券的债性和股性，并最终选择合适的投资品种。 可交换债券是一种风险收益特性与可转换债券相类似的债券品种。两者相同点在于都可以以特定价格转换成公司的股票。两者均一方面有票息、期限、到期还本付息等债性的特征，另一方面有与转股标的相关联的股性特征，且都带有一定的回售和赎回条款。区别在于同一转股标的的可交换债券和可转换债券的发行主体是不同的。可交换债券的转股标的是发行人所持有的其他公司股票，而可转换债券的转股标的为发行人自身股票。因此，在条款博弈、债性分析属性等方面，两者还存在着差异。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。 5、股指期货投资策略 本基金参与股指期货交易，应根据风险管理的原则，以套期保值为目的，通过对股票市场系统性风险的量化分析，确定股指期货的合理头寸。根据现货组合的贝塔值和市场波动情况，动态调整期货合约数量，对冲市场下跌风险或锁定阶段性收益。在合约选择上，优先交易流动性好、成交活跃的主力合约，同时考虑基差变化和合约展期成本，确保套期保值的有效性和成本可控性。此外，在严格遵守风险管理政策的前提下，适度利用股指期货的杠杆特性进行风险预算内的套利交易，增强组合的收益能力。 6、资产支持证券的投资策略 通过对资产支持证券的基础资产类型、现金流结构、信用增级措施和市场定价的深入分析，建立量化估值模型，评估其内在价值和风险水平。严格控制资产支持证券的总体投资规模，通过分散投资降低单一资产的信用风险和流动性风险。同时，密切跟踪宏观经济环境和监管政策变化对资产支持证券市场的影响，及时调整投资组合。 7、参与融资业务策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。
--	--

业绩比较基准	中证全指指数收益率×80%+中债综合全价指数收益率×15%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期收益及预期风险高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

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		鹏华基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高永杰	张姗
	联系电话	0755-81395402	400-61-95555
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4006788533	400-61-95555
传真		0755-82021126	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		张纳沙	缪建民

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	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告置备地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 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 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	292,434,513.14
本期利润	243,725,391.52
加权平均基金份额本期利润	0.0542
本期加权平均净值利润率	5.19%
本期基金份额净值增长率	5.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	279,858,241.57

期末可供分配基金份额利润	0.0742
期末基金资产净值	4,052,484,760.36
期末基金份额净值	1.0742
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	7.42%

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等未实现收益。

(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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），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，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

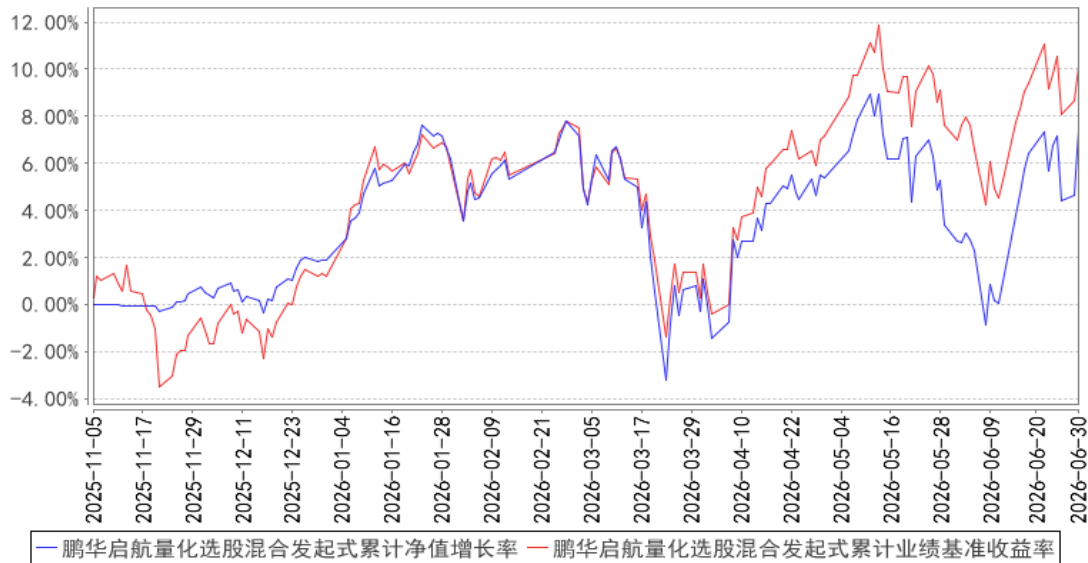
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.74%	1.23%	9.80%	1.10%	-2.06%	0.13%
过去六个月	5.39%	1.16%	8.80%	1.06%	-3.41%	0.10%
自基金合同生效起至今	7.42%	1.01%	10.11%	0.98%	-2.69%	0.03%

注：业绩比较基准=中证全指指数收益率×80%+中债综合全价指数收益率×15%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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

鹏华启航量化选股混合发起式累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2025 年 11 月 05 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

无。

§ 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

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模为 15,047 亿元，公司管理着 410 只公募基金，23 只社保基金、养老基金及划转资本组合。历经二十余年基金投资管理实践，公司在基金投资运作、风险控制等方面积累了丰富经验。

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		
苏俊杰	本基金的基金经理	2025-11-05	-	14 年	苏俊杰先生, 国籍中国, 理学硕士, 14 年证券从业经验。曾任 MSCI INC. 分析师, 华泰柏瑞基金管理有限公司专户投资经理, 财通基金管理有限公司基金经理。2019 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任量化及衍生品投资部副总经理, 现担任指数与量化投资部总经理/基金经理。2021 年 03 月至 2025 年 01 月担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 03 月至今担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 12 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华创业板指数型证券投资基金(LOF)基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理, 2023 年 02 月至今担任鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金基金经理, 2023 年 06 月至 2026 年 03 月担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 08 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2023 年 09 月至 2024 年 10 月担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 09 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2023 年 12 月至 2026 年 03 月担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金经理, 2024 年 01 月至 2025 年 06 月担任鹏华智投 800 混合型证券投资基金基金经理, 2024 年 05 月

					至今担任鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金经理，2024 年 06 月至 2025 年 08 月担任鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 02 月至今担任鹏华沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金经理，2025 年 02 月至今担任鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 10 月至今担任鹏华上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 11 月至今担任鹏华启航量化选股混合发起式证券投资基金基金经理，苏俊杰先生具备基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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，本基金运作合规，不存在违反基金合同和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

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

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

报告期内，本基金坚持以实现基金资产的稳健增值为核心目标开展投资运作。在具体投资策略上，基金主要依托量化选股体系进行组合构建。模型以上市公司基本面数据为基础，重点配置在长期具备较好解释力和有效性的因子，同时适度融合市场情绪、价量信息等短周期因子，以增强模型对不同市场环境的适应能力，兼顾中长期逻辑与短期交易特征，力争获取相对稳健的超额收益。

在模型层面上，本基金在基本面因子、量价因子以及另类因子等多个维度保持相对均衡的布局，希望通过多元化因子来源提升组合在不同市场风格和行情阶段中的适应性，努力争取相对基准的超额收益。

从后续运作来看，伴随市场定价效率逐步提升，量化策略所面临的竞争持续加剧，特别是在突发风险事件冲击或市场成交不足的情况下，模型表现可能受到一定扰动。我们认为，持续储备具备较高质量且相关性较低的 alpha 来源，是保持模型竞争力和持续性的关键。因此，基金后续将继续推进新因子的研究与挖掘，并不断完善和迭代模型框架，提升策略的稳定性与适应能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 5.39%，同期业绩比较基准增长率为 8.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济总体平淡，海外加息预期多有摇摆。国内经济依然呈现外需强、内需弱的态势，经济的积极变化在于消费补贴的透支效应正在消退，房价走低带来的资产负债表拖累也在缓解，宏观政策保持发力空间和一定的宽松概率，经济预期有望保持平稳甚至略有改善。在中东局势多有波折的背景下，通胀和就业数据有望反复拉扯美联储加息预期，加息预期的摇摆也是 3 季度最重要的海外宏观背景。虽然市场在交易美联储 9 月加息，但经济和就业数据难以支撑如此快速的加息。

A 股波动加大，下半年有望走出震荡修复行情。A 股因前期过度极致的交易和持仓结构而带来脆弱性和风险的提升，在海外出现宏观预期变化、产业扰动和情绪外溢时，叠加巨型 IPO 产生的流动性虹吸效应，国内科技成长方向出现大幅调整，并伴随着主被动去杠杆和流动性冲击。在宏观和产业趋势并未显著改变的背景下，风险的快速释放和流动性冲击也带来了良好的配置性机会，下半年市场有望走出“V”型震荡修复和高位震荡的行情。

科技不再一枝独秀，再平衡将带来更广泛的机会。经历了 5-7 月科技方向流动性虹吸和流动性释放的过程，科技在下半年可能难以重现一枝独秀的行情，科技依然是景气度最高的方向之一，

但板块内部将因基本面和产业趋势而出现分化，科技和其他板块之间的差距也将有所收敛。投资者预期的再校准和资金的再平衡有望带来更广泛的投资机会。特别是前期经过持续调整和流动性虹吸冲击下的部分经济相关板块，有望迎来配置型资金流入和修复性行情。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人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。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。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。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、风控管理部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，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。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 279,858,241.57 元，期末基金份额净值 1.0742 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	613,840,859.95	285,882,797.01
结算备付金		2,399,364.84	1,101,224,737.65
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,473,662,706.04	1,655,654,011.37
其中：股票投资		3,473,662,706.04	1,655,654,011.37
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		473,833.33	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,090,376,764.16	3,042,761,546.03
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 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		32,886,053.47	-
应付管理人报酬		4,109,572.45	3,064,080.76
应付托管费		684,928.76	510,680.13
应付销售服务费		-	-
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	6.4.7.9	211,449.12	-
负债合计		37,892,003.80	3,574,760.89
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	3,772,626,518.79	2,981,706,982.23
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	279,858,241.57	57,479,802.91
净资产合计		4,052,484,760.36	3,039,186,785.14
负债和净资产总计		4,090,376,764.16	3,042,761,546.03

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0742 元，基金份额总额 3,772,626,518.79 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		276,634,765.82
1. 利息收入		1,495,495.00
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,495,495.00

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）		319,162,481.58
其中：股票投资收益	6.4.7.14	295,031,812.26
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	24,130,669.32
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）	6.4.7.20	-48,709,121.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	4,685,910.86
减：二、营业总支出		32,909,374.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	28,117,737.85
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,686,289.67
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
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	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	105,346.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		243,725,391.52
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		243,725,391.52
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		243,725,391.52

注：本基金合同于 2025 年 11 月 05 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 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	2,981,706,982.23	-	57,479,802.91	3,039,186,785.14
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,981,706,982.23	-	57,479,802.91	3,039,186,785.14
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	790,919,536.56	-	222,378,438.66	1,013,297,975.22
(一)、综合收益总额	-	-	243,725,391.52	243,725,391.52
(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)	790,919,536.56	-	-21,346,952.86	769,572,583.70
其中：1. 基金申购款	2,958,174,786.87	-	106,147,157.48	3,064,321,944.35
2. 基金赎回款	-2,167,255,250.31	-	-127,494,110.34	-2,294,749,360.65
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	3,772,626,518.79	-	279,858,241.57	4,052,484,760.36
-----------	------------------	---	----------------	------------------

注：本基金合同于 2025 年 11 月 05 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

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：

<u>邓召明</u>	<u>聂连杰</u>	<u>郝文高</u>
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

鹏华启航量化选股混合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[2025]2019 号文《关于准予鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予，由鹏华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《鹏华启航量化选股混合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基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,981,706,982.23 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明（2025）验字第 70038904_B10 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2025 年 11 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,981,706,982.23 份基金份额，无认购资金利息份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证监会颁布的《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》、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《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》和《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》以及在财务报表附注中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 2026 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具；即不包含付款的合同义务且享有发行人净资产和剩余收益的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性

金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的

损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税（和/或）股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率或者发行价计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，若出现以下情形，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- (1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时

的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》和财政部、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[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固

定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关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，截至 2027 年 12 月 31 日适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；对金融同业往来利息收入，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	32,518,836.37
等于：本金	32,513,952.92
加：应计利息	4,883.45
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	581,322,023.58
等于：本金	581,315,362.94
加：应计利息	6,660.64
减：坏账准备	-
合计	613,840,859.95

注：其他存款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 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,466,178,565.76	-	3,473,662,706.04	7,484,140.28
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	3,466,178,565.76	-	3,473,662,706.04	7,484,140.28

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

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	43,012.05
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	91,690.98
其他	76,746.09
合计	211,449.12

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,981,706,982.23	2,981,706,982.23
本期申购	2,958,174,786.87	2,958,174,786.87
本期赎回（以“-”号填列）	-2,167,255,250.31	-2,167,255,250.31
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,772,626,518.79	3,772,626,518.79

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

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	1,286,541.01	56,193,261.90	57,479,802.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	1,286,541.01	56,193,261.90	57,479,802.91
本期利润	292,434,513.14	-48,709,121.62	243,725,391.52
本期基金份额交易产生的变动数	-11,326,080.29	-10,020,872.57	-21,346,952.86
其中：基金申购款	83,465,248.64	22,681,908.84	106,147,157.48
基金赎回款	-94,791,328.93	-32,702,781.41	-127,494,110.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	282,394,973.86	-2,536,732.29	279,858,241.57

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	183,027.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	137,708.89
结算备付金利息收入	1,174,627.19
其他	131.49
合计	1,495,495.00

注：1、其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

2、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的利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	295,031,812.26
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	295,031,812.26

6.4.7.14.2 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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	15,983,012,744.23
减：卖出股票成本总额	15,671,083,345.57
减：交易费用	16,897,586.40

买卖股票差价收入	295,031,812.26
----------	----------------

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	24,130,669.32
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	24,130,669.32

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-48,709,121.62
股票投资	-48,709,121.62
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	-48,709,121.62

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,632,419.93
基金转换费收入	53,490.93
合计	4,685,910.86

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	32,183.61
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	13,655.80
合计	105,346.78

6.4.7.24 分部报告

无。

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构、基金发起人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	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

本基金基金合同于 2025 年 11 月 05 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）

国信证券	33, 519, 707, 249. 29	100. 00
------	-----------------------	---------

6. 4. 10. 1. 2 债券交易

无。

6. 4. 10. 1. 3 债券回购交易

无。

6. 4. 10. 1. 4 权证交易

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1月1日至2026年6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 （%）
国信证券	6, 756, 843. 29	100. 00	-	-

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算，以扣除证管费、经手费等费用后的净额列示。佣金率由协议签订方参考市场价格确定。佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》相关要求。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6. 4. 10. 2 关联方报酬

6. 4. 10. 2. 1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	28, 117, 737. 85
其中：应支付销售机构的客户维护费	13, 968, 777. 45
应支付基金管理人的净管理费	14, 148, 960. 40

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理公司的管理人报酬年费率为 1. 20%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1. 20%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人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，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,686,289.67

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

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

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

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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2025 年 11 月 5 日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2651%

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
国信证券	581,322,023.58	137,708.89
招商银行	32,518,836.37	183,027.43

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。本基金在上年度可比期间未成立。

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

无。

6.4.12 期末（2026 年 6 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
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-

688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
--------	------	-----------------	------	--------	-------	--------	-----	----------	-----------	---

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起约定限售期内不得转让。

3、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	10,800	7,325,808.59	9,498,924.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

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

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括境内依法发行或上市交易的股票（包含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券

（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、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）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

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同责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、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在本基金的托管行招商银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2025 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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或于约定开放日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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大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，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。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。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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“期末本基金持有的流通受限证券”。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。

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逆回购交易质押品管理制度：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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金，其余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的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 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	613,840,859.95	-	-	-	613,840,859.95
结算备付金	2,399,364.84	-	-	-	2,399,364.84
交易性金融资产	-	-	-	-3,473,662,706.04	3,473,662,706.04
应收申购款	-	-	-	473,833.33	473,833.33
资产总计	616,240,224.79	-	-	-3,474,136,539.37	4,090,376,764.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	32,886,053.47	32,886,053.47
应付管理人报酬	-	-	-	4,109,572.45	4,109,572.45
应付托管费	-	-	-	684,928.76	684,928.76
其他负债	-	-	-	211,449.12	211,449.12
负债总计	-	-	-	37,892,003.80	37,892,003.80
利率敏感度缺口	616,240,224.79	-	-	-3,436,244,535.57	4,052,484,760.36
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	285,882,797.01	-	-	-	285,882,797.01
结算备付金	1,101,224,737.65	-	-	-	1,101,224,737.65
交易性金融资产	-	-	-	-1,655,654,011.37	1,655,654,011.37
资产总计	1,387,107,534.66	-	-	-1,655,654,011.37	3,042,761,546.03
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	3,064,080.76	3,064,080.76

应付托管费	-	-	-	510,680.13	510,680.13
负债总计	-	-	-	3,574,760.89	3,574,760.89
利率敏感度缺口	1,387,107,534.66	-	-	-1,652,079,250.48	3,039,186,785.14

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

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证券投资品种，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 60%-95%；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，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，本基金在履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例也会做相应调整。此外，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，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 6 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	3,473,662,706.04	85.72	1,655,654,011.37	54.48
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	3,473,662,706.04	85.72	1,655,654,011.37	54.48

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

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 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	147,064,671.95	—
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-147,064,671.95	—

注：于 2025 年 12 月 31 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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 6 月 30 日
第一层次	3,463,036,563.67
第二层次	10,349,215.44
第三层次	276,926.93
合计	3,473,662,706.04

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。 对于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、债券和基金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

无。

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

无。

§ 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	3,473,662,706.04	84.92
	其中：股票	3,473,662,706.04	84.92
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	616,240,224.79	15.07
8	其他各项资产	473,833.33	0.01
9	合计	4,090,376,764.16	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	705,958.89	0.02
B	采矿业	130,916,202.50	3.23
C	制造业	2,687,391,981.44	66.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,029,317.44	1.06
E	建筑业	23,006,374.74	0.57
F	批发和零售业	69,559,641.25	1.72
G	交通运输、仓储和邮政业	75,780,314.00	1.87
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	273,568,299.70	6.75
J	金融业	76,104,890.88	1.88
K	房地产业	14,304,086.00	0.35
L	租赁和商务服务业	29,530,373.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	31,613,358.20	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	13,408,173.00	0.33

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,743,735.00	0.12
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,473,662,706.04	85.72

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	37,200	47,244,000.00	1.17
2	300502	新易盛	75,813	46,018,491.00	1.14
3	688002	睿创微纳	179,476	27,763,142.44	0.69
4	002653	海思科	417,500	27,696,950.00	0.68
5	688256	寒武纪	16,400	26,167,020.00	0.65
6	301536	星辰科技	200,800	25,844,968.00	0.64
7	000977	浪潮信息	331,400	23,198,000.00	0.57
8	000301	东方盛虹	1,943,900	22,257,655.00	0.55
9	688396	华润微	223,300	21,782,915.00	0.54
10	002384	东山精密	82,500	21,643,875.00	0.53
11	688220	翱捷科技-U	173,375	21,553,980.00	0.53
12	600601	方正科技	1,549,700	21,447,848.00	0.53
13	300408	三环集团	128,300	21,413,270.00	0.53
14	002079	苏州固锔	1,414,900	21,265,947.00	0.52
15	603893	瑞芯微	109,100	20,550,076.00	0.51
16	600885	宏发股份	591,700	20,407,733.00	0.50
17	688099	晶晨股份	194,546	20,018,783.40	0.49
18	002273	水晶光电	563,100	19,978,788.00	0.49
19	603986	兆易创新	24,300	19,804,500.00	0.49
20	603296	华勤技术	263,720	19,586,484.40	0.48
21	603063	禾望电气	363,500	19,225,515.00	0.47
22	300458	全志科技	482,840	19,052,866.40	0.47
23	688653	康希通信	1,090,965	18,960,971.70	0.47
24	001309	德明利	19,400	18,292,260.00	0.45
25	688516	奥特维	312,100	17,911,419.00	0.44
26	002185	华天科技	787,900	17,578,049.00	0.43
27	300102	乾照光电	670,000	17,446,800.00	0.43
28	688018	乐鑫科技	135,800	17,371,536.00	0.43
29	300628	亿联网络	512,700	17,339,514.00	0.43

30	002156	通富微电	228,200	17,313,534.00	0.43
31	600233	圆通速递	1,095,300	17,250,975.00	0.43
32	300394	天孚通信	56,563	17,120,488.84	0.42
33	002841	视源股份	492,800	17,016,384.00	0.42
34	600563	法拉电子	88,200	16,828,560.00	0.42
35	688173	希荻微	837,726	16,034,075.64	0.40
36	300658	延江股份	1,400,700	16,010,001.00	0.40
37	000603	盛达资源	686,800	15,865,080.00	0.39
38	600343	航天动力	564,600	15,820,092.00	0.39
39	001339	智微智能	153,730	15,723,504.40	0.39
40	688110	东芯股份	76,797	15,643,548.90	0.39
41	002506	协鑫集成	4,885,300	15,535,254.00	0.38
42	001965	招商公路	1,694,900	15,525,284.00	0.38
43	002838	道恩股份	506,980	15,523,727.60	0.38
44	000895	双汇发展	688,100	15,413,440.00	0.38
45	002643	万润股份	734,870	15,395,526.50	0.38
46	301371	敷尔佳	589,212	15,319,512.00	0.38
47	688068	热景生物	176,152	15,254,763.20	0.38
48	000975	山金国际	896,500	15,240,500.00	0.38
49	603317	天味食品	1,171,040	15,235,230.40	0.38
50	688120	华海清科	47,280	15,232,670.40	0.38
51	605222	起帆电缆	653,200	15,232,624.00	0.38
52	601077	渝农商行	2,485,490	15,186,343.90	0.37
53	601399	国机重装	4,332,700	15,164,450.00	0.37
54	002850	科达利	79,900	15,125,070.00	0.37
55	688475	萤石网络	549,597	15,031,477.95	0.37
56	300475	香农芯创	49,900	14,970,000.00	0.37
57	688188	柏楚电子	140,260	14,965,742.00	0.37
58	688195	腾景科技	77,600	14,944,208.00	0.37
59	605299	舒华体育	1,117,500	14,918,625.00	0.37
60	688301	奕瑞科技	119,810	14,856,440.00	0.37
61	002821	凯莱英	91,601	14,839,362.00	0.37
62	002402	和而泰	574,300	14,834,169.00	0.37
63	603125	常青科技	451,100	14,769,014.00	0.36
64	601212	白银有色	2,904,500	14,754,860.00	0.36
65	600871	石化油服	7,265,700	14,749,371.00	0.36
66	002195	岩山科技	2,203,000	14,407,620.00	0.36
67	603699	纽威股份	286,300	14,400,890.00	0.36
68	002487	大金重工	247,800	14,364,966.00	0.35
69	688568	中科星图	344,839	14,300,473.33	0.35
70	000938	紫光股份	492,800	14,222,208.00	0.35
71	300724	捷佳伟创	200,800	14,176,480.00	0.35
72	600566	济川药业	636,900	14,132,811.00	0.35

73	300681	英搏尔	488,557	13,982,501.34	0.35
74	300866	安克创新	133,400	13,940,300.00	0.34
75	688045	必易微	172,097	13,901,995.66	0.34
76	603897	长城科技	423,300	13,740,318.00	0.34
77	688676	金盘科技	161,000	13,627,040.00	0.34
78	300164	通源石油	1,700,100	13,600,800.00	0.34
79	300416	苏试试验	659,400	13,438,572.00	0.33
80	601665	齐鲁银行	2,313,900	13,351,203.00	0.33
81	002518	科士达	244,500	13,102,755.00	0.32
82	600584	长电科技	126,100	13,057,655.00	0.32
83	601838	成都银行	736,420	13,034,634.00	0.32
84	688627	精智达	18,200	13,013,000.00	0.32
85	002595	豪迈科技	277,930	12,951,538.00	0.32
86	002080	中材科技	143,800	12,942,000.00	0.32
87	688025	杰普特	27,460	12,906,200.00	0.32
88	001298	好上好	620,275	12,870,706.25	0.32
89	002463	沪电股份	83,500	12,758,800.00	0.31
90	300590	移为通信	888,800	12,754,280.00	0.31
91	301086	鸿富瀚	60,200	12,598,656.00	0.31
92	300740	水羊股份	674,599	12,419,367.59	0.31
93	600027	华电国际	2,765,700	12,307,365.00	0.30
94	002155	湖南黄金	514,050	12,270,373.50	0.30
95	002342	巨力索具	1,165,500	12,249,405.00	0.30
96	603538	美诺华	376,200	12,245,310.00	0.30
97	600299	安迪苏	1,543,500	12,116,475.00	0.30
98	600363	联创光电	338,000	12,093,640.00	0.30
99	300129	泰胜风能	1,407,600	12,034,980.00	0.30
100	300661	圣邦股份	83,700	12,009,276.00	0.30
101	603216	梦天家居	581,500	11,961,455.00	0.30
102	002413	雷科防务	1,204,800	11,758,848.00	0.29
103	002049	紫光国微	132,000	11,715,000.00	0.29
104	301165	锐捷网络	145,000	11,665,250.00	0.29
105	300118	东方日升	934,400	11,633,280.00	0.29
106	002008	大族激光	76,300	11,453,393.00	0.28
107	300613	富瀚微	141,800	11,355,344.00	0.28
108	000596	古井贡酒	141,500	11,291,700.00	0.28
109	688536	思瑞浦	31,000	11,286,790.00	0.28
110	000426	兴业银锡	338,900	11,170,144.00	0.28
111	300775	三角防务	503,600	11,099,344.00	0.27
112	002865	钧达股份	185,000	11,040,800.00	0.27
113	002648	卫星化学	466,700	10,962,783.00	0.27
114	002768	国恩股份	203,554	10,597,021.24	0.26
115	001208	华菱线缆	744,000	10,557,360.00	0.26

116	002558	巨人网络	375,400	10,346,024.00	0.26
117	002328	新朋股份	1,401,900	10,289,946.00	0.25
118	600985	淮北矿业	730,400	10,262,120.00	0.25
119	688702	盛科通信-U	26,000	10,139,740.00	0.25
120	300604	长川科技	29,600	10,106,032.00	0.25
121	603132	金徽股份	639,300	9,960,294.00	0.25
122	688279	峰岬科技	44,000	9,875,360.00	0.24
123	688209	英集芯	334,895	9,738,746.60	0.24
124	600816	建元信托	3,988,000	9,730,720.00	0.24
125	688266	泽璟制药-U	82,000	9,566,120.00	0.24
126	688072	拓荆科技	10,800	9,498,924.00	0.23
127	600206	有研新材	141,400	9,417,240.00	0.23
128	600066	宇通客车	350,250	9,390,202.50	0.23
129	688027	国盾量子	18,337	9,242,031.37	0.23
130	002990	盛视科技	116,700	9,219,300.00	0.23
131	603345	安井食品	114,500	9,181,755.00	0.23
132	002466	天齐锂业	146,800	9,001,776.00	0.22
133	300054	鼎龙股份	84,540	8,958,703.80	0.22
134	603778	国晟科技	727,500	8,948,250.00	0.22
135	301382	蜂助手	193,904	8,919,584.00	0.22
136	002266	浙富控股	1,739,600	8,802,376.00	0.22
137	688779	五矿新能	1,083,655	8,788,442.05	0.22
138	300476	胜宏科技	25,300	8,764,679.00	0.22
139	600312	平高电气	490,600	8,663,996.00	0.21
140	603516	淳中科技	63,700	8,574,657.00	0.21
141	688775	影石创新	61,773	8,564,826.45	0.21
142	603025	大豪科技	624,400	8,516,816.00	0.21
143	000967	盈峰环境	807,748	8,505,586.44	0.21
144	688498	源杰科技	4,501	8,488,886.00	0.21
145	688041	海光信息	22,800	8,442,840.00	0.21
146	688270	ST 臻镭	107,144	8,395,803.84	0.21
147	600674	川投能源	591,400	8,380,138.00	0.21
148	000733	振华科技	146,900	8,320,416.00	0.21
149	688593	新相微	212,588	8,273,924.96	0.20
150	000066	中国长城	431,300	8,216,265.00	0.20
151	603706	东方环宇	471,200	8,147,048.00	0.20
152	003035	南网能源	1,397,100	8,131,122.00	0.20
153	300677	英科医疗	206,300	8,080,771.00	0.20
154	688628	优利德	81,600	8,073,504.00	0.20
155	300136	信维通信	67,500	8,049,375.00	0.20
156	600546	山煤国际	728,100	7,958,133.00	0.20
157	002271	东方雨虹	669,700	7,949,339.00	0.20
158	002600	领益智造	458,400	7,948,656.00	0.20

159	301555	惠柏新材	173,000	7,855,930.00	0.19
160	600641	先导基电	196,900	7,848,434.00	0.19
161	688386	泛亚微透	87,300	7,843,032.00	0.19
162	603507	振江股份	237,940	7,825,846.60	0.19
163	301631	壹连科技	108,724	7,812,906.64	0.19
164	605118	力鼎光电	223,700	7,804,893.00	0.19
165	001314	亿道信息	120,900	7,471,620.00	0.18
166	300776	帝尔激光	34,700	7,459,112.00	0.18
167	002468	申通快递	508,700	7,406,672.00	0.18
168	300219	鸿利智汇	708,600	7,390,698.00	0.18
169	688122	西部超导	117,100	7,355,051.00	0.18
170	300857	协创数据	21,300	7,239,870.00	0.18
171	600460	士兰微	131,500	7,187,790.00	0.18
172	002422	科伦药业	186,200	7,172,424.00	0.18
173	688717	艾罗能源	86,500	7,142,305.00	0.18
174	301358	湖南裕能	92,700	7,033,149.00	0.17
175	300001	特锐德	185,600	7,021,248.00	0.17
176	600482	中国动力	211,900	6,950,320.00	0.17
177	603175	超颖电子	75,700	6,744,113.00	0.17
178	301656	联合动力	391,400	6,743,822.00	0.17
179	300990	同飞股份	64,000	6,724,480.00	0.17
180	601138	工业富联	93,200	6,724,380.00	0.17
181	002703	浙江世宝	472,500	6,723,675.00	0.17
182	688686	奥普特	39,900	6,718,761.00	0.17
183	000572	海马汽车	1,805,700	6,681,090.00	0.16
184	002348	高乐股份	633,300	6,674,982.00	0.16
185	603122	合富中国	607,600	6,659,296.00	0.16
186	002163	海南发展	795,800	6,636,972.00	0.16
187	688361	中科飞测	15,400	6,622,000.00	0.16
188	301526	国际复材	140,700	6,566,469.00	0.16
189	301329	信音电子	269,704	6,551,110.16	0.16
190	603929	亚翔集成	23,927	6,508,622.54	0.16
191	600183	生益科技	37,400	6,485,160.00	0.16
192	002534	西子洁能	349,600	6,485,080.00	0.16
193	000708	中信特钢	508,200	6,413,484.00	0.16
194	600426	华鲁恒升	267,826	6,406,397.92	0.16
195	688008	澜起科技	20,600	6,383,940.00	0.16
196	601061	中信金属	592,300	6,379,071.00	0.16
197	605599	菜百股份	462,300	6,333,510.00	0.16
198	601000	唐山港	1,518,700	6,302,605.00	0.16
199	002179	中航光电	136,300	6,297,060.00	0.16
200	603486	科沃斯	123,000	6,242,250.00	0.15
201	002916	深南电路	13,500	6,181,650.00	0.15

202	300277	汽轮科技	408,192	6,139,207.68	0.15
203	300255	常山药业	258,800	6,061,096.00	0.15
204	600113	浙江东日	180,800	5,998,944.00	0.15
205	002757	南兴股份	332,000	5,992,600.00	0.15
206	600499	科达制造	432,500	5,968,500.00	0.15
207	300980	祥源新材	202,300	5,949,643.00	0.15
208	688486	龙迅股份	93,439	5,940,851.62	0.15
209	301186	超达装备	144,400	5,920,400.00	0.15
210	600901	江苏金租	1,025,300	5,895,475.00	0.15
211	300446	航天智造	346,200	5,826,546.00	0.14
212	605020	永和股份	142,900	5,818,888.00	0.14
213	605056	咸亨国际	356,800	5,708,800.00	0.14
214	688012	中微公司	12,184	5,708,204.00	0.14
215	301002	崧盛股份	146,900	5,670,340.00	0.14
216	002032	苏泊尔	142,900	5,658,840.00	0.14
217	601865	福莱特	535,000	5,622,850.00	0.14
218	300596	利安隆	106,400	5,583,872.00	0.14
219	002027	分众传媒	1,148,400	5,558,256.00	0.14
220	603306	华懋科技	53,500	5,547,415.00	0.14
221	301219	腾远钴业	100,537	5,509,427.60	0.14
222	688313	仕佳光子	29,800	5,502,570.00	0.14
223	605255	天普股份	82,500	5,427,675.00	0.13
224	000848	承德露露	729,300	5,396,820.00	0.13
225	002947	恒铭达	70,800	5,384,340.00	0.13
226	600487	亨通光电	49,200	5,379,528.00	0.13
227	300322	硕贝德	213,200	5,372,640.00	0.13
228	301308	江波龙	7,600	5,348,880.00	0.13
229	688036	传音控股	89,500	5,276,025.00	0.13
230	000551	创元科技	254,292	5,246,043.96	0.13
231	002444	巨星科技	168,600	5,243,460.00	0.13
232	300651	金陵体育	293,400	5,237,190.00	0.13
233	002429	兆驰股份	502,300	5,218,897.00	0.13
234	603297	永新光学	35,400	5,202,030.00	0.13
235	300290	ST 荣科	778,900	5,179,685.00	0.13
236	002338	奥普光电	89,000	5,090,800.00	0.13
237	688609	九联科技	460,800	5,073,408.00	0.13
238	300689	澄天伟业	71,500	5,017,870.00	0.12
239	000566	海南海药	1,001,900	4,999,481.00	0.12
240	605289	罗曼股份	34,460	4,996,700.00	0.12
241	600583	海油工程	992,100	4,990,263.00	0.12
242	301529	福赛科技	51,600	4,972,176.00	0.12
243	000783	长江证券	506,700	4,940,325.00	0.12
244	603806	福斯特	293,000	4,919,470.00	0.12

245	300919	中伟新材	111,300	4,869,375.00	0.12
246	002475	立讯精密	68,000	4,787,200.00	0.12
247	601018	宁波港	1,518,800	4,784,220.00	0.12
248	300913	兆龙互连	99,700	4,776,627.00	0.12
249	300492	华图山鼎	138,100	4,743,735.00	0.12
250	688521	芯原股份	12,717	4,719,787.38	0.12
251	600722	金牛化工	579,800	4,707,976.00	0.12
252	300191	潜能恒信	169,800	4,694,970.00	0.12
253	301200	大族数控	13,000	4,688,450.00	0.12
254	605588	冠石科技	69,200	4,648,164.00	0.11
255	688469	芯联集成-U	436,600	4,632,326.00	0.11
256	300782	卓胜微	42,200	4,624,276.00	0.11
257	300684	中石科技	75,800	4,623,800.00	0.11
258	300837	浙矿股份	192,900	4,583,304.00	0.11
259	000951	中国重汽	234,000	4,565,340.00	0.11
260	600595	中孚实业	810,600	4,555,572.00	0.11
261	300012	华测检测	327,400	4,537,764.00	0.11
262	002181	粤传媒	452,600	4,503,370.00	0.11
263	688472	阿特斯	415,572	4,496,489.04	0.11
264	301328	维峰电子	62,900	4,478,480.00	0.11
265	300749	顶固集创	162,400	4,360,440.00	0.11
266	601777	千里科技	533,600	4,354,176.00	0.11
267	603711	香飘飘	391,300	4,347,343.00	0.11
268	600821	金开新能	688,600	4,303,750.00	0.11
269	002580	圣阳股份	212,900	4,292,064.00	0.11
270	688277	天智航-U	246,423	4,213,833.30	0.10
271	603228	景旺电子	58,000	4,199,780.00	0.10
272	002245	蔚蓝锂芯	224,232	4,195,380.72	0.10
273	600515	海南机场	1,513,400	4,146,716.00	0.10
274	600909	华安证券	373,200	4,146,252.00	0.10
275	601963	重庆银行	410,600	4,138,848.00	0.10
276	688107	安路科技	90,500	4,126,800.00	0.10
277	688048	长光华芯	8,200	4,116,400.00	0.10
278	002154	报喜鸟	1,144,700	4,075,132.00	0.10
279	688778	厦钨新能	74,300	4,041,920.00	0.10
280	603519	立霸股份	263,700	4,034,610.00	0.10
281	300602	飞荣达	78,800	4,034,560.00	0.10
282	688620	安凯微	248,524	4,026,088.80	0.10
283	688510	航亚科技	167,678	4,004,150.64	0.10
284	600592	龙溪股份	282,300	3,997,368.00	0.10
285	603112	华翔股份	237,300	3,970,029.00	0.10
286	300548	长芯博创	14,200	3,947,600.00	0.10
287	300850	新强联	147,000	3,939,600.00	0.10

288	301626	苏州天脉	10,100	3,877,996.00	0.10
289	600377	宁沪高速	332,800	3,850,496.00	0.10
290	002414	高德红外	288,400	3,824,184.00	0.09
291	300432	富临精工	187,500	3,766,875.00	0.09
292	688585	上纬新材	22,700	3,763,660.00	0.09
293	000810	创维数字	283,800	3,760,350.00	0.09
294	301061	匠心家居	106,410	3,731,798.70	0.09
295	002379	宏桥控股	252,200	3,724,994.00	0.09
296	600012	皖通高速	235,800	3,716,208.00	0.09
297	605389	长龄液压	38,400	3,686,400.00	0.09
298	603129	春风动力	14,400	3,683,520.00	0.09
299	002151	北斗星通	114,900	3,648,075.00	0.09
300	301603	乔锋智能	25,200	3,623,760.00	0.09
301	000429	粤高速 A	261,600	3,570,840.00	0.09
302	688182	灿勤科技	82,400	3,548,968.00	0.09
303	603083	剑桥科技	13,900	3,542,693.00	0.09
304	688776	国光电气	57,167	3,506,623.78	0.09
305	688166	博瑞医药	99,800	3,493,998.00	0.09
306	002912	中新赛克	189,200	3,488,848.00	0.09
307	001389	广合科技	14,700	3,487,575.00	0.09
308	301535	浙江华远	259,200	3,478,464.00	0.09
309	600438	通威股份	287,000	3,475,570.00	0.09
310	688765	禾元生物-U	68,100	3,473,100.00	0.09
311	300979	华利集团	115,700	3,442,075.00	0.08
312	688411	海博思创	11,800	3,436,160.00	0.08
313	002948	青岛银行	675,320	3,430,625.60	0.08
314	000415	渤海租赁	841,800	3,426,126.00	0.08
315	300450	先导智能	83,800	3,412,336.00	0.08
316	001221	悍高集团	84,632	3,403,899.04	0.08
317	603679	华体科技	168,500	3,400,330.00	0.08
318	688196	卓越新能	94,483	3,391,939.70	0.08
319	300750	宁德时代	8,600	3,379,886.00	0.08
320	601567	三星电气	224,600	3,355,524.00	0.08
321	688249	晶合集成	56,000	3,305,680.00	0.08
322	688758	赛分科技	149,200	3,283,892.00	0.08
323	002015	协鑫能科	201,100	3,281,952.00	0.08
324	600879	航天电子	153,600	3,270,144.00	0.08
325	001872	招商港口	167,900	3,262,297.00	0.08
326	300342	天银机电	69,000	3,243,000.00	0.08
327	600230	沧州大化	245,500	3,196,410.00	0.08
328	603730	岱美股份	284,800	3,181,216.00	0.08
329	000062	深圳华强	98,700	3,140,634.00	0.08
330	688115	思林杰	37,900	3,117,275.00	0.08

331	688052	纳芯微	10,800	3,113,748.00	0.08
332	000932	华菱钢铁	896,000	3,109,120.00	0.08
333	300939	秋田微	44,900	3,107,080.00	0.08
334	600350	山东高速	277,800	3,091,914.00	0.08
335	000933	神火股份	145,800	3,090,960.00	0.08
336	002432	九安医疗	43,400	3,067,512.00	0.08
337	600577	精达股份	307,200	3,004,416.00	0.07
338	688385	复旦微电	42,082	3,000,025.78	0.07
339	688656	浩欧博	31,000	2,999,870.00	0.07
340	002455	百川股份	416,184	2,996,524.80	0.07
341	603686	福龙马	229,100	2,959,972.00	0.07
342	300157	新锦动力	800,100	2,952,369.00	0.07
343	002885	京泉华	72,000	2,941,920.00	0.07
344	601126	四方股份	46,300	2,926,160.00	0.07
345	300786	国林科技	115,700	2,900,599.00	0.07
346	601107	四川成渝	594,000	2,898,720.00	0.07
347	600166	福田汽车	990,100	2,881,191.00	0.07
348	000963	华东医药	100,300	2,820,436.00	0.07
349	003022	联泓新科	107,600	2,786,840.00	0.07
350	301128	强瑞技术	17,780	2,771,902.00	0.07
351	688336	三生国健	50,945	2,705,179.50	0.07
352	688433	华曙高科	31,600	2,704,960.00	0.07
353	300926	博俊科技	151,210	2,683,977.50	0.07
354	600961	株冶集团	82,800	2,681,892.00	0.07
355	603416	信捷电气	49,500	2,617,065.00	0.06
356	001360	南矿集团	147,100	2,602,199.00	0.06
357	603016	新宏泰	77,000	2,599,520.00	0.06
358	000026	飞亚达	119,700	2,578,338.00	0.06
359	603629	利通电子	14,300	2,556,983.00	0.06
360	300623	捷捷微电	56,800	2,555,432.00	0.06
361	301150	中一科技	40,240	2,539,546.40	0.06
362	000678	襄阳轴承	298,200	2,534,700.00	0.06
363	300896	爱美客	28,640	2,497,408.00	0.06
364	300063	天龙集团	287,300	2,493,764.00	0.06
365	605598	上海港湾	64,800	2,490,264.00	0.06
366	002320	海峡股份	395,900	2,482,293.00	0.06
367	002652	扬子新材	581,500	2,477,190.00	0.06
368	000060	中金岭南	326,900	2,474,633.00	0.06
369	600023	浙能电力	468,100	2,462,206.00	0.06
370	300067	安诺其	450,800	2,443,336.00	0.06
371	300139	晓程科技	66,100	2,415,955.00	0.06
372	300573	兴齐眼药	58,475	2,383,441.00	0.06
373	002803	吉宏股份	92,100	2,379,864.00	0.06

374	605167	利柏特	147,442	2,373,816.20	0.06
375	002979	雷赛智能	42,000	2,342,760.00	0.06
376	603738	泰晶科技	38,600	2,317,930.00	0.06
377	688345	博力威	39,900	2,317,392.00	0.06
378	603696	安记食品	199,400	2,293,100.00	0.06
379	603682	锦和商管	309,600	2,291,040.00	0.06
380	300870	欧陆通	6,600	2,281,554.00	0.06
381	002264	新华都	401,300	2,263,332.00	0.06
382	300034	钢研高纳	130,100	2,229,914.00	0.06
383	301489	思泉新材	13,380	2,202,080.40	0.05
384	688159	有方科技	49,600	2,201,744.00	0.05
385	688729	屹唐股份	51,197	2,201,471.00	0.05
386	600683	京投发展	189,700	2,181,550.00	0.05
387	603766	隆鑫通用	182,800	2,180,804.00	0.05
388	002392	北京利尔	269,600	2,175,672.00	0.05
389	603156	养元饮品	44,200	2,168,894.00	0.05
390	688234	天岳先进	12,400	2,151,524.00	0.05
391	600331	宏达股份	194,400	2,136,456.00	0.05
392	300845	捷安高科	159,700	2,120,816.00	0.05
393	002577	雷柏科技	115,300	2,116,908.00	0.05
394	002969	嘉美包装	150,100	2,113,408.00	0.05
395	688709	成都华微	55,400	2,110,186.00	0.05
396	001287	中电港	67,300	2,096,395.00	0.05
397	002301	齐心集团	285,300	2,062,719.00	0.05
398	600391	航发科技	61,300	2,050,485.00	0.05
399	000534	万泽股份	74,900	2,049,264.00	0.05
400	001337	四川黄金	55,700	2,041,962.00	0.05
401	688410	山外山	141,700	2,034,812.00	0.05
402	300864	南大环境	104,900	2,011,982.00	0.05
403	300250	初灵信息	137,600	2,006,208.00	0.05
404	000657	中钨高新	20,900	2,000,548.00	0.05
405	301081	严牌股份	146,000	1,997,280.00	0.05
406	301111	粤万年青	77,000	1,992,760.00	0.05
407	300413	芒果超媒	135,900	1,988,217.00	0.05
408	300252	金信诺	115,100	1,985,475.00	0.05
409	000811	冰轮环境	35,000	1,967,700.00	0.05
410	002545	东方铁塔	120,700	1,957,754.00	0.05
411	688347	华虹宏力	5,800	1,950,540.00	0.05
412	301236	软通动力	45,600	1,935,720.00	0.05
413	601677	明泰铝业	116,500	1,933,900.00	0.05
414	002983	芯瑞达	68,700	1,901,616.00	0.05
415	301087	可孚医疗	39,900	1,901,235.00	0.05
416	603301	振德医疗	21,500	1,873,940.00	0.05

417	688109	品茗科技	24,743	1,873,045.10	0.05
418	688230	芯导科技	23,700	1,867,797.00	0.05
419	002371	北方华创	2,100	1,857,576.00	0.05
420	300048	合康新能	397,700	1,857,259.00	0.05
421	600703	三安光电	85,647	1,817,429.34	0.04
422	301566	达利凯普	49,000	1,816,920.00	0.04
423	600105	永鼎股份	26,800	1,808,464.00	0.04
424	603031	安孚科技	33,500	1,783,875.00	0.04
425	688639	华恒生物	110,500	1,783,470.00	0.04
426	605333	沪光股份	104,600	1,783,430.00	0.04
427	603587	地素时尚	159,300	1,769,823.00	0.04
428	301397	溯联股份	53,300	1,724,788.00	0.04
429	688013	天臣医疗	69,800	1,721,966.00	0.04
430	002364	中恒电气	32,000	1,721,600.00	0.04
431	002792	通宇通讯	48,000	1,707,360.00	0.04
432	300570	太辰光	6,900	1,702,299.00	0.04
433	688089	嘉必优	160,000	1,697,600.00	0.04
434	300351	永贵电器	102,300	1,687,950.00	0.04
435	603556	海兴电力	75,200	1,654,400.00	0.04
436	300662	科锐国际	97,400	1,653,852.00	0.04
437	300774	倍杰特	153,100	1,645,825.00	0.04
438	600009	上海机场	70,900	1,637,790.00	0.04
439	300941	创识科技	118,800	1,631,124.00	0.04
440	301172	君逸数码	62,300	1,616,685.00	0.04
441	000987	越秀资本	206,359	1,613,727.38	0.04
442	688187	时代电气	23,500	1,613,510.00	0.04
443	600536	中国软件	56,600	1,591,592.00	0.04
444	600410	华胜天成	99,000	1,567,170.00	0.04
445	002112	三变科技	94,300	1,545,577.00	0.04
446	603989	艾华集团	29,000	1,522,500.00	0.04
447	300951	博硕科技	29,840	1,506,920.00	0.04
448	688375	国博电子	14,399	1,501,815.70	0.04
449	688652	京仪装备	7,215	1,444,226.55	0.04
450	603799	华友钴业	29,920	1,443,939.20	0.04
451	600988	赤峰黄金	53,800	1,416,016.00	0.03
452	300937	药易购	71,900	1,386,951.00	0.03
453	001222	源飞宠物	103,900	1,379,792.00	0.03
454	601778	晶科科技	315,900	1,358,370.00	0.03
455	688383	新益昌	7,200	1,353,888.00	0.03
456	301117	佳缘科技	57,940	1,352,899.00	0.03
457	002222	福晶科技	14,600	1,347,288.00	0.03
458	002546	新联电子	184,200	1,340,976.00	0.03
459	002093	国脉科技	211,600	1,333,080.00	0.03

460	601226	华电科工	204,800	1,302,528.00	0.03
461	002531	天顺风能	153,700	1,295,691.00	0.03
462	300887	谱尼测试	183,700	1,278,552.00	0.03
463	300986	志特新材	74,400	1,275,960.00	0.03
464	002709	天赐材料	24,600	1,265,178.00	0.03
465	688450	光格科技	18,800	1,259,412.00	0.03
466	603701	德宏股份	57,100	1,255,058.00	0.03
467	603619	中曼石油	66,200	1,238,602.00	0.03
468	600841	动力新科	201,800	1,230,980.00	0.03
469	688390	固德威	11,200	1,215,312.00	0.03
470	001311	多利科技	74,270	1,197,975.10	0.03
471	603257	中国瑞林	15,100	1,177,649.00	0.03
472	600497	驰宏锌锗	95,400	1,155,294.00	0.03
473	603698	航天工程	29,900	1,152,944.00	0.03
474	603660	苏州科达	93,300	1,142,925.00	0.03
475	688226	威腾电气	26,500	1,134,995.00	0.03
476	603320	迪贝电气	63,400	1,106,330.00	0.03
477	002913	奥士康	17,300	1,106,162.00	0.03
478	600483	福能股份	108,100	1,101,539.00	0.03
479	688125	安达智能	6,600	1,079,100.00	0.03
480	002565	顺灏股份	83,300	1,055,411.00	0.03
481	600714	金瑞矿业	51,300	1,053,189.00	0.03
482	603285	键邦股份	23,500	1,053,035.00	0.03
483	002532	天山铝业	97,500	1,046,175.00	0.03
484	002440	闰土股份	99,900	1,023,975.00	0.03
485	688278	特宝生物	18,664	1,015,321.60	0.03
486	301365	矩阵股份	26,700	1,012,197.00	0.02
487	300922	天秦装备	66,400	1,005,960.00	0.02
488	688352	顾中科技	40,900	988,962.00	0.02
489	002250	联化科技	71,600	978,772.00	0.02
490	300393	中来股份	133,500	973,215.00	0.02
491	605111	新洁能	9,800	971,572.00	0.02
492	002294	信立泰	30,200	963,078.00	0.02
493	002763	汇洁股份	140,900	956,711.00	0.02
494	300568	星源材质	50,400	943,488.00	0.02
495	000547	航天发展	49,000	938,350.00	0.02
496	688667	菱电电控	7,000	935,550.00	0.02
497	301600	慧翰股份	10,200	932,280.00	0.02
498	603876	鼎胜新材	35,200	915,552.00	0.02
499	002788	鹭燕医药	90,500	907,715.00	0.02
500	688136	科兴制药	43,400	898,814.00	0.02
501	002396	星网锐捷	46,430	890,063.10	0.02
502	603931	格林达	14,800	879,120.00	0.02

503	002851	麦格米特	5,244	876,691.92	0.02
504	688683	莱尔科技	23,057	874,321.44	0.02
505	300909	汇创达	14,900	867,478.00	0.02
506	002478	常宝股份	139,500	862,110.00	0.02
507	300069	金利华电	26,800	853,044.00	0.02
508	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.02
509	605151	西上海	47,600	838,236.00	0.02
510	603318	水发燃气	87,700	836,658.00	0.02
511	301310	鑫宏业	14,800	817,552.00	0.02
512	002774	快意电梯	57,500	817,075.00	0.02
513	600875	东方电气	28,300	814,191.00	0.02
514	300386	飞天诚信	72,700	806,243.00	0.02
515	688228	开普云	10,400	804,336.00	0.02
516	301198	喜悦智行	59,800	801,320.00	0.02
517	300184	力源信息	44,600	782,730.00	0.02
518	300151	昌红科技	31,100	775,945.00	0.02
519	600436	片仔癀	7,100	775,888.00	0.02
520	688150	莱特光电	11,000	754,820.00	0.02
521	688213	思特威-W	7,000	749,490.00	0.02
522	603085	天成自控	68,300	742,421.00	0.02
523	001203	大中矿业	24,700	739,765.00	0.02
524	603201	常润股份	52,200	728,712.00	0.02
525	600153	建发股份	91,500	725,595.00	0.02
526	002458	益生股份	90,857	705,958.89	0.02
527	688515	裕太微-U	2,800	696,528.00	0.02
528	003023	彩虹集团	35,100	682,344.00	0.02
529	688191	智洋创新	19,000	678,300.00	0.02
530	688419	耐科装备	8,600	676,390.00	0.02
531	605258	协和电子	19,400	657,272.00	0.02
532	688046	药康生物	26,091	631,402.20	0.02
533	000061	农产品	112,000	627,200.00	0.02
534	002906	华阳集团	25,100	626,496.00	0.02
535	688484	南芯科技	11,000	621,390.00	0.02
536	300418	昆仑万维	15,200	613,472.00	0.02
537	600301	华锡有色	10,000	613,200.00	0.02
538	600338	西藏珠峰	40,000	609,600.00	0.02
539	603336	宏辉果蔬	74,300	588,456.00	0.01
540	601615	明阳智能	50,700	586,599.00	0.01
541	603256	宏和科技	2,200	583,726.00	0.01
542	301197	工大科雅	15,200	574,864.00	0.01
543	300966	共同药业	20,300	558,453.00	0.01
544	300703	创源股份	43,700	558,049.00	0.01
545	603158	腾龙股份	43,700	534,451.00	0.01

546	002128	电投能源	22,900	529,448.00	0.01
547	002223	鱼跃医疗	19,100	490,106.00	0.01
548	688535	华海诚科	2,600	486,200.00	0.01
549	000559	万向钱潮	35,600	460,308.00	0.01
550	002624	完美世界	36,900	458,298.00	0.01
551	603286	日盈电子	10,000	456,300.00	0.01
552	002563	森马服饰	89,500	451,080.00	0.01
553	605338	巴比食品	24,900	445,710.00	0.01
554	603116	红蜻蜓	78,300	444,744.00	0.01
555	601825	沪农商行	58,900	441,161.00	0.01
556	600152	维科技术	44,000	439,560.00	0.01
557	601869	长飞光纤	800	436,720.00	0.01
558	601069	西部黄金	19,200	422,400.00	0.01
559	600828	茂业商业	117,500	420,650.00	0.01
560	300861	美畅股份	16,300	410,597.00	0.01
561	300539	横河精密	19,800	403,326.00	0.01
562	688275	万润新能	3,070	391,578.50	0.01
563	002782	可立克	17,600	370,480.00	0.01
564	002738	中矿资源	6,200	365,738.00	0.01
565	688599	天合光能	25,100	354,412.00	0.01
566	300952	恒辉安防	20,200	351,480.00	0.01
567	605066	天正电气	48,200	327,278.00	0.01
568	301316	慧博云通	8,300	326,854.00	0.01
569	001296	长江材料	17,000	325,890.00	0.01
570	603313	梦百合	52,100	308,432.00	0.01
571	601179	中国西电	19,500	290,940.00	0.01
572	688508	芯朋微	3,000	278,880.00	0.01
573	688009	中国通号	54,276	258,353.76	0.01
574	688127	蓝特光学	2,600	253,760.00	0.01
575	601096	宏盛华源	57,500	249,550.00	0.01
576	600075	新疆天业	60,400	244,016.00	0.01
577	301169	零点有数	3,400	240,244.00	0.01
578	300863	卡倍亿	3,000	229,890.00	0.01
579	688236	春立医疗	14,800	214,008.00	0.01
580	002706	良信股份	19,500	212,745.00	0.01
581	600645	中源协和	11,600	198,476.00	0.00
582	002966	苏州银行	28,100	195,576.00	0.00
583	300762	上海瀚讯	4,100	187,165.00	0.00
584	002544	普天科技	9,900	180,378.00	0.00
585	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
586	300584	海辰药业	4,000	144,920.00	0.00
587	300132	青松股份	25,300	143,704.00	0.00
588	000959	首钢股份	39,000	136,890.00	0.00

589	688800	瑞可达	1,400	134,358.00	0.00
590	002208	合肥城建	6,300	127,386.00	0.00
591	600968	海油发展	38,200	127,206.00	0.00
592	300945	曼卡龙	11,500	124,545.00	0.00
593	688141	杰华特	800	122,800.00	0.00
594	301290	东星医疗	4,300	117,175.00	0.00
595	301556	托普云农	2,000	116,920.00	0.00
596	300666	江丰电子	300	110,580.00	0.00
597	000423	东阿阿胶	2,300	104,328.00	0.00
598	688137	近岸蛋白	2,877	103,572.00	0.00
599	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
600	300467	迅游科技	2,400	89,232.00	0.00
601	300487	蓝晓科技	1,200	70,620.00	0.00
602	002548	金新农	14,300	52,767.00	0.00
603	002290	禾盛新材	500	45,935.00	0.00
604	000960	锡业股份	1,000	42,690.00	0.00
605	688335	复洁科技	1,774	42,646.96	0.00
606	003030	祖名股份	1,500	30,825.00	0.00
607	002986	宇新股份	1,800	21,294.00	0.00
608	600883	博闻科技	2,500	17,500.00	0.00
609	600251	冠农股份	1,600	13,824.00	0.00
610	603115	海星股份	100	12,247.00	0.00
611	688091	上海谊众	152	6,110.40	0.00
612	688391	钜泉科技	139	4,985.93	0.00
613	688310	迈得医疗	153	2,351.61	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	688516	奥特维	95,061,602.88	3.13
2	300212	*ST 易录	73,615,399.45	2.42
3	002865	钧达股份	70,998,167.00	2.34
4	600115	中国东航	64,205,292.00	2.11
5	000408	藏格矿业	62,433,458.00	2.05
6	000100	TCL 科技	55,418,234.00	1.82
7	601615	明阳智能	53,477,554.00	1.76
8	600741	华域汽车	52,986,242.72	1.74
9	300136	信维通信	51,819,006.64	1.71
10	600693	东百集团	51,790,086.00	1.70
11	300164	通源石油	50,047,272.00	1.65
12	688615	合合信息	49,824,936.45	1.64
13	600023	浙能电力	49,767,711.00	1.64
14	002236	大华股份	48,682,126.00	1.60

15	000157	中联重科	48,587,015.10	1.60
16	688099	晶晨股份	48,238,200.78	1.59
17	603296	华勤技术	47,382,701.00	1.56
18	600196	复星医药	46,524,048.00	1.53
19	601018	宁波港	45,788,688.00	1.51
20	300308	中际旭创	45,672,141.00	1.50

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	688516	奥特维	79,981,541.21	2.63
2	000100	TCL 科技	69,975,248.00	2.30
3	600115	中国东航	65,791,268.00	2.16
4	600741	华域汽车	62,084,162.55	2.04
5	002865	钧达股份	60,699,489.00	2.00
6	000408	藏格矿业	59,972,089.87	1.97
7	002236	大华股份	57,297,295.00	1.89
8	600023	浙能电力	56,719,361.00	1.87
9	300136	信维通信	56,318,095.30	1.85
10	300212	*ST 易录	56,005,686.51	1.84
11	601615	明阳智能	52,924,465.00	1.74
12	600693	东百集团	52,865,078.00	1.74
13	000157	中联重科	52,847,878.54	1.74
14	002493	荣盛石化	50,852,141.16	1.67
15	688009	中国通号	49,239,379.96	1.62
16	688615	合合信息	48,204,960.56	1.59
17	002414	高德红外	48,199,294.70	1.59
18	002943	宇晶股份	46,835,110.39	1.54
19	300058	蓝色光标	45,858,954.00	1.51
20	688498	源杰科技	45,757,416.99	1.51

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	17,537,801,161.86
卖出股票收入（成交）总额	15,983,012,744.23

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，应根据风险管理的原则，以套期保值为目的，通过对股票市场系统性风险的量化分析，确定股指期货的合理头寸。根据现货组合的贝塔值和市场波动情况，动态调整期货合约数量，对冲市场下跌风险或锁定阶段性收益。在合约选择上，优先交易流动性好、成交活跃的主力合约，同时考虑基差变化和合约展期成本，确保套期保值的有效性和成本可控性。此外，在严格遵守风险管理政策的前提下，适度利用股指期货的杠杆特性进行风险预算内的套利交易，增强组合的收益能力。

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

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	473,833.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	473,833.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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，投资组合报告中数字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

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（%）
22,341	168,865.61	43,040,062.01	1.14	3,729,586,456.78	98.86

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,212,195.66	0.0586

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.27	10,000,000.00	0.27	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.27	10,000,000.00	0.27	-

注：1、本基金自 2025 年 11 月 3 日至 2025 年 11 月 3 日止期间公开发售，于 2025 年 11 月 5 日基金合同正式生效。

- 2、本基金管理人在募集期间认购本基金份额 10,000,000.00 份。
- 3、本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 11 月 5 日）基金份额总额	2,981,706,982.23
本报告期期初基金份额总额	2,981,706,982.23
本报告期基金总申购份额	2,958,174,786.87
减：本报告期基金总赎回份额	2,167,255,250.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,772,626,518.79

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原副总经理李伟先生因个人原因辞职，经公司第六届董事会第三百三十八

次会议审议通过，自 2026 年 4 月 3 日起，李伟先生不再担任公司副总经理。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

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

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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 (%)	
国信证券	3	33,519,707,249.29	100.00	6,756,843.29	100.00	本报告期新增 3 个

注：交易单元选择的标准和程序：

1. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称《规定》），基金管理人制定了相应的管理制度规范交易单元选择的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券公司，选择标准包括：财务状况良好，经营行为规范；有完备的合规管理流程和制度，风险控制能力较强；研究、交易等服务能力较强，交易设施能够为投资组合提供有效的交易执行；中国证监会或有权机关规定的其他条件等。

2. 选择程序如下：

- （1）基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；
- （2）基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；
- （3）基金管理人定期对证券公司进行评价，依据评价结果选择交易单元。

3. 根据《规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率；其他类型基金股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

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	
	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(%)
国信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 17 日
2	鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金开放日常赎回和转换转出业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 22 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 24 日
4	鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金开放日常申购和定期定额投资业务暨暂停大额申购和定期	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 30 日

	定额投资业务的公告		
5	鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金申购申请进行比例配售的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 03 日
6	鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金申购比例确认结果的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 04 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 04 日
8	鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金调整大额申购和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 28 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与海南有知有行基金销售有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 31 日
10	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 04 日
11	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 17 日
12	鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 21 日
13	鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金调整大额申购和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 05 月 15 日
14	鹏华基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 05 月 30 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 06 月 18 日
16	鹏华基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 06 月 24 日

§ 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

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

- (一)《鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金 2026 年中期报告》(原文)。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站 (<http://www.phfund.com.cn>) 查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日