

鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金 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：华泰证券股份有限公司

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。

基金托管人华泰证券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	9
3.3 其他指标	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	63

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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	64
§ 8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	67
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	67
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金		
基金简称	鹏华国证 2000 指数增强		
基金主代码	017892		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2023 年 2 月 21 日		
基金管理人	鹏华基金管理有限公司		
基金托管人	华泰证券股份有限公司		
报告期末基金份 额总额	142,501,812.58 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基 金简称	鹏华国证 2000 指数增强 A	鹏华国证 2000 指数增强 C	鹏华国证 2000 指数增强 I
下属分级基金的交 易代码	017892	017893	022796
报告期末下属分级 基金的份额总额	51,363,436.57 份	90,725,720.38 份	412,655.63 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	1、股票投资策略 本基金为指数增强型基金，以国证 2000 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获得超越业绩比较基准的超额收益。 指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子量化选股模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，力求实现超额收益。 （1）多因子量化选股模型 本基金将以多因子量化选股模型构建股票组合。多因子模型针对个股构建价值、质量、动量、成长、一致预期等因子，通过量化方法处理因子与个股超额回报之间的特征关系，挑选出具有基本面逻辑支撑和统计意义有效的因子组合，进而得出具有稳定超额回报的股票组合。本基金对因子的有效性进行持续的跟踪，分析其变化规律，基金经理根据市场状况结合因子变化趋势，对模型使用的因子结构进行动态调整。 （2）风险控制与调整 本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时，需要控制跟

	踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。 本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。 （3）投资组合优化模型 本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。选股范围以标的指数成份股为主，也包括非成份股中与成份股相关性强，流动性好，基本面信息充足的股票。 2、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深入研究判断，进行存托凭证的投资。 3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。 本基金可投资可转换债券及可交换债券，可转换债券及可交换债券兼具债权和股权双重属性，本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析综合开展投资决策，以增强本基金的收益。 4、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果。 5、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 6、参与融资及转融通证券出借业务策略 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。 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金在履行适当程序后可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票指数增强型基金，其预期的收益和风险高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，具

	有与标的指数相似的风险收益特征。
--	------------------

注：无。

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	华泰证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	刘强
	联系电话	0755-81395402	025-83387812
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	liuqiang023506@htsc.com
客户服务电话		4006788533	95597
传真		0755-82021126	025-83387215
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	江苏省南京市江东中路 228 号
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	江苏省南京市江东中路 228 号
邮政编码		518048	210009
法定代表人		张纳沙	王会清

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)		
	鹏华国证 2000 指数增强 A	鹏华国证 2000 指数增强 C	鹏华国证 2000 指数增强 I
本期已实现收益	19,064,702.93	28,785,282.73	111,063.64
本期利润	14,687,060.87	20,601,991.40	77,634.88
加权平均基金份额本期	0.2310	0.2055	0.1965

利润			
本期加权平均净值利润率	13.23%	11.93%	12.06%
本期基金份额净值增长率	14.30%	14.07%	14.24%
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	42,214,821.97	72,353,517.23	285,900.75
期末可供分配基金份额利润	0.8219	0.7975	0.6928
期末基金资产净值	93,578,258.54	163,079,237.61	698,556.38
期末基金份额净值	1.8219	1.7975	1.6928
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	82.19%	79.75%	69.28%

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

鹏华国证 2000 指数增强 A

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	11.06%	1.52%	12.46%	1.55%	-1.40%	-0.03%
过去六个月	14.30%	1.54%	13.22%	1.58%	1.08%	-0.04%
过去一年	41.57%	1.28%	34.04%	1.35%	7.53%	-0.07%
过去三年	79.43%	1.64%	36.47%	1.65%	42.96%	-0.01%
自基金合同生效起至今	82.19%	1.57%	31.56%	1.59%	50.63%	-0.02%

鹏华国证 2000 指数增强 C

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	10.95%	1.52%	12.46%	1.55%	-1.51%	-0.03%
过去六个月	14.07%	1.54%	13.22%	1.58%	0.85%	-0.04%
过去一年	41.00%	1.28%	34.04%	1.35%	6.96%	-0.07%
过去三年	77.29%	1.64%	36.47%	1.65%	40.82%	-0.01%
自基金合同生效起至今	79.75%	1.57%	31.56%	1.59%	48.19%	-0.02%

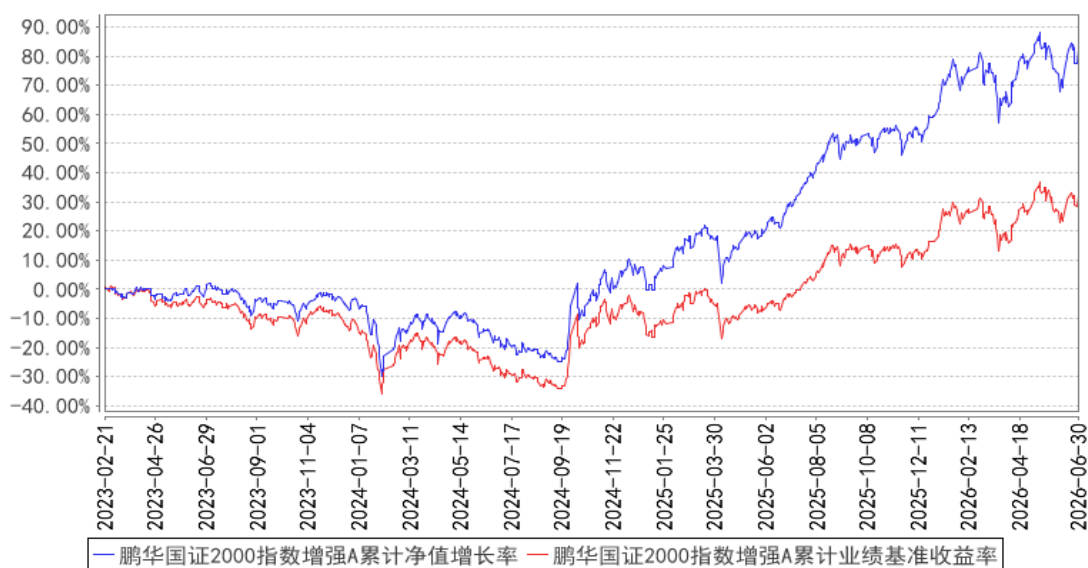
鹏华国证 2000 指数增强 I

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	11.03%	1.52%	12.46%	1.55%	-1.43%	-0.03%
过去六个月	14.24%	1.54%	13.22%	1.58%	1.02%	-0.04%
过去一年	41.40%	1.28%	34.04%	1.35%	7.36%	-0.07%
自基金合同生效起至今	69.28%	1.43%	41.03%	1.48%	28.25%	-0.05%

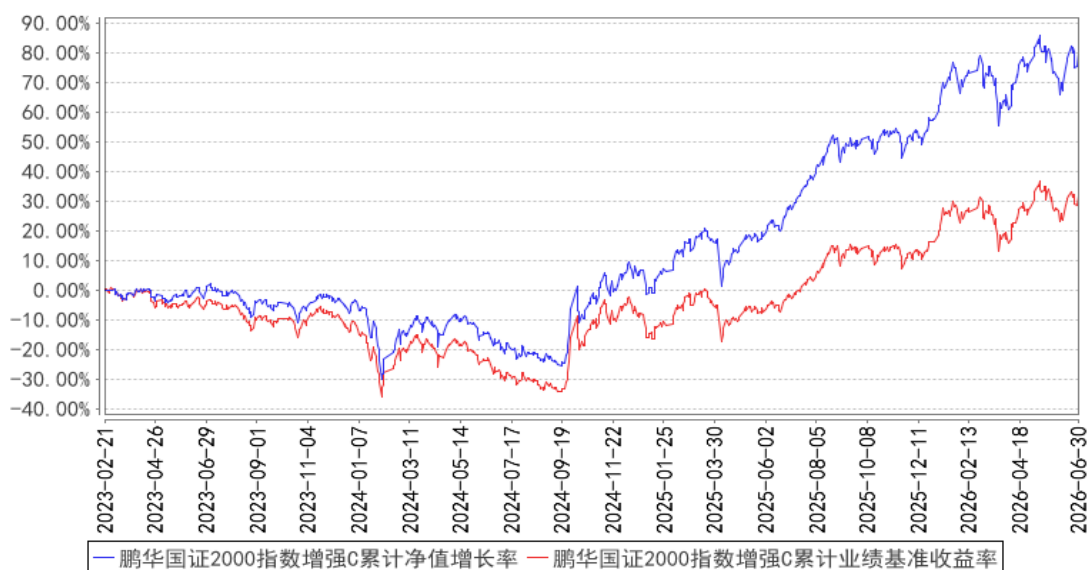
注：业绩比较基准=国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。鹏华国证 2000 指数增强 I 基金份额的首次确认日为 2024 年 12 月 20 日。

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

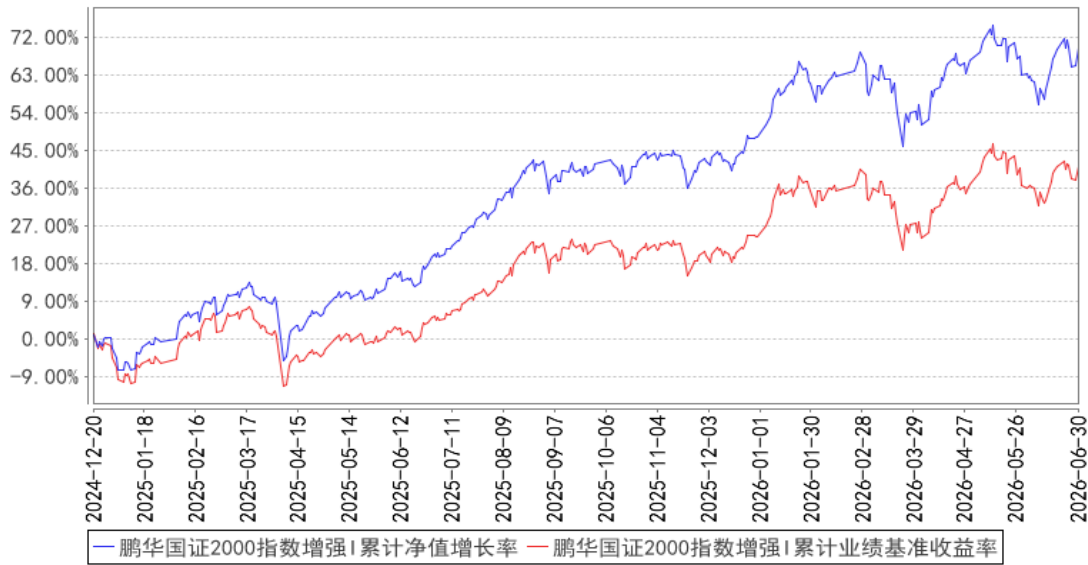
鹏华国证2000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华国证2000指数增强C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



鹏华国证2000指数增强I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 2023 年 02 月 21 日生效。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。鹏华国证 2000 指数增强 I 基金份额的首次确认日为 2024 年 12 月 20 日。

3.3 其他指标

注：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的经验。

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	本基金的	2023-02-	-	14 年	苏俊杰先生, 国籍中国, 理学硕士, 14 年

杰	基金经理	21			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型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

注：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，本基金在控制相对国证 2000 指数跟踪误差的基础上，采用量化方法进行选股，在严格遵守指数成分股投资比例，控制包括行业、风格在内的各类风险暴露的前提下，力争在国证 2000 指数收益率的基础上进行增强。量化选股模型侧重于不同预测收益来源、不同预测周期因子的动态配置，辅以稳健均衡的风格，平衡模型长期有效性和对短期市场环境波动的适应性，力争获取稳健的超额收益。

当前市场波动加剧，对量化策略的适应能力与风险控制水平提出了更高要求。在此背景下，我们坚持多因子框架的均衡配置，在基本面、量价、另类等维度持续挖掘有效信号，通过因子的低相关性与互补性构建分散化的组合结构，以增强策略在不同市场环境下的稳健性。报告期内，我们致力于在控制相对回撤的前提下，通过精细化的模型迭代与组合优化，争取持续稳定的超额收益。

展望未来，随着市场有效性不断提升，在策略竞争日趋激烈的情况下，尤其是市场成交活跃度不足时，模型的稳定性和适应性仍然可能遇到挑战，我们认为高质量、低相关性的 alpha 因子是模型保持生命力的核心因素，因此我们将持续挖掘新的 alpha 因子，对模型进行优化和迭代。

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 A 类份额净值增长率为 14.30%，同期业绩比较基准增长率为 13.22%；C 类份额净值增长率为 14.07%，同期业绩比较基准增长率为 13.22%；I 类份额净值增长率为 14.24%，同期业绩比较基准增长率为 13.22%。

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，鹏华国证 2000 指数增强 A 期末可供分配利润为 42,214,821.97 元，期末基金份额净值 1.8219 元；鹏华国证 2000 指数增强 C 期末可供分配利润为 72,353,517.23 元，期末基金份额净值 1.7975 元；鹏华国证 2000 指数增强 I 期末可供分配利润为 285,900.75 元，期末基金份额净值 1.6928 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

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，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，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支进行了复核，未发现基金管理人存在损害本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的真实、准确和完整发表意见

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2026 年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、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：鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金

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	18,561,776.06	16,657,977.22
结算备付金		85,883.58	85,565.11
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	240,050,737.71	210,749,771.19
其中：股票投资		240,050,737.71	210,749,771.19
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		2,301,218.24	2,615,228.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		260,999,615.59	230,108,541.91
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		3,261,313.03	3,357,514.34
应付管理人报酬		223,994.86	186,123.76
应付托管费		22,399.48	18,612.38
应付销售服务费		54,707.94	46,703.90
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	81,147.75	30,682.49
负债合计		3,643,563.06	3,639,636.87
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	142,501,812.58	143,045,351.42
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	114,854,239.95	83,423,553.62
净资产合计		257,356,052.53	226,468,905.04
负债和净资产总计		260,999,615.59	230,108,541.91

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额为 142,501,812.58 份，其中鹏华国证 2000 指数增强 A 基金份额总额为 51,363,436.57 份，基金份额净值 1.8219 元；鹏华国证 2000 指数增强 C 基金份额总额为 90,725,720.38 份，基金份额净值 1.7975 元；鹏华国证 2000 指数增强 I 基金份额总额为 412,655.63 份，基金份额净值 1.6928 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金

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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		37,334,341.08	35,551,897.28
1. 利息收入		66,764.21	42,203.01
其中：存款利息收入	6.4.7.13	66,764.21	42,203.01
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		49,677,392.39	37,404,503.23
其中：股票投资收益	6.4.7.14	47,618,810.76	35,706,118.77
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	2,058,581.63	1,698,384.46
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	-12,594,362.15	-1,916,218.07
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	184,546.63	21,409.11
减：二、营业总支出		1,967,653.93	1,117,062.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,409,193.77	816,373.14
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	140,919.38	81,637.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	343,205.89	142,237.52
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	74, 334. 89	76, 814. 59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		35, 366, 687. 15	34, 434, 834. 73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		35, 366, 687. 15	34, 434, 834. 73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		35, 366, 687. 15	34, 434, 834. 73

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金

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	143, 045, 351. 42	-	83, 423, 553. 62	226, 468, 905. 04
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	143, 045, 351. 42	-	83, 423, 553. 62	226, 468, 905. 04
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-543, 538. 84	-	31, 430, 686. 33	30, 887, 147. 49
(一)、综合收益总额	-	-	35, 366, 687. 15	35, 366, 687. 15
(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)	-543, 538. 84	-	-3, 936, 000. 82	-4, 479, 539. 66
其中：1. 基金申购款	278, 525, 199. 98	-	201, 923, 536. 39	480, 448, 736. 37
2. 基金赎回款	-	-	-	-
	279, 068, 738. 82		205, 859, 537. 21	-484, 928, 276. 03
(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	142,501,812.58	-	114,854,239.95	257,356,052.53
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	162,439,639.09	-	7,385,123.70	169,824,762.79
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	162,439,639.09	-	7,385,123.70	169,824,762.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-67,711,662.06	-	19,007,586.28	-48,704,075.78
（一）、综合收益总额	-	-	34,434,834.73	34,434,834.73
（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）	-67,711,662.06	-	-15,427,248.45	-83,138,910.51
其中：1. 基金申购款	81,141,520.90	-	12,478,609.14	93,620,130.04
2. 基金赎回款	- 148,853,182.96	-	-27,905,857.59	-176,759,040.55
（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	94,727,977.03	-	26,392,709.98	121,120,687.01

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：

邓召明

基金管理人负责人

聂连杰

主管会计工作负责人

郝文高

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金(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[2023]199 号《关于准予鹏华国证 2000 指数增强型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《鹏华国证 2000 指数增强型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 470,545,038.44 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0102 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 2 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 470,611,661.51 份基金份额,其中认购资金利息折合 66,623.07 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为华泰证券股份有限公司。

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》、《鹏华国证 2000 指数增强型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 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相一致。

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

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	3,843,015.28
等于: 本金	3,839,413.54
加: 应计利息	3,601.74
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	14,718,760.78
等于：本金	14,718,486.28
加：应计利息	274.50
减：坏账准备	—
合计	18,561,776.06

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		251,348,164.19	—	240,050,737.71	-11,297,426.48
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		251,348,164.19	—	240,050,737.71	-11,297,426.48

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

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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。

6.4.7.4.3 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

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：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

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：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	14.44
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	74,334.89
其他	6,798.42

合计	81,147.75
----	-----------

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华国证 2000 指数增强 A

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	58,632,691.09	58,632,691.09
本期申购	71,501,067.28	71,501,067.28
本期赎回（以“-”号填列）	-78,770,321.80	-78,770,321.80
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	51,363,436.57	51,363,436.57

鹏华国证 2000 指数增强 C

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	84,293,990.26	84,293,990.26
本期申购	205,735,536.91	205,735,536.91
本期赎回（以“-”号填列）	-199,303,806.79	-199,303,806.79
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	90,725,720.38	90,725,720.38

鹏华国证 2000 指数增强 I

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	118,670.07	118,670.07
本期申购	1,288,595.79	1,288,595.79
本期赎回（以“-”号填列）	-994,610.23	-994,610.23
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	412,655.63	412,655.63

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

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

鹏华国证 2000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	33,504,783.78	1,324,114.24	34,828,898.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	33,504,783.78	1,324,114.24	34,828,898.02
本期利润	19,064,702.93	-4,377,642.06	14,687,060.87
本期基金份额交易产生的变动数	-8,336,244.96	1,035,108.04	-7,301,136.92
其中：基金申购款	50,492,952.71	2,978,855.08	53,471,807.79
基金赎回款	-58,829,197.67	-1,943,747.04	-60,772,944.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,233,241.75	-2,018,419.78	42,214,821.97

鹏华国证 2000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	46,640,202.24	1,897,282.44	48,537,484.68
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	46,640,202.24	1,897,282.44	48,537,484.68
本期利润	28,785,282.73	-8,183,291.33	20,601,991.40
本期基金份额交易产生的变动数	427,190.68	2,786,850.47	3,214,041.15
其中：基金申购款	143,130,768.94	4,536,643.92	147,667,412.86
基金赎回款	-142,703,578.26	-1,749,793.45	-144,453,371.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,852,675.65	-3,499,158.42	72,353,517.23

鹏华国证 2000 指数增强 I

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	69,669.85	-12,498.93	57,170.92
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	69,669.85	-12,498.93	57,170.92
本期利润	111,063.64	-33,428.76	77,634.88
本期基金份额交易产生的变动数	172,361.54	-21,266.59	151,094.95
其中：基金申购款	882,189.31	-97,873.57	784,315.74
基金赎回款	-709,827.77	76,606.98	-633,220.79
本期已分配利润	-	-	-

本期末	353,095.03	-67,194.28	285,900.75
-----	------------	------------	------------

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	61,715.00
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,086.07
结算备付金利息收入	318.47
其他	644.67
合计	66,764.21

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	47,618,810.76
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	47,618,810.76

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	602,255,849.88
减：卖出股票成本总额	554,024,614.04
减：交易费用	612,425.08
买卖股票差价收入	47,618,810.76

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：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

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：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

注：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

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：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

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：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

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：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	2,058,581.63
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	2,058,581.63

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	-12,594,362.15
股票投资	-12,594,362.15
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	-12,594,362.15

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	183,527.65
基金转换费收入	1,018.98
合计	184,546.63

6.4.7.22 信用减值损失

注：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	14,827.52
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	74,334.89

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
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	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、基金代销机构

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
华泰证券	1,197,049,279.18	100.00	676,818,760.28	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

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 （%）
华泰证券	234,545.34	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025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 （%）
华泰证券	132,595.56	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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,409,193.77	816,373.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	581,730.04	249,333.57
应支付基金管理人的净管理费	827,463.73	567,039.57

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 1.00%，逐日计提，按月支付。日管

理费=前一日基金资产净值×1.00%÷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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	140,919.38	81,637.30

注：支付基金托管人华泰证券的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	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销售服务费			
	鹏华国证 2000 指数增强 A	鹏华国证 2000 指数增强 C	鹏华国证 2000 指数增强 I	合计
国信证券	-	967.07	-	967.07
华泰证券	-	136,445.44	-	136,445.44
鹏华基金公司	-	4,275.73	317.30	4,593.03
合计	-	141,688.24	317.30	142,005.54
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	鹏华国证 2000 指数增强 A	鹏华国证 2000 指数增强 C	鹏华国证 2000 指数增强 I	合计
国信证券	-	36.76	-	36.76
华泰证券	-	95,630.07	-	95,630.07
鹏华基金公司	-	380.38	157.16	537.54
合计	-	96,047.21	157.16	96,204.37

注：鹏华国证 2000 指数增强 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华国证 2000 指数增强 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.4%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.4%÷当年天数；支付基金销售机构的鹏华国证 2000 指数增强 I 基金份额的销

售服务费年费率为 0.1%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.1%÷当年天数。

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：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		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华泰证券	18,561,776.06	65,801.07	11,392,914.15	41,746.87

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：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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 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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	106	5,645.56	6,226.44	-
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	8,007	80,950.77	80,950.77	-
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	3,431	34,687.41	34,687.41	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,042	8,148.44	21,611.08	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	82	1,507.16	1,375.96	-
001365	天海电	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流	27.19	31.31	252	6,851.88	7,890.12	-

	子	日		通受限						
001393	维 通 利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	30.38	38.99	180	5,468.40	7,018.20	-
001399	惠 科 股 份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	10.12	27.73	1,233	12,477.96	34,191.09	-
301513	尚 水 智 能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春 光 集 团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	13.30	51.56	269	3,577.70	13,869.64	-
301599	理 奇 智 能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	13.91	32.47	284	3,950.44	9,221.48	-
301666	大 普 微- UW	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	46.08	463.33	323	14,883.84	149,655.59	-
301669	高 特 电 子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新 股 流 通 受	7.08	28.40	493	3,490.44	14,001.20	-

				限						
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	93	5,394.00	10,430.88	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	58	4,546.04	7,062.66	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	153	3,776.04	13,280.40	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	45	1,704.60	1,569.15	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	159	2,814.30	13,406.88	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	106	4,343.88	32,668.14	-
688712	北	2026	6 个月	新	17.52	35.92	157	2,750.64	5,639.44	-

	芯生命	年 1 月 28 日		股流通受限						
688781	视涯科技-UW	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	520	11,793.60	24,757.20	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	89	3,965.84	41,711.63	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	63	5,158.44	99,812.79	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	769	4,929.29	18,555.97	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	198	5,203.44	34,073.82	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	96	5,371.20	5,481.60	-
688818	电科蓝	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流	9.47	70.14	702	6,647.94	49,238.28	-

	天	日		通 受 限						
688820	盛 合 晶 微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	19.68	141.49	349	6,868.32	49,380.01	-

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

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

本基金为指数型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国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，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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华泰证券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

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：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均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到

期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：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。

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	18,561,776.06	-	-	-	18,561,776.06
结算备付金	85,883.58	-	-	-	85,883.58
交易性金融资产	-	-	-	-240,050,737.71	240,050,737.71
应收申购款	-	-	-	2,301,218.24	2,301,218.24
资产总计	18,647,659.64	-	-	-242,351,955.95	260,999,615.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,261,313.03	3,261,313.03
应付管理人报酬	-	-	-	223,994.86	223,994.86
应付托管费	-	-	-	22,399.48	22,399.48
应付销售服务费	-	-	-	54,707.94	54,707.94
其他负债	-	-	-	81,147.75	81,147.75
负债总计	-	-	-	3,643,563.06	3,643,563.06
利率敏感度缺口	18,647,659.64	-	-	-238,708,392.89	257,356,052.53
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	16,657,977.22	-	-	-	16,657,977.22
结算备付金	85,565.11	-	-	-	85,565.11
交易性金融资产	-	-	-	-210,749,771.19	210,749,771.19
应收申购款	-	-	-	2,615,228.39	2,615,228.39
资产总计	16,743,542.33	-	-	-213,364,999.58	230,108,541.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,357,514.34	3,357,514.34
应付管理人报酬	-	-	-	186,123.76	186,123.76
应付托管费	-	-	-	18,612.38	18,612.38
应付销售服务费	-	-	-	46,703.90	46,703.90
其他负债	-	-	-	30,682.49	30,682.49
负债总计	-	-	-	3,639,636.87	3,639,636.87
利率敏感度缺口	16,743,542.33	-	-	-209,725,362.71	226,468,905.04

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：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

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：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。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份券和备选成份券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。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个券在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

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不低于 80%，投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%；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	240,050,737.71	93.28	210,749,771.19	93.06
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	240,050,737.71	93.28	210,749,771.19	93.06

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	11,319,805.97	10,142,409.91
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-11,319,805.97	-10,142,409.91

注：无。

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	239,249,496.10
第二层次	115,638.18
第三层次	685,603.43
合计	240,050,737.71

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	240,050,737.71	91.97

	其中：股票	240,050,737.71	91.97
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	18,647,659.64	7.14
8	其他各项资产	2,301,218.24	0.88
9	合计	260,999,615.59	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	525,373.40	0.20
B	采矿业	6,197,433.00	2.41
C	制造业	158,323,989.59	61.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,351,636.00	0.53
E	建筑业	2,013,126.60	0.78
F	批发和零售业	5,458,808.00	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	739,607.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,034,266.03	8.95
J	金融业	3,430,400.00	1.33
K	房地产业	403,104.00	0.16
L	租赁和商务服务业	1,506,715.00	0.59
M	科学研究和技术服务业	5,415,996.80	2.10
N	水利、环境和公共设施管理业	3,053,044.00	1.19
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	74,814.00	0.03
S	综合	39,105.00	0.02
	合计	211,567,418.42	82.21

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	84,088.00	0.03
B	采矿业	170,723.08	0.07
C	制造业	24,008,414.61	9.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	115,638.18	0.04
E	建筑业	163,212.00	0.06
F	批发和零售业	616,075.00	0.24
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	2,455,074.96	0.95
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	228,660.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	111,348.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	528,502.00	0.21
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	28,483,319.29	11.07

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：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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688503	聚和材料	20,100	2,667,270.00	1.04
2	688173	希荻微	136,430	2,611,270.20	1.01
3	603588	高能环境	129,300	2,482,560.00	0.96
4	688388	嘉元科技	56,170	2,471,480.00	0.96
5	688275	万润新能	18,400	2,346,920.00	0.91
6	600230	沧州大化	176,600	2,299,332.00	0.89
7	000603	盛达资源	96,700	2,233,770.00	0.87
8	600961	株冶集团	67,500	2,186,325.00	0.85
9	300681	英搏尔	71,456	2,045,070.72	0.79
10	300769	德方纳米	30,400	2,021,600.00	0.79
11	002810	山东赫达	80,200	1,980,940.00	0.77
12	688516	奥特维	34,257	1,966,009.23	0.76
13	300842	帝科股份	21,900	1,952,823.00	0.76
14	688653	康希通信	112,100	1,948,298.00	0.76
15	688559	海目星	22,908	1,922,439.36	0.75
16	688620	安凯微	117,800	1,908,360.00	0.74
17	688556	高测股份	142,855	1,897,114.40	0.74
18	002587	奥拓电子	240,500	1,878,305.00	0.73
19	002079	苏州固锝	123,700	1,859,211.00	0.72
20	000949	新乡化纤	277,000	1,756,180.00	0.68
21	301219	腾远钴业	30,930	1,694,964.00	0.66
22	688068	热景生物	19,449	1,684,283.40	0.65
23	002803	吉宏股份	64,800	1,674,432.00	0.65
24	002643	万润股份	77,500	1,623,625.00	0.63
25	600590	泰豪科技	157,400	1,589,740.00	0.62
26	603093	南华期货	87,000	1,579,050.00	0.61
27	300843	胜蓝股份	10,100	1,578,125.00	0.61
28	001339	智微智能	15,340	1,568,975.20	0.61
29	300290	ST 荣科	234,900	1,562,085.00	0.61
30	688416	恒烁股份	10,480	1,467,200.00	0.57
31	002284	亚太股份	154,300	1,464,307.00	0.57
32	300596	利安隆	27,900	1,464,192.00	0.57
33	688031	星环科技-U	12,535	1,443,781.30	0.56
34	300415	伊之密	71,400	1,421,574.00	0.55
35	688025	杰普特	3,000	1,410,000.00	0.55
36	300191	潜能恒信	50,800	1,404,620.00	0.55
37	002283	天润工业	145,200	1,401,180.00	0.54
38	001314	亿道信息	22,400	1,384,320.00	0.54

39	300590	移为通信	95,800	1,374,730.00	0.53
40	301087	可孚医疗	28,600	1,362,790.00	0.53
41	301396	宏景科技	4,100	1,359,560.00	0.53
42	603396	金辰股份	51,300	1,359,450.00	0.53
43	300887	谱尼测试	195,000	1,357,200.00	0.53
44	688717	艾罗能源	16,238	1,340,771.66	0.52
45	301150	中一科技	20,900	1,318,999.00	0.51
46	688095	福昕软件	21,900	1,301,517.00	0.51
47	300206	理邦仪器	101,300	1,238,899.00	0.48
48	300861	美畅股份	48,900	1,231,791.00	0.48
49	688059	华锐精密	6,000	1,198,260.00	0.47
50	301510	固高科技	36,900	1,178,217.00	0.46
51	301371	敷尔佳	43,800	1,138,800.00	0.44
52	002446	盛路通信	101,500	1,090,110.00	0.42
53	002911	佛燃能源	112,400	1,066,676.00	0.41
54	002757	南兴股份	58,600	1,057,730.00	0.41
55	601339	百隆东方	154,000	1,042,580.00	0.41
56	688390	固德威	9,600	1,041,696.00	0.40
57	002338	奥普光电	18,200	1,041,040.00	0.40
58	301153	中科江南	63,200	1,029,528.00	0.40
59	603317	天味食品	78,700	1,023,887.00	0.40
60	002956	西麦食品	48,640	1,009,766.40	0.39
61	300219	鸿利智汇	96,700	1,008,581.00	0.39
62	002948	青岛银行	195,100	991,108.00	0.39
63	002645	华宏科技	35,340	972,203.40	0.38
64	688202	美迪西	12,000	968,520.00	0.38
65	605599	菜百股份	70,300	963,110.00	0.37
66	002206	海利得	185,400	958,518.00	0.37
67	688107	安路科技	21,000	957,600.00	0.37
68	688166	博瑞医药	27,200	952,272.00	0.37
69	300684	中石科技	15,100	921,100.00	0.36
70	002258	利尔化学	72,300	918,933.00	0.36
71	301031	中熔电气	7,540	900,653.00	0.35
72	301221	光庭信息	30,440	898,284.40	0.35
73	688046	药康生物	36,877	892,423.40	0.35
74	300139	晓程科技	24,400	891,820.00	0.35
75	600971	恒源煤电	127,100	876,990.00	0.34
76	002342	巨力索具	83,300	875,483.00	0.34
77	600894	广日股份	114,800	874,776.00	0.34
78	688333	铂力特	8,405	860,672.00	0.33
79	603897	长城科技	26,500	860,190.00	0.33
80	601886	江河集团	107,100	860,013.00	0.33
81	688627	精智达	1,200	858,000.00	0.33

82	600686	金龙汽车	75,500	852,395.00	0.33
83	688733	壹石通	20,574	850,734.90	0.33
84	603995	甬金股份	36,100	837,881.00	0.33
85	300592	华凯易佰	46,200	817,740.00	0.32
86	002057	中钢天源	65,500	814,165.00	0.32
87	688049	炬芯科技	17,254	809,385.14	0.31
88	002745	木林森	63,500	796,925.00	0.31
89	002511	中顺洁柔	119,300	793,345.00	0.31
90	603966	法兰泰克	96,460	786,149.00	0.31
91	000551	创元科技	38,100	786,003.00	0.31
92	605222	起帆电缆	33,700	785,884.00	0.31
93	002843	泰嘉股份	36,600	785,802.00	0.31
94	600429	三元股份	193,800	782,952.00	0.30
95	002990	盛视科技	9,900	782,100.00	0.30
96	002345	潮宏基	84,400	773,948.00	0.30
97	688226	威腾电气	17,800	762,374.00	0.30
98	688410	山外山	52,549	754,603.64	0.29
99	603711	香飘飘	67,400	748,814.00	0.29
100	300055	万邦达	116,000	745,880.00	0.29
101	002668	TCL 智家	67,200	744,576.00	0.29
102	600428	中远海特	94,700	739,607.00	0.29
103	603016	新宏泰	21,900	739,344.00	0.29
104	002250	联化科技	53,900	736,813.00	0.29
105	002396	星网锐捷	38,110	730,568.70	0.28
106	300624	万兴科技	14,000	726,180.00	0.28
107	600496	精工钢构	231,600	717,960.00	0.28
108	300613	富瀚微	8,900	712,712.00	0.28
109	603915	国茂股份	50,100	710,919.00	0.28
110	603187	海容冷链	61,700	708,933.00	0.28
111	002833	弘亚数控	36,500	704,085.00	0.27
112	688321	微芯生物	26,518	698,218.94	0.27
113	002986	宇新股份	58,000	686,140.00	0.27
114	300322	硕贝德	26,400	665,280.00	0.26
115	301391	卡莱特	11,600	662,360.00	0.26
116	300098	高新兴	143,700	659,583.00	0.26
117	603889	新澳股份	128,090	654,539.90	0.25
118	002695	煌上煌	62,400	633,360.00	0.25
119	300428	立中集团	34,800	632,664.00	0.25
120	002961	瑞达期货	32,300	632,434.00	0.25
121	300453	三鑫医疗	68,600	620,144.00	0.24
122	002440	闰土股份	59,400	608,850.00	0.24
123	600808	马钢股份	242,700	606,750.00	0.24
124	000555	神州信息	58,200	599,460.00	0.23

125	688668	鼎通科技	1,600	597,280.00	0.23
126	301307	美利信	7,900	594,791.00	0.23
127	301487	盟固利	30,400	582,160.00	0.23
128	301215	中汽股份	111,100	576,609.00	0.22
129	301517	陕西华达	11,600	575,708.00	0.22
130	688311	盟升电子	21,900	573,561.00	0.22
131	300766	每日互动	26,500	567,100.00	0.22
132	688277	天智航-U	31,783	543,489.30	0.21
133	600742	富维股份	74,000	535,760.00	0.21
134	002929	润建股份	7,800	521,664.00	0.20
135	300224	正海磁材	39,000	519,870.00	0.20
136	301285	鸿日达	4,700	518,551.00	0.20
137	301326	捷邦科技	3,700	515,669.00	0.20
138	002946	新乳业	36,600	515,328.00	0.20
139	300369	绿盟科技	91,700	498,848.00	0.19
140	688515	裕太微-U	2,000	497,520.00	0.19
141	002297	博云新材	17,000	492,830.00	0.19
142	301382	蜂助手	10,700	492,200.00	0.19
143	300389	艾比森	38,200	489,724.00	0.19
144	000810	创维数字	36,100	478,325.00	0.19
145	688499	利元亨	9,100	478,205.00	0.19
146	688710	益诺思	7,077	475,574.40	0.18
147	002237	恒邦股份	32,300	474,487.00	0.18
148	600782	新钢股份	190,400	472,192.00	0.18
149	300740	水羊股份	25,600	471,296.00	0.18
150	603969	银龙股份	64,300	467,461.00	0.18
151	300049	福瑞医科	12,000	466,560.00	0.18
152	002293	罗莱生活	46,800	462,852.00	0.18
153	600502	安徽建工	105,600	459,360.00	0.18
154	002886	沃特股份	16,300	457,867.00	0.18
155	688609	九联科技	40,700	448,107.00	0.17
156	688087	英科再生	13,400	447,828.00	0.17
157	300397	天和防务	29,300	443,602.00	0.17
158	600108	亚盛集团	148,600	439,856.00	0.17
159	601068	中铝国际	101,700	439,344.00	0.17
160	300236	上海新阳	3,300	433,950.00	0.17
161	002428	云南锗业	3,600	432,648.00	0.17
162	000026	飞亚达	20,000	430,800.00	0.17
163	603629	利通电子	2,400	429,144.00	0.17
164	605255	天普股份	6,500	427,635.00	0.17
165	688378	奥来德	6,800	421,600.00	0.16
166	600201	生物股份	36,100	420,565.00	0.16
167	688639	华恒生物	26,000	419,640.00	0.16

168	002580	圣阳股份	20,800	419,328.00	0.16
169	300619	金银河	13,390	416,562.90	0.16
170	000682	东方电子	32,900	415,527.00	0.16
171	688228	开普云	5,315	411,062.10	0.16
172	300324	旋极信息	109,000	405,480.00	0.16
173	688196	卓越新能	11,278	404,880.20	0.16
174	001914	招商积余	49,400	403,104.00	0.16
175	300006	莱美药业	77,900	399,627.00	0.16
176	300662	科锐国际	23,500	399,030.00	0.16
177	000957	中通客车	42,500	397,800.00	0.15
178	002627	三峡旅游	69,400	396,274.00	0.15
179	002523	天桥起重	131,800	392,764.00	0.15
180	300331	苏大维格	5,500	391,105.00	0.15
181	002315	焦点科技	16,780	390,638.40	0.15
182	600273	嘉化能源	59,100	385,332.00	0.15
183	002204	大连重工	72,900	384,912.00	0.15
184	002401	中远海科	32,800	380,808.00	0.15
185	300041	回天新材	23,900	371,406.00	0.14
186	600710	苏美达	38,500	368,060.00	0.14
187	605118	力鼎光电	10,400	362,856.00	0.14
188	300398	飞凯材料	5,800	358,150.00	0.14
189	600389	江山股份	18,300	357,216.00	0.14
190	688258	卓易信息	3,000	355,620.00	0.14
191	603507	振江股份	10,800	355,212.00	0.14
192	002556	辉隆股份	78,300	350,784.00	0.14
193	300772	运达股份	28,500	350,550.00	0.14
194	605168	三人行	6,900	349,416.00	0.14
195	300696	爱乐达	13,400	348,802.00	0.14
196	300358	楚天科技	43,600	348,800.00	0.14
197	603538	美诺华	10,700	348,285.00	0.14
198	002483	润邦股份	70,400	347,776.00	0.14
199	688088	虹软科技	9,777	347,572.35	0.14
200	300790	宇瞳光学	12,960	338,385.60	0.13
201	301216	万凯新材	14,700	337,953.00	0.13
202	300909	汇创达	5,800	337,676.00	0.13
203	688337	普源精电	4,500	337,185.00	0.13
204	301086	鸿富瀚	1,600	334,848.00	0.13
205	300277	汽轮科技	22,100	332,384.00	0.13
206	688626	翔宇医疗	7,500	331,950.00	0.13
207	002376	新北洋	57,100	328,325.00	0.13
208	688125	安达智能	2,000	327,000.00	0.13
209	002181	粤传媒	32,800	326,360.00	0.13
210	300005	探路者	14,300	323,180.00	0.13

211	001301	尚太科技	3,400	317,934.00	0.12
212	002246	北化股份	16,900	317,720.00	0.12
213	000534	万泽股份	11,600	317,376.00	0.12
214	603063	禾望电气	6,000	317,340.00	0.12
215	603619	中曼石油	16,800	314,328.00	0.12
216	300416	苏试试验	15,400	313,852.00	0.12
217	688779	五矿新能	38,600	313,046.00	0.12
218	300409	道氏技术	15,700	312,901.00	0.12
219	000990	诚志股份	38,200	312,476.00	0.12
220	605016	百龙创园	12,000	310,200.00	0.12
221	688227	品高股份	3,000	308,070.00	0.12
222	002328	新朋股份	41,600	305,344.00	0.12
223	688372	伟测科技	1,600	297,600.00	0.12
224	688518	联赢激光	9,579	295,991.10	0.12
225	301162	国能日新	6,680	292,250.00	0.11
226	688799	华纳药厂	6,400	287,168.00	0.11
227	300351	永贵电器	17,400	287,100.00	0.11
228	300709	精研科技	5,100	286,875.00	0.11
229	001376	百通能源	27,400	284,960.00	0.11
230	000923	河钢资源	22,500	279,225.00	0.11
231	688023	安恒信息	7,514	275,914.08	0.11
232	002182	宝武镁业	17,600	274,032.00	0.11
233	002912	中新赛克	14,500	267,380.00	0.10
234	002221	东华能源	50,700	266,682.00	0.10
235	002400	省广集团	42,100	265,651.00	0.10
236	301095	广立微	2,200	259,710.00	0.10
237	002443	金洲管道	27,100	258,263.00	0.10
238	688486	龙迅股份	4,020	255,591.60	0.10
239	002758	浙农股份	32,300	255,170.00	0.10
240	688308	欧科亿	1,400	254,534.00	0.10
241	600391	航发科技	7,400	247,530.00	0.10
242	002398	垒知集团	65,400	245,250.00	0.10
243	600750	华润江中	11,100	244,977.00	0.10
244	002245	蔚蓝锂芯	13,000	243,230.00	0.09
245	300440	运达科技	11,400	243,162.00	0.09
246	002923	润都股份	25,700	243,122.00	0.09
247	688400	凌云光	3,650	241,630.00	0.09
248	300337	银邦股份	20,700	241,362.00	0.09
249	002636	金安国纪	2,000	239,940.00	0.09
250	000049	德赛电池	10,100	236,037.00	0.09
251	002090	金智科技	26,700	236,028.00	0.09
252	002117	东港股份	29,200	230,096.00	0.09
253	688062	迈威生物-U	8,137	229,870.25	0.09

254	601963	重庆银行	22,600	227,808.00	0.09
255	000922	佳电股份	16,280	227,268.80	0.09
256	002560	通达股份	30,460	226,622.40	0.09
257	001267	汇绿生态	4,200	224,700.00	0.09
258	002301	齐心集团	31,000	224,130.00	0.09
259	300504	天邑股份	13,600	219,368.00	0.09
260	603270	金帝股份	6,400	214,464.00	0.08
261	688208	道通科技	8,496	214,014.24	0.08
262	688167	炬光科技	580	205,441.80	0.08
263	600388	龙净环保	14,100	205,155.00	0.08
264	002110	三钢闽光	70,700	203,616.00	0.08
265	300072	海新能科	59,200	201,280.00	0.08
266	300986	志特新材	11,700	200,655.00	0.08
267	002192	融捷股份	2,200	196,680.00	0.08
268	002985	北摩高科	7,100	196,670.00	0.08
269	002614	奥佳华	44,400	196,248.00	0.08
270	600335	国机汽车	40,900	191,412.00	0.07
271	002733	雄韬股份	6,100	188,978.00	0.07
272	002960	青鸟智控	22,160	187,695.20	0.07
273	688691	灿芯股份	1,600	185,488.00	0.07
274	000612	焦作万方	17,300	183,207.00	0.07
275	300913	兆龙互连	3,800	182,058.00	0.07
276	605167	利柏特	11,200	180,320.00	0.07
277	603992	松霖科技	5,500	178,200.00	0.07
278	000589	贵州轮胎	43,800	177,828.00	0.07
279	600320	振华重工	42,900	177,177.00	0.07
280	603216	梦天家居	8,600	176,902.00	0.07
281	300036	超图软件	15,400	173,558.00	0.07
282	300443	金雷股份	8,000	172,640.00	0.07
283	688182	灿勤科技	4,000	172,280.00	0.07
284	002448	中原内配	13,500	166,050.00	0.06
285	300911	亿田智能	7,800	165,750.00	0.06
286	301058	中粮科工	21,300	165,714.00	0.06
287	600866	星湖科技	37,100	162,869.00	0.06
288	002590	万安科技	15,900	159,000.00	0.06
289	603416	信捷电气	3,000	158,610.00	0.06
290	603686	福龙马	12,000	155,040.00	0.06
291	300602	飞荣达	3,000	153,600.00	0.06
292	603012	创力集团	18,500	151,700.00	0.06
293	002637	赞宇科技	14,300	150,579.00	0.06
294	002544	普天科技	8,200	149,404.00	0.06
295	601579	会稽山	10,100	148,369.00	0.06
296	003012	东鹏控股	33,900	147,804.00	0.06

297	600728	佳都科技	34,600	147,396.00	0.06
298	300951	博硕科技	2,900	146,450.00	0.06
299	688168	安博通	2,120	145,750.00	0.06
300	300233	金城医药	11,600	143,840.00	0.06
301	688159	有方科技	3,200	142,048.00	0.06
302	002455	百川股份	19,700	141,840.00	0.06
303	688084	晶品特装	2,800	140,784.00	0.05
304	300032	金龙机电	36,800	139,840.00	0.05
305	002534	西子洁能	7,400	137,270.00	0.05
306	301096	百诚医药	2,400	137,256.00	0.05
307	002216	三全食品	11,800	136,054.00	0.05
308	301607	富特科技	2,600	135,850.00	0.05
309	688279	峰昭科技	600	134,664.00	0.05
310	300497	富祥股份	6,000	132,960.00	0.05
311	688593	新相微	3,400	132,328.00	0.05
312	300685	艾德生物	7,800	131,352.00	0.05
313	688259	创耀科技	3,300	129,096.00	0.05
314	301608	博实结	2,482	124,745.32	0.05
315	605228	神通科技	9,100	122,213.00	0.05
316	300232	洲明科技	21,000	120,330.00	0.05
317	000592	平潭发展	17,900	119,751.00	0.05
318	603590	康辰药业	4,100	118,941.00	0.05
319	002454	松芝股份	24,640	117,779.20	0.05
320	300342	天银机电	2,500	117,500.00	0.05
321	001208	华菱线缆	8,100	114,939.00	0.04
322	301328	维峰电子	1,595	113,564.00	0.04
323	301191	菲菱科思	1,000	113,550.00	0.04
324	300063	天龙集团	13,000	112,840.00	0.04
325	300490	华自科技	8,500	112,455.00	0.04
326	300393	中来股份	14,600	106,434.00	0.04
327	002296	辉煌科技	11,300	100,344.00	0.04
328	002588	史丹利	12,200	96,380.00	0.04
329	002020	京新药业	7,700	96,173.00	0.04
330	002148	北纬科技	16,500	95,865.00	0.04
331	002218	拓日新能	23,700	91,008.00	0.04
332	300085	银之杰	2,600	90,922.00	0.04
333	002324	普利特	7,500	90,525.00	0.04
334	301005	超捷股份	800	89,248.00	0.03
335	002838	道恩股份	2,900	88,798.00	0.03
336	688091	上海谊众	2,114	84,982.80	0.03
337	002967	广电计量	4,600	83,030.00	0.03
338	002895	川恒股份	2,800	81,760.00	0.03
339	688660	电气风电	9,400	81,028.00	0.03

340	688238	和元生物	14,700	79,674.00	0.03
341	300976	达瑞电子	1,000	79,650.00	0.03
342	002073	软控股份	15,200	78,128.00	0.03
343	301128	强瑞技术	500	77,950.00	0.03
344	301529	福赛科技	800	77,088.00	0.03
345	600158	中体产业	11,100	74,814.00	0.03
346	301039	中集车辆	10,600	74,730.00	0.03
347	601388	怡球资源	26,400	74,712.00	0.03
348	603112	华翔股份	4,200	70,266.00	0.03
349	002364	中恒电气	1,300	69,940.00	0.03
350	300825	阿尔特	4,800	68,544.00	0.03
351	000915	华特达因	2,400	67,944.00	0.03
352	300271	华宇软件	13,900	66,998.00	0.03
353	301330	熵基科技	2,600	65,156.00	0.03
354	300571	平治信息	1,400	63,924.00	0.02
355	000735	罗牛山	12,900	61,275.00	0.02
356	688409	富创精密	200	61,250.00	0.02
357	301085	亚康股份	1,000	60,610.00	0.02
358	002116	中国海诚	8,960	60,569.60	0.02
359	300532	今天国际	9,720	60,555.60	0.02
360	688108	赛诺医疗	3,213	59,536.89	0.02
361	603950	长源东谷	700	59,101.00	0.02
362	603158	腾龙股份	4,800	58,704.00	0.02
363	603901	永创智能	5,400	58,698.00	0.02
364	301339	通行宝	5,400	55,242.00	0.02
365	300227	光韵达	4,600	54,740.00	0.02
366	002026	山东威达	5,000	54,000.00	0.02
367	300582	英飞特	4,400	53,592.00	0.02
368	000058	深赛格	8,700	53,418.00	0.02
369	301251	威尔高	1,000	53,280.00	0.02
370	300846	首都在线	2,500	53,025.00	0.02
371	688327	云从科技-UW	3,950	49,217.00	0.02
372	301558	三态股份	7,900	48,743.00	0.02
373	605056	咸亨国际	3,000	48,000.00	0.02
374	300357	我武生物	2,000	46,640.00	0.02
375	000576	甘化科工	6,700	44,019.00	0.02
376	300184	力源信息	2,500	43,875.00	0.02
377	603301	振德医疗	500	43,580.00	0.02
378	600330	天通股份	1,400	43,176.00	0.02
379	301603	乔锋智能	300	43,140.00	0.02
380	300101	振芯科技	2,600	42,042.00	0.02
381	002933	新兴装备	1,600	41,360.00	0.02
382	300552	万集科技	1,800	41,130.00	0.02

383	600620	天宸股份	9,900	39,105.00	0.02
384	600251	冠农股份	4,400	38,016.00	0.01
385	605196	华通线缆	1,400	36,540.00	0.01
386	300048	合康新能	7,200	33,624.00	0.01
387	603611	诺力股份	2,000	32,380.00	0.01
388	002801	微光股份	1,100	30,360.00	0.01
389	001311	多利科技	1,820	29,356.60	0.01
390	603085	天成自控	2,700	29,349.00	0.01
391	002996	顺博合金	4,800	28,320.00	0.01
392	603026	石大胜华	300	26,811.00	0.01
393	000030	富奥股份	6,500	25,155.00	0.01
394	002983	芯瑞达	900	24,912.00	0.01
395	000969	安泰科技	1,000	24,540.00	0.01
396	002885	京泉华	600	24,516.00	0.01
397	300423	昇辉科技	4,400	24,244.00	0.01
398	002458	益生股份	3,120	24,242.40	0.01
399	688239	航宇科技	400	23,932.00	0.01
400	301117	佳缘科技	980	22,883.00	0.01
401	300569	天能重工	4,700	22,654.00	0.01
402	300814	中富电路	100	20,450.00	0.01
403	688191	智洋创新	560	19,992.00	0.01
404	002557	洽洽食品	1,100	19,756.00	0.01
405	300401	花园生物	900	19,701.00	0.01
406	301571	国科天成	300	19,554.00	0.01
407	688480	赛恩斯	200	17,518.00	0.01
408	605507	国邦医药	1,140	16,872.00	0.01
409	300785	值得买	400	14,668.00	0.01
410	603815	交建股份	2,600	13,520.00	0.01
411	300850	新强联	400	10,720.00	0.00
412	688063	派能科技	200	10,654.00	0.00
413	301662	宏工科技	100	10,132.00	0.00
414	600480	凌云股份	1,100	9,141.00	0.00
415	300134	大富科技	700	5,985.00	0.00
416	000919	金陵药业	700	4,081.00	0.00
417	002565	顺灏股份	300	3,801.00	0.00
418	002033	丽江股份	200	1,652.00	0.00

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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688110	东芯股份	8,800	1,792,560.00	0.70
2	688045	必易微	17,500	1,413,650.00	0.55
3	301358	湖南裕能	17,000	1,289,790.00	0.50

4	688498	源杰科技	680	1,282,480.00	0.50
5	688766	普冉股份	1,597	1,224,260.20	0.48
6	603083	剑桥科技	4,800	1,223,376.00	0.48
7	600595	中孚实业	210,400	1,182,448.00	0.46
8	300658	延江股份	101,500	1,160,145.00	0.45
9	688002	睿创微纳	5,900	912,671.00	0.35
10	301189	奥尼电子	12,000	707,160.00	0.27
11	688195	腾景科技	3,200	616,256.00	0.24
12	300953	震裕科技	4,360	582,932.00	0.23
13	603986	兆易创新	700	570,500.00	0.22
14	300223	北京君正	2,200	547,580.00	0.21
15	600499	科达制造	37,800	521,640.00	0.20
16	301002	崧盛股份	13,500	521,100.00	0.20
17	002266	浙富控股	91,700	464,002.00	0.18
18	002402	和而泰	16,600	428,778.00	0.17
19	300475	香农芯创	1,400	420,000.00	0.16
20	300118	东方日升	33,100	412,095.00	0.16
21	600105	永鼎股份	6,000	404,880.00	0.16
22	603345	安井食品	4,800	384,912.00	0.15
23	300870	欧陆通	1,080	373,345.20	0.15
24	300407	凯发电气	33,200	358,560.00	0.14
25	600973	宝胜股份	48,700	345,283.00	0.13
26	300432	富临精工	15,500	311,395.00	0.12
27	000951	中国重汽	15,500	302,405.00	0.12
28	002413	雷科防务	29,100	284,016.00	0.11
29	300919	中伟新材	6,200	271,250.00	0.11
30	603778	国晟科技	21,800	268,140.00	0.10
31	301159	三维天地	9,200	267,720.00	0.10
32	300773	拉卡拉	15,940	243,882.00	0.09
33	688677	海泰新光	2,400	242,712.00	0.09
34	300073	当升科技	5,000	240,200.00	0.09
35	600343	航天动力	8,200	229,764.00	0.09
36	002532	天山铝业	21,400	229,622.00	0.09
37	002115	三维通信	22,200	228,660.00	0.09
38	002008	大族激光	1,500	225,165.00	0.09
39	688028	沃尔德	1,400	218,218.00	0.08
40	300464	星徽股份	27,500	196,075.00	0.08
41	300473	德尔股份	6,300	191,520.00	0.07
42	601677	明泰铝业	11,000	182,600.00	0.07
43	300438	鹏辉能源	2,200	182,270.00	0.07
44	300034	钢研高纳	9,700	166,258.00	0.06
45	300270	中威电子	12,700	165,227.00	0.06
46	603929	亚翔集成	600	163,212.00	0.06

47	600037	歌华有线	24,600	154,242.00	0.06
48	688369	致远互联	7,296	153,288.96	0.06
49	688215	瑞晟智能	3,800	152,608.00	0.06
50	301666	大普微-UW	323	149,655.59	0.06
51	688783	西安奕材-U	2,301	142,477.92	0.06
52	603308	应流股份	2,300	138,920.00	0.05
53	601126	四方股份	2,100	132,720.00	0.05
54	001248	华润新能源	11,438	115,638.18	0.04
55	300700	岱勒新材	5,400	114,912.00	0.04
56	002136	安纳达	8,700	113,796.00	0.04
57	600841	动力新科	17,900	109,190.00	0.04
58	688795	摩尔线程-U	148	106,040.52	0.04
59	300605	恒锋信息	11,400	105,336.00	0.04
60	300012	华测检测	7,400	102,564.00	0.04
61	688048	长光华芯	200	100,400.00	0.04
62	300164	通源石油	12,500	100,000.00	0.04
63	600801	华新建材	6,400	99,840.00	0.04
64	688808	联讯仪器	63	99,812.79	0.04
65	002850	科达利	500	94,650.00	0.04
66	001309	德明利	100	94,290.00	0.04
67	002487	大金重工	1,600	92,752.00	0.04
68	600362	江西铜业	2,100	90,930.00	0.04
69	300779	惠城环保	1,800	90,360.00	0.04
70	300450	先导智能	2,200	89,584.00	0.03
71	002998	优彩资源	13,200	85,932.00	0.03
72	300970	华绿生物	4,600	84,088.00	0.03
73	002222	福晶科技	900	83,052.00	0.03
74	300390	天华新能	700	65,457.00	0.03
75	300774	倍杰特	6,000	64,500.00	0.03
76	000933	神火股份	3,000	63,600.00	0.02
77	688737	中自科技	3,000	57,420.00	0.02
78	300548	长芯博创	200	55,600.00	0.02
79	688090	瑞松科技	520	55,354.00	0.02
80	002558	巨人网络	1,800	49,608.00	0.02
81	688820	盛合晶微	349	49,380.01	0.02
82	688818	电科蓝天	702	49,238.28	0.02
83	600497	驰宏锌锗	3,900	47,229.00	0.02
84	000630	铜陵有色	7,200	45,792.00	0.02
85	600549	厦门钨业	500	42,600.00	0.02
86	688251	井松智能	1,650	42,289.50	0.02
87	688797	臻宝科技	89	41,711.63	0.02
88	300837	浙矿股份	1,700	40,392.00	0.02
89	603766	隆鑫通用	3,200	38,176.00	0.01

90	300767	震安科技	1,600	35,664.00	0.01
91	688345	博力威	600	34,848.00	0.01
92	001399	惠科股份	1,233	34,191.09	0.01
93	688813	泰金新能	198	34,073.82	0.01
94	300857	协创数据	100	33,990.00	0.01
95	002378	章源钨业	1,000	33,480.00	0.01
96	300645	正元智慧	2,800	32,956.00	0.01
97	688635	长进光子	106	32,668.14	0.01
98	000975	山金国际	1,500	25,500.00	0.01
99	688220	翱捷科技-U	200	24,864.00	0.01
100	688781	视涯科技-UW	520	24,757.20	0.01
101	603979	金诚信	400	23,612.00	0.01
102	688119	中钢洛耐	4,650	22,087.50	0.01
103	001257	盛龙股份	1,042	21,611.08	0.01
104	600577	精达股份	2,200	21,516.00	0.01
105	300157	新锦动力	5,400	19,926.00	0.01
106	301656	联合动力	1,156	19,917.88	0.01
107	300971	博亚精工	1,000	18,660.00	0.01
108	688811	有研复材	769	18,555.97	0.01
109	002410	广联达	2,200	17,952.00	0.01
110	000729	燕京啤酒	1,700	17,221.00	0.01
111	688246	嘉和美康	800	16,440.00	0.01
112	301669	高特电子	493	14,001.20	0.01
113	301531	春光集团	269	13,869.64	0.01
114	600884	杉杉股份	1,000	13,550.00	0.01
115	603459	红板科技	159	13,406.88	0.01
116	301696	三瑞智能	153	13,280.40	0.01
117	301680	固德电材	93	10,430.88	0.00
118	002591	恒大高新	1,700	10,404.00	0.00
119	301599	理奇智能	284	9,221.48	0.00
120	301136	招标股份	800	8,784.00	0.00
121	001365	天海电子	252	7,890.12	0.00
122	301683	慧谷新材	58	7,062.66	0.00
123	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
124	001393	维通利	180	7,018.20	0.00
125	001237	惠康科技	106	6,226.44	0.00
126	688712	北芯生命	157	5,639.44	0.00
127	688816	易思维	96	5,481.60	0.00
128	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
129	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
130	603284	林平发展	45	1,569.15	0.00
131	001312	福恩股份	82	1,375.96	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	5,644,775.16	2.49
2	300505	川金诺	3,991,975.00	1.76
3	688416	恒烁股份	3,964,943.10	1.75
4	688577	浙海德曼	3,927,579.05	1.73
5	688031	星环科技-U	3,869,792.18	1.71
6	000603	盛达资源	3,793,974.17	1.68
7	300842	帝科股份	3,672,734.00	1.62
8	002803	吉宏股份	3,639,146.00	1.61
9	300290	ST 荣科	3,531,511.00	1.56
10	002943	宇晶股份	3,445,084.00	1.52
11	600230	沧州大化	3,440,327.00	1.52
12	603588	高能环境	3,359,411.00	1.48
13	688025	杰普特	3,331,502.50	1.47
14	002284	亚太股份	3,275,485.00	1.45
15	300139	晓程科技	3,227,571.00	1.43
16	300624	万兴科技	3,123,050.00	1.38
17	002911	佛燃能源	3,090,385.00	1.36
18	300322	硕贝德	2,950,397.00	1.30
19	002639	雪人集团	2,800,035.00	1.24
20	605255	天普股份	2,755,950.00	1.22

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	300505	川金诺	4,995,293.00	2.21
2	002943	宇晶股份	4,547,308.00	2.01
3	688577	浙海德曼	3,905,294.02	1.72
4	688025	杰普特	3,714,048.39	1.64
5	688416	恒烁股份	3,692,954.14	1.63
6	300739	明阳电路	3,657,237.00	1.61
7	688516	奥特维	3,428,193.74	1.51
8	688661	和林微纳	3,220,326.83	1.42
9	603876	鼎胜新材	3,161,863.00	1.40
10	002440	闰土股份	3,119,428.00	1.38
11	002913	奥士康	3,050,142.35	1.35
12	301095	广立微	3,038,440.00	1.34
13	603588	高能环境	2,982,458.00	1.32
14	002645	华宏科技	2,953,023.60	1.30

15	002639	雪人集团	2,931,457.00	1.29
16	300244	迪安诊断	2,847,423.23	1.26
17	688766	普冉股份	2,788,444.14	1.23
18	300139	晓程科技	2,749,284.00	1.21
19	301110	青木科技	2,737,670.00	1.21
20	688556	高测股份	2,673,863.80	1.18

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	595,919,942.71
卖出股票收入（成交）总额	602,255,849.88

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：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

注：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

注：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

注：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

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果。

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

盛达金属资源股份有限公司在报告期内被中国证券监督管理委员会立案调查。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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	2,301,218.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,301,218.24

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

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：无。

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

注：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

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
鹏华国证 2000 指数 增强 A	7,736	6,639.53	18,422.67	0.04	51,345,013.90	99.96
鹏华国证 2000 指数 增强 C	14,096	6,436.27	2,679,800.61	2.95	88,045,919.77	97.05
鹏华国证 2000 指数 增强 I	71	5,812.05	0.00	0.00	412,655.63	100.00
合计	21,903	6,506.04	2,698,223.28	1.89	139,803,589.30	98.11

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	鹏华国证 2000 指数增强 A	600,763.63	1.1696
	鹏华国证 2000 指数增强 C	—	—
	鹏华国证 2000 指数增强 I	193,944.49	46.9991
	合计	794,708.12	0.5577

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	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	鹏华国证 2000 指数增强 A	10~50
	鹏华国证 2000 指数增强 C	—
	鹏华国证 2000 指数增强 I	—
	合计	10~50
本基金基金经理持有 本开放式基金	鹏华国证 2000 指数增强 A	—
	鹏华国证 2000 指数增强 C	—
	鹏华国证 2000 指数增强 I	—
	合计	—

注：1、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。

2、截至本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华国证 2000 指数增强 A	鹏华国证 2000 指数增强 C	鹏华国证 2000 指数增强 I
基金合同生效日（2023 年 2 月 21 日）基金份额总额	143,679,062.77	326,932,598.74	—
本报告期期初基金份额总额	58,632,691.09	84,293,990.26	118,670.07
本报告期基金总申购份额	71,501,067.28	205,735,536.91	1,288,595.79
减：本报告期基金总赎回份额	78,770,321.80	199,303,806.79	994,610.23
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	51,363,436.57	90,725,720.38	412,655.63

§ 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

注：无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

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（即资产托管部）及其该部门高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

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（即资产托管部）相关从业人员不存在受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
华泰证券	3	1,197,049,279.18	100.00	234,545.34	100.00	-

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(%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 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 01 月 21 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
5	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金（C 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《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 05 日
6	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金（A 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《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 05 日
7	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书	《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 05 日
8	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金（I 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《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 05 日
9	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资	《证券时报》、基金管	2026 年 03 月 30 日

	基金 2025 年年度报告	理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	
10	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
11	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
12	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
13	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金 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
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

注：无。

§ 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

- （一）《鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金 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