

# 鹏华安益增强混合型证券投资基金 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：中国工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。

基金托管人中国工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

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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                              | 8         |
| 2.5 其他相关资料                              | 8         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 9         |
| 3.3 其他指标                                | 12        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 12        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 15        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 15        |
| 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             | 15        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 17        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 18        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 18        |
| 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       | 19        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>19</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 19        |
| 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 | 19        |
| 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       | 19        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>19</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 19        |
| 6.2 利润表                                 | 21        |
| 6.3 净资产变动表                              | 22        |
| 6.4 报表附注                                | 24        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>46</b> |
| 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       | 48        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 56        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 57        |
| 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      | 57        |
| 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   | 58        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 58        |
| 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 .....    | 58        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 58        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 58        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 58        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>59</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 59        |
| 8.2 盈利投资者数量占比 .....                         | 59        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 59        |
| 8.4 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 .....      | 60        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>60</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>61</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 61        |
| 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 .....      | 61        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 61        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 61        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 61        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....          | 61        |
| 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 .....      | 61        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 64        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>65</b> |
| 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 .....    | 65        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 65        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>65</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 65        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 66        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 66        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                     |                  |                |                  |
|---------------------|------------------|----------------|------------------|
| 基金名称                | 鹏华安益增强混合型证券投资基金  |                |                  |
| 基金简称                | 鹏华安益增强混合         |                |                  |
| 基金主代码               | 004100           |                |                  |
| 基金运作方式              | 契约型开放式           |                |                  |
| 基金合同生效日             | 2017 年 2 月 22 日  |                |                  |
| 基金管理人               | 鹏华基金管理有限公司       |                |                  |
| 基金托管人               | 中国工商银行股份有限公司     |                |                  |
| 报告期末基金份<br>额总额      | 188,771,118.60 份 |                |                  |
| 基金合同存续期             | 不定期              |                |                  |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 鹏华安益增强混合 A       | 鹏华安益增强混合 C     | 鹏华安益增强混合 D       |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 022369           | 022370         | 004100           |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 229,128.73 份     | 1,109,419.77 份 | 187,432,570.10 份 |

2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金在科学严谨的资产配置框架下，严选安全边际较高的股票、债券等投资标的，力争实现基金资产的稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1）自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2）自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。</p> <p>（1）自上而下的行业遴选</p> <p>本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。</p> <p>（2）自下而上的个股选择</p> <p>本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。</p> <p>1）定性分析</p> <p>本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司：</p> <p>一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。</p> <p>另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。</p> <p>2）定量分析</p> <p>本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。</p> <p>（3）存托凭证投资策略</p> <p>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。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>（1）久期策略</p> <p>久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。</p> <p>（2）收益率曲线策略</p> <p>收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。</p> <p>（3）骑乘策略</p> <p>本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。</p> <p>（4）息差策略</p> <p>本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。</p> <p>（5）个券选择策略</p> |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。</p> <p>(6) 信用策略</p> <p>本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略</p> <p>中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。</p> <p>6、资产支持证券的投资策略</p> <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | 30%×沪深 300 指数收益率+70%×中证全债指数收益率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

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                     | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 高永杰                            | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 0755-81395402                  | (010)66105799       |
|             | 电子邮箱 | xxpl@phfund.com.cn             | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 4006788533                     | 95588               |
| 传真          |      | 0755-82021126                  | (010)66105798       |
| 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 | 北京市西城区复兴门内大街 55 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 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 邮政编码        |      | 518048                         | 100140              |
| 法定代表人       |      | 张纳沙                            | 廖林                  |

2.4 信息披露方式

|                   |                                                                 |
|-------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 《上海证券报》                                                         |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | <a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a> |
| 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) |            |               |
|---------------|-------------------------------------|------------|---------------|
|               | 鹏华安益增强混合 A                          | 鹏华安益增强混合 C | 鹏华安益增强混合 D    |
| 本期已实现收益       | 1,876.06                            | 9,595.06   | 4,454,399.69  |
| 本期利润          | 2,929.12                            | 22,415.85  | 6,239,470.58  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0155                              | 0.0287     | 0.0288        |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.48%                               | 2.74%      | 2.02%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.24%                               | 2.19%      | 2.34%         |
| 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      | 11,827.33                           | 55,995.74  | 82,914,699.44 |

|              |                       |              |                |
|--------------|-----------------------|--------------|----------------|
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0516                | 0.0505       | 0.4424         |
| 期末基金资产净值     | 243,103.52            | 1,175,785.58 | 270,347,269.54 |
| 期末基金份额净值     | 1.0610                | 1.0598       | 1.4424         |
| 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  | 6.10%                 | 5.98%        | 47.63%         |

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

鹏华安益增强混合 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      | 2.64%    | 0.20%       | 4.48%      | 0.38%         | -1.84% | -0.18% |
| 过去六个月      | 2.24%    | 0.19%       | 3.94%      | 0.34%         | -1.70% | -0.15% |
| 过去一年       | 4.79%    | 0.15%       | 8.83%      | 0.30%         | -4.04% | -0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.10%    | 0.14%       | 12.16%     | 0.30%         | -6.06% | -0.16% |

鹏华安益增强混合 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          | 2.61% | 0.19% | 4.48%  | 0.38% | -1.87% | -0.19% |
| 过去六个月          | 2.19% | 0.19% | 3.94%  | 0.34% | -1.75% | -0.15% |
| 过去一年           | 4.70% | 0.15% | 8.83%  | 0.30% | -4.13% | -0.15% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 5.98% | 0.14% | 12.16% | 0.30% | -6.18% | -0.16% |

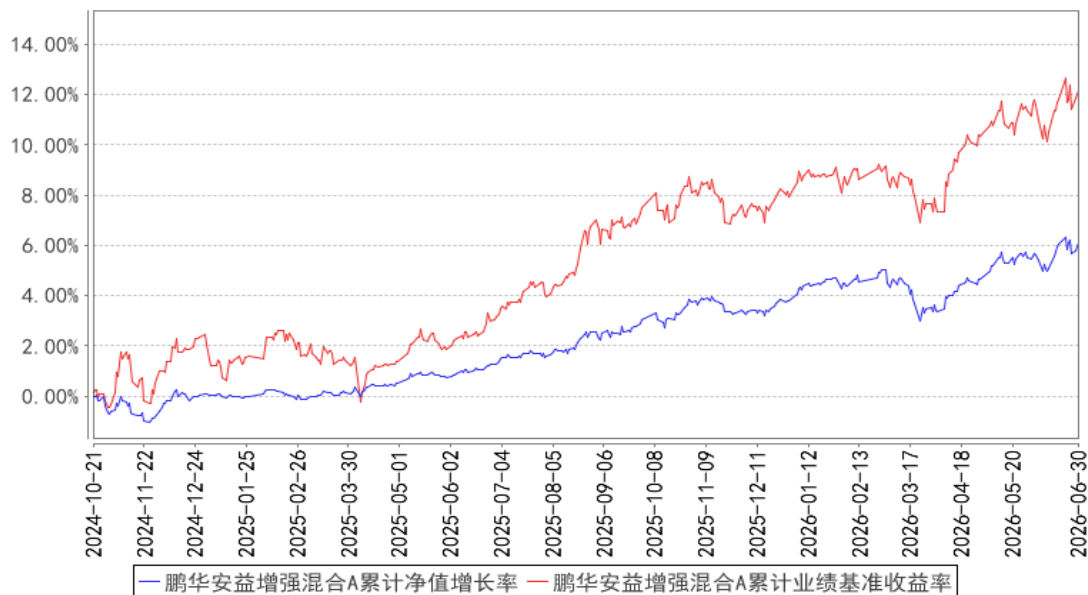
鹏华安益增强混合 D

| 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          | 2.70%    | 0.19%       | 4.48%      | 0.38%         | -1.78%  | -0.19% |
| 过去六个月          | 2.34%    | 0.19%       | 3.94%      | 0.34%         | -1.60%  | -0.15% |
| 过去一年           | 5.02%    | 0.15%       | 8.83%      | 0.30%         | -3.81%  | -0.15% |
| 过去三年           | 8.82%    | 0.13%       | 19.88%     | 0.32%         | -11.06% | -0.19% |
| 过去五年           | 9.18%    | 0.17%       | 17.67%     | 0.33%         | -8.49%  | -0.16% |
| 过去七年           | 30.23%   | 0.20%       | 37.90%     | 0.34%         | -7.67%  | -0.14% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 47.63%   | 0.19%       | 54.26%     | 0.34%         | -6.63%  | -0.15% |

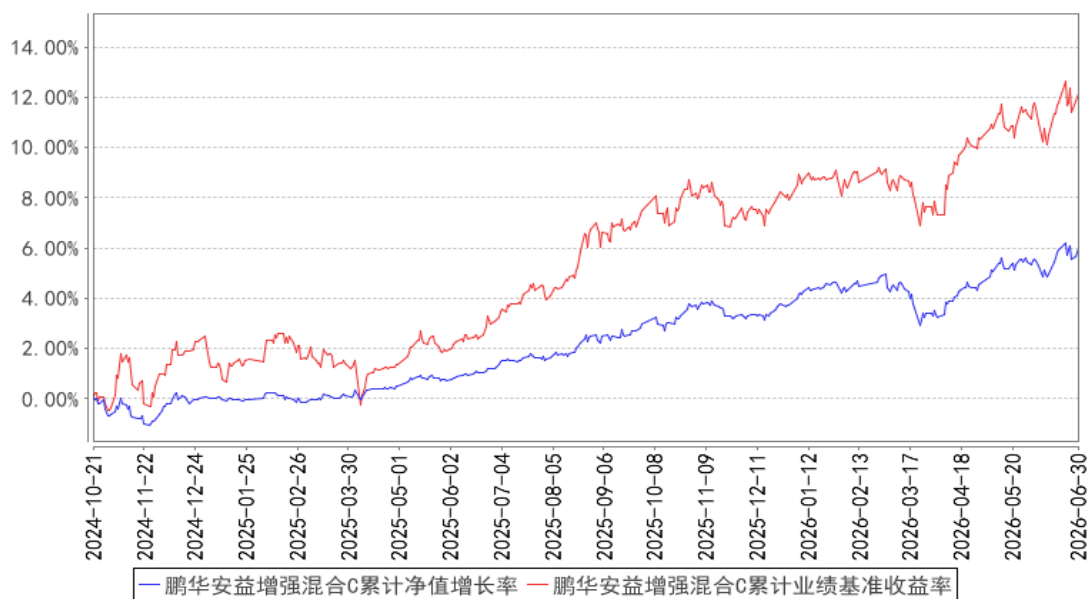
注：业绩比较基准=30%×沪深 300 指数收益率+70%×中证全债指数收益率。

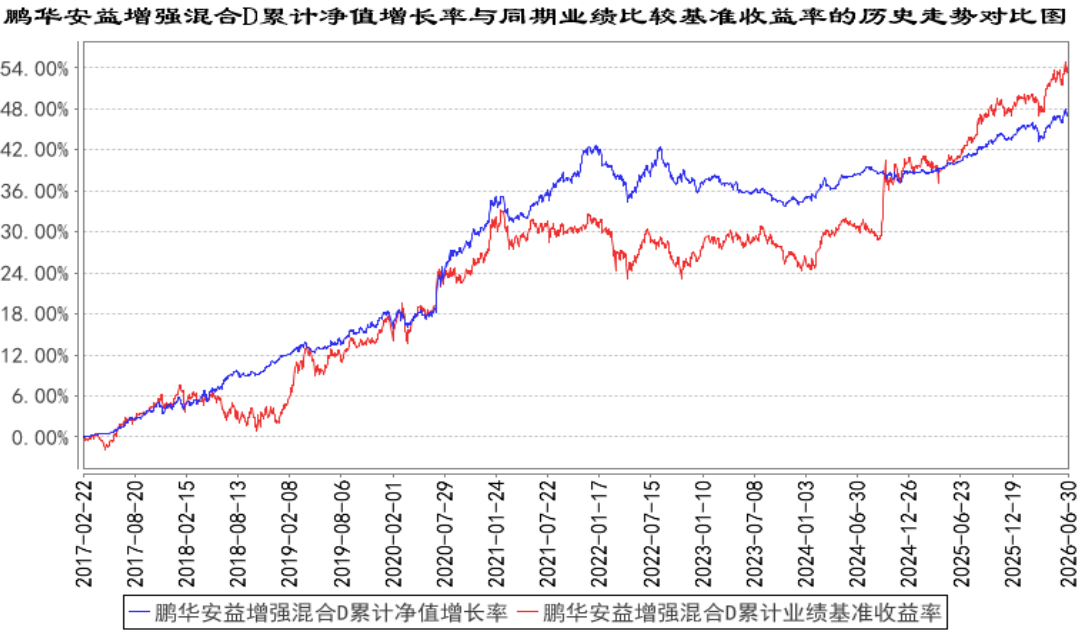
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华安益增强混合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



鹏华安益增强混合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





注：1、本基金基金合同于 2017 年 02 月 22 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。

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 |        |                                            |
| 方昶 | 本基金的基金经理 | 2019-03-22      | -    | 12 年   | 方昶先生, 国籍中国, 经济学硕士, 12 年证券从业经验。曾任中国工商银行资产管理 |

|     |          |            |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----|----------|------------|---|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          |            |   |     | <p>理部投资经理；2016 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任债券投资一部基金经理、总经理助理/基金经理、多元资产投资部副总经理/基金经理。现担任多元资产投资部联席总经理/基金经理。2018 年 07 月至 2020 年 02 月担任鹏华丰腾债券型证券投资基金基金经理，2018 年 10 月至今担任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理，2018 年 12 月至 2020 年 02 月担任鹏华丰华债券型证券投资基金基金经理，2019 年 01 月至今担任鹏华丰恒债券型证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至今担任鹏华安益增强混合型证券投资基金基金经理，2019 年 06 月至 2022 年 08 月担任鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 09 月至 2021 年 01 月担任鹏华中短债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2019 年 09 月至今担任鹏华丰享债券型证券投资基金基金经理，2020 年 12 月至 2025 年 12 月担任鹏华安润混合型证券投资基金基金经理，2021 年 06 月至 2025 年 01 月担任鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 07 月至 2023 年 10 月担任鹏华永泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2022 年 09 月至今担任鹏华丰启债券型证券投资基金基金经理，2023 年 03 月至今担任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理，2023 年 04 月至今担任鹏华稳健添利债券型证券投资基金基金经理，2024 年 03 月至今担任鹏华稳益 180 天持有期债券型证券投资基金基金经理，2025 年 10 月至今担任鹏华睿丰债券型证券投资基金基金经理，2026 年 02 月至今担任鹏华添鑫 90 天持有期债券型证券投资基金基金经理，方昶先生具备基金从业资格。</p> |
| 寇斌权 | 本基金的基金经理 | 2025-08-27 | - | 8 年 | <p>寇斌权先生，国籍中国，物理学博士，8 年证券从业经验。2018 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部大数据分析研究助理、量化研究员、高级量化研究员、资深量化研究员，现担任指数与量化投资部基金经理。2023 年 06 月至 2026 年 06 月担任鹏华弘华灵活配</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

|     |            |            |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|-----|------------|------------|---|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |            |            |   |     | 置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 09 月至 2025 年 06 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 09 月至今担任鹏华弘达灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 12 月至 2026 年 04 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 12 月至今担任鹏华畅享债券型证券投资基金基金经理，2024 年 08 月至 2026 年 04 月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发起式联接基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华安荣混合型证券投资基金基金经理，2025 年 06 月至今担任鹏华中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 07 月至今担任鹏华中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 08 月至今担任鹏华安益增强混合型证券投资基金基金经理，2025 年 11 月至今担任鹏华睿丰债券型证券投资基金基金经理，2026 年 04 月至今担任鹏华瑞衡鑫益 180 天持有期债券型证券投资基金基金经理，2026 年 06 月至今担任鹏华瑞衡鑫诚债券型证券投资基金基金经理，寇斌权先生具备基金从业资格。 |
| 李欣蓉 | 本基金的基金经理助理 | 2026-03-17 | - | 8 年 | 李欣蓉女士，国籍中国，硕士研究生，8 年证券从业经验。2018 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任集中交易室助理交易员、债券交易员、高级债券交易员，债券投资一部债券研究员，现从事投资研究工作。李欣蓉女士具备基金从业资格。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

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

2026 年上半年，国内经济总体保持平稳运行，但结构分化特征较为突出。一季度经济实现良好开局，二季度受外部环境、部分传统行业调整以及内需恢复仍不充分等因素影响，经济增速有所放缓。上半年国内生产总值同比增长 4.7%，其中一、二季度分别增长 5.0% 和 4.3%。生产端表现总体好于需求端，出口和高技术制造业维持较高景气，房地产投资、部分商品消费及传统行业需求相对偏弱，新旧动能转换继续加快。宏观政策延续积极取向，财政支出和政府债券发行适度前置，货币政策保持适度宽松，市场流动性总体合理充裕。

债券市场方面，2026 年上半年，国内债券市场整体呈现震荡偏强、波动率下降的特征。经济基本面延续结构分化，内需及实体融资需求相对偏弱，货币政策保持适度宽松，银行、保险和理财等机构配置需求较强，对债券市场形成支撑。与此同时，积极财政政策带来的政府债券供给、物价阶段性回升以及权益市场风险偏好变化，又对利率下行空间形成一定约束。10 年期和 30 年期国债收益率主要分别在 1.70%—1.90% 和 2.20%—2.40% 区间内运行，整体振幅低于过去几年同期水平。

具体来看，年初至 2 月中旬，市场对货币政策宽松和流动性充裕的预期较强，银行及保险机构配置需求积极，债券收益率震荡下行，10 年期国债收益率一度下破 1.80%，收益率曲线趋于平

坦。2 月中下旬至 3 月，房地产政策调整、经济及出口数据改善，叠加中东地缘冲突推升油价和输入性通胀预期，长端及超长端利率有所上行；短端在宽松资金面支持下表现相对稳定，收益率曲线阶段性陡峭化。进入二季度后，随着地缘风险和通胀担忧边际缓和，资金面宽松成为债券市场的主要驱动力。4 月债券市场整体走强，特别国债供给节奏逐步明确后，超长端不确定性有所下降。5 月至 6 月，政府债券发行加快、资金利率边际回升，叠加权益市场走强，债券收益率转入低位震荡。至 6 月末，10 年期和 30 年期国债收益率分别运行在 1.73%和 2.24%附近。

资金市场方面，上半年银行间流动性总体充裕，DR001 和 DR007 均值分别约为 1.31%和 1.43%，较上年同期明显下降，春节、税期和季末等关键时点的资金价格波动相对有限。较低的资金成本有利于杠杆和票息策略，中短期限利率债、高等级信用债和银行资本补充工具获得较强配置需求。信用债市场总体表现较好，机构负债端相对稳定，而高收益资产供给不足，推动信用利差进一步压缩，部分品种信用利差降至历史低位。城投债受化债政策持续推进、尾部信用风险预期下降等因素支持，信用利差保持低位；产业债表现则相对分化。可转债市场整体跟随权益市场上涨，但内部结构同样分化，科技成长类转债表现较强，传统行业转债相对落后，转债价格和估值中枢处于较高水平。

报告期内，本组合债券投资方面，在兼顾流动性、安全性和收益性的基础上动态优化资产配置，根据流动性环境、收益率曲线变化以及信用利差压缩节奏，灵活调整组合久期和杠杆水平，适度提升高等级信用债及中短久期资产配置比例，把握利率波动带来的阶段性交易机会，在控制信用风险的基础上增厚组合收益。同时，持续加强信用风险跟踪，严格控制信用下沉幅度，优化持仓结构，提升组合收益来源的稳定性。

股票市场方面，2026 年上半年，A 股市场整体上涨，但指数、行业和个股之间分化显著，市场呈现出由人工智能硬件和半导体产业趋势驱动的结构化行情。上证指数、沪深 300 指数分别上涨 3.16%和 7.55%，深证成指上涨 19.82%，创业板指上涨 35.58%，科创 50 指数上涨 64.25%。科技成长类指数明显领先于传统价值类指数，中小盘成长指数整体好于上证 50、红利指数等偏价值风格指数。

从行情演绎看，年初市场风险偏好总体较高，国内流动性保持宽松，人工智能产业需求和科技企业盈利预期改善，推动科技板块率先上涨。2 月中下旬至 3 月，海外地缘局势升温，原油价格上涨带动全球通胀预期回升，海外利率预期和风险偏好反复变化，A 股市场波动加大。进入二季度后，随着外部风险阶段性缓和、国内资金面维持宽松以及人工智能产业景气得到订单和业绩数据验证，市场重新上行，半导体、算力、光模块、存储芯片、PCB 及电子材料等方向表现突出，创业板和科创板成为主要收益来源。但与此同时，资金集中度和板块拥挤度明显上升。港股市场表现

弱于 A 股。上半年恒生指数下跌 10.73%，恒生科技指数下跌 18.92%，恒生中国企业指数下跌 15.21%。港股市场一方面受到海外利率维持高位、离岸市场风险偏好波动以及新股和再融资供给增加等因素影响；另一方面，恒生科技指数以互联网平台、消费电子及新能源汽车等资产为主，对上半年全球人工智能硬件行情的覆盖程度相对有限，导致港股科技与 A 股硬科技板块表现明显分化。

报告期内，本基金权益端采用量化模型进行选股，继续坚持动态配置不同预测收益来源、不同预测周期的因子；并继续加大对低相关性、有效投资因子的研发力度。与此同时，持续跟踪市场波动加剧时期的资金面和情绪面对风格切换的影响。以稳健均衡、动态适应市场环境的风格、在模型长期有效性和对短期市场环境波动的适应性中寻找平衡。

#### 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 D 类份额净值增长率为 2.34%，同期业绩比较基准增长率为 3.94%；A 类份额净值增长率为 2.24%，同期业绩比较基准增长率为 3.94%；C 类份额净值增长率为 2.19%，同期业绩比较基准增长率为 3.94%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，宏观经济有望延续温和修复态势，但内生动能仍不均衡：财政持续发力，超长期特别国债与新型政策性金融工具加快落地；内需、地产改善的持续性仍待观察，外部环境不确定性犹存。货币政策预计维持支持性立场，央行通过买断式逆回购等工具呵护流动性，资金面有望保持平稳充裕。

债市方面，收益率或延续低位震荡格局。票息保护偏薄叠加久期波动放大，市场对利空的敏感度上升：政府债供给提速、股市风险偏好回升引发的资金分流、机构负债端稳定性等因素可能阶段性推升长端波动；而基本面修复弹性有限与配置力量的存在，亦制约利率趋势性上行空间。组合操作上，本基金将维持中性久期，以票息策略为底仓，把握供给冲击与情绪扰动带来的波段配置机会，动态平衡收益增强与回撤控制，力争为持有人创造稳健回报。

权益市场方面，上半年整体出现较大分化，中东战争的忽然爆发，以及随后的阶段性缓和与反复，对非科技、非成长的例如周期板块带来较大扰动。AI 的共识逐步加深，持续性利好科技成长板块，上半年市场充分重估、定价了科技产业趋势和硬科技资产。展望 2026 年下半年，科技板块仍有产业催化和政策支撑，但估值继续扩张的约束也在增强。科技板块结构性机会仍然存在：其中半导体机会既来自周期修复，也来自国产替代向更深层次推进；AI 方向算力硬件仍是业绩兑现相对清晰的环节。但科技板块波动可能同步放大：部分细分方向交易拥挤度已经抬升，海外 AI 资本开支预期、美元流动性和全球科技股波动都可能放大板块波动或形成分化。科技公司研发强度高、盈利弹性大，行情能否延续关键要看产业趋势能否进一步落到订单、收入、利润和现金流。海外顶

尖闭源模型与国产开源模型的竞争仍然是未来科技方向最核心的胜负手。国产开源模型如果没有被海外闭源模型显著拉开显著代差的情况下、实际模型能力超过某一临界点之后，用户是否从性能最优转向性价比最优会对未来市场对 AI 估值产生较为深远的影响：大模型应用对算力、存储的长期需求是确定的，而未来算力、存储是否会从周期性成长属性转为公用事业属性值得持续性研究与跟踪。由于本轮 AI 革命形成了全球性共识和全球科技产业协作，科技板块形成了全球跨地区、跨市场的共振，那么海外市场的一些高风险敞口的交易一旦出现流动性风险也可能对于 A 股市场有传导和冲击。我们认为未来科技与非科技方向的轮动或者再平衡，有一定概率会重复极致再平衡的可能性。

综上，下半年我们相对看好科技方向特别是与 AI 相关性比较高的产业链或双创成长板块，与现金流或红利风格的哑铃策略或轮动策略。

#### 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，鹏华安益增强混合 A 期末可供分配利润为 11,827.33 元，期末基金份额净值 1.0610 元；鹏华安益增强混合 C 期末可供分配利润为 55,995.74 元，期末基金份额净值 1.0598 元；鹏华安益增强混合 D 期末可供分配利润为 82,914,699.44 元，期末基金份额净值 1.4424 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华安益增强混合型证券投资基金

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：    |         |                        |                          |
| 货币资金    | 6.4.7.1 | 19,845,556.83          | 1,892,200.52             |
| 结算备付金   |         | 8,184,851.82           | 699,394.76               |
| 存出保证金   |         | 29,880.04              | 15,028.32                |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 349,855,791.75         | 222,828,648.55           |
| 其中：股票投资 |         | 38,327,653.00          | 24,364,732.80            |
| 基金投资    |         | —                      | —                        |

|               |            |                                |                                  |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 债券投资          |            | 311,528,138.75                 | 198,463,915.75                   |
| 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         |            | -                              | 94,130.82                        |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 222,961.88                     | 10,009.99                        |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 378,139,042.32                 | 225,539,412.96                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2025 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                |                                  |
| 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     |            | 86,000,000.00                  | 20,995,304.66                    |
| 应付清算款         |            | 14,742,011.60                  | -                                |
| 应付赎回款         |            | 5,133,856.22                   | 263,477.23                       |
| 应付管理人报酬       |            | 278,694.48                     | 206,993.89                       |
| 应付托管费         |            | 46,449.08                      | 34,498.96                        |
| 应付销售服务费       |            | 304.82                         | 15.88                            |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | 16,486.79                      | 7,020.58                         |
| 应付利润          |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                              | -                                |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 155,080.69                     | 45,274.38                        |
| 负债合计          |            | 106,372,883.68                 | 21,552,585.58                    |
| <b>净资产：</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 188,771,118.60                 | 144,749,713.16                   |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                              | -                                |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 82,995,040.04                  | 59,237,114.22                    |
| 净资产合计         |            | 271,766,158.64                 | 203,986,827.38                   |
| 负债和净资产总计      |            | 378,139,042.32                 | 225,539,412.96                   |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额为 188,771,118.60 份，其中鹏华安益增强混

合 A 基金份额总额为 229,128.73 份，基金份额净值 1.0610 元；鹏华安益增强混合 C 基金份额总额为 1,109,419.77 份，基金份额净值 1.0598 元；鹏华安益增强混合 D 基金份额总额为 187,432,570.10 份，基金份额净值 1.4424 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华安益增强混合型证券投资基金

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|------------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入                |          | 8,911,242.72                             | 3,522,841.44                                  |
| 1. 利息收入                |          | 24,510.78                                | 83,175.38                                     |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.13 | 22,787.91                                | 22,420.74                                     |
| 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             |          | 1,722.87                                 | 60,754.64                                     |
| 其他利息收入                 |          | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |          | 6,920,200.53                             | 3,284,148.53                                  |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.14 | 2,660,463.48                             | 58,956.76                                     |
| 基金投资收益                 |          | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.15 | 3,968,934.99                             | 3,020,154.94                                  |
| 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 | 290,802.06                               | 205,036.83                                    |
| 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 | 1,798,944.74                             | 155,172.46                                    |
| 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 | 167,586.67                               | 345.07                                        |
| 减：二、营业总支出              |          | 2,646,427.17                             | 1,502,322.02                                  |

|                     |            |              |              |
|---------------------|------------|--------------|--------------|
| 1. 管理人报酬            | 6.4.10.2.1 | 1,841,861.64 | 966,270.89   |
| 其中：暂估管理人报酬          |            | -            | -            |
| 2. 托管费              | 6.4.10.2.2 | 306,977.06   | 161,045.18   |
| 3. 销售服务费            | 6.4.10.2.3 | 1,379.60     | 178.21       |
| 4. 投资顾问费            |            | -            | -            |
| 5. 利息支出             |            | 389,987.34   | 268,266.64   |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | 389,987.34   | 268,266.64   |
| 6. 信用减值损失           | 6.4.7.22   | -            | -            |
| 7. 税金及附加            |            | 9,560.97     | 5,300.14     |
| 8. 其他费用             | 6.4.7.23   | 96,660.56    | 101,260.96   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 6,264,815.55 | 2,020,519.42 |
| 减：所得税费用             |            | -            | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 6,264,815.55 | 2,020,519.42 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -            | -            |
| 六、综合收益总额            |            | 6,264,815.55 | 2,020,519.42 |

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华安益增强混合型证券投资基金

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<br>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            | 144,749,713.16                        | -      | 59,237,114.22 | 203,986,827.38 |
| 加：会计政策变更             | -                                     | -      | -             | -              |
| 前期差错更正               | -                                     | -      | -             | -              |
| 其他                   | -                                     | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净资产            | 144,749,713.16                        | -      | 59,237,114.22 | 203,986,827.38 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 44,021,405.44                         | -      | 23,757,925.82 | 67,779,331.26  |
| (一)、综合收益总额           | -                                     | -      | 6,264,815.55  | 6,264,815.55   |
| (二)、本期基金份额交易产生的      | 44,021,405.44                         | -      | 17,493,110.27 | 61,514,515.71  |

|                                                              |                                            |        |                |                |
|--------------------------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|----------------|----------------|
| 净资产变动数<br>(净资产减少以<br>“-”号填列)                                 |                                            |        |                |                |
| 其中：1. 基金申<br>购款                                              | 114,039,057.49                             | -      | 46,493,898.02  | 160,532,955.51 |
| 2. 基金赎<br>回款                                                 | -70,017,652.05                             | -      | -29,000,787.75 | -99,018,439.80 |
| (三)、本期向基<br>金份额持有人分<br>配利润产生的净<br>资产变动(净资<br>产减少以“-”号<br>填列) | -                                          | -      | -              | -              |
| (四)、其他综合<br>收益结转留存收<br>益                                     | -                                          | -      | -              | -              |
| 四、本期期末净<br>资产                                                | 188,771,118.60                             | -      | 82,995,040.04  | 271,766,158.64 |
| 项目                                                           | 上年度可比期间<br>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<br>资产                                                | 129,421,746.79                             | -      | 46,054,423.17  | 175,476,169.96 |
| 加：会计政策变<br>更                                                 | -                                          | -      | -              | -              |
| 前期差错更<br>正                                                   | -                                          | -      | -              | -              |
| 其他                                                           | -                                          | -      | -              | -              |
| 二、本期期初净<br>资产                                                | 129,421,746.79                             | -      | 46,054,423.17  | 175,476,169.96 |
| 三、本期增减变<br>动额(减少以“-”<br>号填列)                                 | -20,035,185.99                             | -      | -5,229,252.84  | -25,264,438.83 |
| (一)、综合收益<br>总额                                               | -                                          | -      | 2,020,519.42   | 2,020,519.42   |
| (二)、本期基金<br>份额交易产生的<br>净资产变动数<br>(净资产减少以<br>“-”号填列)          | -20,035,185.99                             | -      | -7,249,772.26  | -27,284,958.25 |
| 其中：1. 基金申<br>购款                                              | 985,171.78                                 | -      | 11,435.49      | 996,607.27     |
| 2. 基金赎<br>回款                                                 | -21,020,357.77                             | -      | -7,261,207.75  | -28,281,565.52 |

|                                          |                |   |               |                |
|------------------------------------------|----------------|---|---------------|----------------|
| (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                                | 109,386,560.80 | - | 40,825,170.33 | 150,211,731.13 |

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

鹏华安益增强混合型证券投资基金(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[2016]1631 号《关于准予鹏华安益增强混合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《鹏华安益增强混合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，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 240,103,656.12 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(2017)第 174 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华安益增强混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 2 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 240,287,044.75 份基金份额，其中认购资金利息折合 183,388.63 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，基金托管人为中国工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》、《鹏华安益

增强混合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 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款   | 19,845,556.83          |
| 等于：本金  | 19,845,345.90          |
| 加：应计利息 | 210.93                 |
| 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           | -             |
| 等于：本金          | -             |
| 加：应计利息         | -             |
| 减：坏账准备         | -             |
| 合计             | 19,845,556.83 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |              |                |              |
|---------------|-------|------------------------|--------------|----------------|--------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动       |
| 股票            |       | 36,067,846.38          | -            | 38,327,653.00  | 2,259,806.62 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -            | -              | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 234,855,356.04         | 2,216,314.53 | 236,993,994.53 | -77,676.04   |
|               | 银行间市场 | 73,087,169.18          | 542,244.22   | 74,534,144.22  | 904,730.82   |
|               | 合计    | 307,942,525.22         | 2,758,558.75 | 311,528,138.75 | 827,054.78   |
| 资产支持证券        |       | -                      | -            | -              | -            |
| 基金            |       | -                      | -            | -              | -            |
| 其他            |       | -                      | -            | -              | -            |
| 合计            |       | 344,010,371.60         | 2,758,558.75 | 349,855,791.75 | 3,086,861.40 |

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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 7,305.44               |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 73,440.36              |
| 其中：交易所市场    | 71,897.86              |
| 银行间市场       | 1,542.50               |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 74,334.89              |
| 合计          | 155,080.69             |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华安益增强混合 A

| 项目            | 本期<br>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          | 17,577.77                             | 17,577.77   |
| 本期申购          | 382,058.79                            | 382,058.79  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -170,507.83                           | -170,507.83 |
| 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           | 229,128.73                            | 229,128.73  |

鹏华安益增强混合 C

| 项目            | 本期<br>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          | 56,497.63                             | 56,497.63     |
| 本期申购          | 3,386,644.23                          | 3,386,644.23  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,333,722.09                         | -2,333,722.09 |
| 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           | 1,109,419.77                          | 1,109,419.77  |

鹏华安益增强混合 D

| 项目            | 本期<br>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          | 144,675,637.76                        | 144,675,637.76 |
| 本期申购          | 110,270,354.47                        | 110,270,354.47 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -67,513,422.13                        | -67,513,422.13 |
| 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           | 187,432,570.10                        | 187,432,570.10 |

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

鹏华安益增强混合 A

| 项目             | 已实现部分     | 未实现部分    | 未分配利润合计   |
|----------------|-----------|----------|-----------|
| 上年度末           | 653.61    | 10.83    | 664.44    |
| 加：会计政策变更       | -         | -        | -         |
| 前期差错更正         | -         | -        | -         |
| 其他             | -         | -        | -         |
| 本期期初           | 653.61    | 10.83    | 664.44    |
| 本期利润           | 1,876.06  | 1,053.06 | 2,929.12  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 9,297.66  | 1,083.57 | 10,381.23 |
| 其中：基金申购款       | 16,266.80 | 1,394.86 | 17,661.66 |
| 基金赎回款          | -6,969.14 | -311.29  | -7,280.43 |
| 本期已分配利润        | -         | -        | -         |
| 本期末            | 11,827.33 | 2,147.46 | 13,974.79 |

鹏华安益增强混合 C

| 项目             | 已实现部分      | 未实现部分      | 未分配利润合计     |
|----------------|------------|------------|-------------|
| 上年度末           | 2,064.06   | 33.58      | 2,097.64    |
| 加：会计政策变更       | -          | -          | -           |
| 前期差错更正         | -          | -          | -           |
| 其他             | -          | -          | -           |
| 本期期初           | 2,064.06   | 33.58      | 2,097.64    |
| 本期利润           | 9,595.06   | 12,820.79  | 22,415.85   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 44,336.62  | -2,484.30  | 41,852.32   |
| 其中：基金申购款       | 142,170.96 | 14,523.45  | 156,694.41  |
| 基金赎回款          | -97,834.34 | -17,007.75 | -114,842.09 |
| 本期已分配利润        | -          | -          | -           |
| 本期末            | 55,995.74  | 10,370.07  | 66,365.81   |

鹏华安益增强混合 D

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末           | 62,737,279.81  | -3,502,927.67 | 59,234,352.14  |
| 加：会计政策变更       | -              | -             | -              |
| 前期差错更正         | -              | -             | -              |
| 其他             | -              | -             | -              |
| 本期期初           | 62,737,279.81  | -3,502,927.67 | 59,234,352.14  |
| 本期利润           | 4,454,399.69   | 1,785,070.89  | 6,239,470.58   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 18,030,652.79  | -589,776.07   | 17,440,876.72  |
| 其中：基金申购款       | 47,892,841.69  | -1,573,299.74 | 46,319,541.95  |
| 基金赎回款          | -29,862,188.90 | 983,523.67    | -28,878,665.23 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |

|     |               |               |               |
|-----|---------------|---------------|---------------|
| 本期末 | 85,222,332.29 | -2,307,632.85 | 82,914,699.44 |
|-----|---------------|---------------|---------------|

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 15,229.41                             |
| 定期存款利息收入  | —                                     |
| 其他存款利息收入  | —                                     |
| 结算备付金利息收入 | 7,514.01                              |
| 其他        | 44.49                                 |
| 合计        | 22,787.91                             |

注：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。

#### 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<br>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 | 2,660,463.48               |
| 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               | 2,660,463.48               |

##### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 116,766,762.27                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 113,922,396.32                        |
| 减：交易费用     | 183,902.47                            |
| 买卖股票差价收入   | 2,660,463.48                          |

##### 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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|                              | 2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 3,451,923.88         |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 517,011.11           |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | —                    |
| 债券投资收益——申购差价收入               | —                    |
| 合计                           | 3,968,934.99         |

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 161,332,147.13             |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 158,511,356.45             |
| 减：应计利息总额               | 2,299,764.57               |
| 减：交易费用                 | 4,015.00                   |
| 买卖债券差价收入               | 517,011.11                 |

#### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 290,802.06                            |
| 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            | 290,802.06                            |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 1,798,944.74                          |
| 股票投资                   | 942,089.25                            |
| 债券投资                   | 856,855.49                            |
| 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                     | 1,798,944.74                          |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 164,791.93                            |
| 基金转换费收入 | 2,794.74                              |
| 合计      | 167,586.67                            |

#### 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<br>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 | -                                     |
| 银行汇划费用  | 3,725.67                              |
| 账户维护费   | 18,000.00                             |
| 其他      | 600.00                                |
| 合计      | 96,660.56                             |

#### 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 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 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、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

注：无。

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

注：无。

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,841,861.64                             | 966,270.89                                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 740,264.50                               | 225,464.57                                    |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,101,597.14                             | 740,806.32                                    |

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理人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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 306,977.06                               | 161,045.18                                    |

注：支付基金托管人中国工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

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                |            |            |       |
|                | 鹏华安益增强混合 A                      | 鹏华安益增强混合 C | 鹏华安益增强混合 D | 合计    |
| 鹏华基金公司         | 10.01                           | 9.05       | -          | 19.06 |
| 合计             | 10.01                           | 9.05       | -          | 19.06 |
| 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                |            |            |       |
|                | 鹏华安益增强混合 A                      | 鹏华安益增强混合 C | 鹏华安益增强混合 D | 合计    |
| 鹏华基金公司         | 4.12                            | 4.42       | -          | 8.54  |
| 合计             | 4.12                            | 4.42       | -          | 8.54  |

注：支付基金销售机构的鹏华安益增强混合 A 基金份额的销售服务费年费率为 0.2%，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×0.2%÷当年天数；支付基金销售机构的鹏华安益增强混合 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.3%，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×0.3%÷当年天数；鹏华安益增强混合 D 基金份额不支付销售服务费。

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

份额单位：份

| 项目                                        | 本期                              |               |               |
|-------------------------------------------|---------------------------------|---------------|---------------|
|                                           | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |               |               |
|                                           | 鹏华安益增强混合<br>A                   | 鹏华安益增强混合<br>C | 鹏华安益增强混合 D    |
| 基金合同生效日<br>( 2017 年 2 月 22 日 )<br>持有的基金份额 | -                               | -             | -             |
| 报告期初持有的基金<br>份额                           | -                               | -             | 12,865,000.93 |
| 报告期间申购/买入<br>总份额                          | -                               | -             | -             |
| 报告期间因拆分变动<br>份额                           | -                               | -             | -             |
| 减：报告期间赎回/卖<br>出总份额                        | -                               | -             | -             |
| 报告期末持有的基金<br>份额                           | -                               | -             | 12,865,000.93 |
| 报告期末持有的基金<br>份额<br>占基金总份额比例               | -                               | -             | 6.8638%       |
| 项目                                        | 上年度可比期间                         |               |               |
|                                           | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |               |               |
|                                           | 鹏华安益增强混合<br>A                   | 鹏华安益增强混合<br>C | 鹏华安益增强混合 D    |
| 基金合同生效日<br>( 2017 年 2 月 22 日 )<br>持有的基金份额 | -                               | -             | -             |
| 报告期初持有的基金<br>份额                           | -                               | -             | 12,865,000.93 |
| 报告期间申购/买入<br>总份额                          | -                               | -             | -             |
| 报告期间因拆分变动<br>份额                           | -                               | -             | -             |
| 减：报告期间赎回/卖<br>出总份额                        | -                               | -             | -             |
| 报告期末持有的基金<br>份额                           | -                               | -             | 12,865,000.93 |
| 报告期末持有的基金                                 | -                               | -             | 11.7684%      |

|                |  |  |  |
|----------------|--|--|--|
| 份额<br>占基金总份额比例 |  |  |  |
|----------------|--|--|--|

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

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月<br>30 日 |           | 上年度可比期间<br>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    |
| 中国工商银行 | 19,845,556.83                            | 15,229.41 | 2,924,893.95                               | 16,272.58 |

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

注：无。

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

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 86,000,000.00 元，于 2026 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、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、中小企业私募债等）、货币市场工具（含同业存单）、债券回购、权证、资产支持证券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）。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中国工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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。下列表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 249,730,684.32         | 121,345,529.89           |
| AAA 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 45,740,947.39          | 25,355,850.13            |
| 合计     | 295,471,631.71         | 146,701,380.02           |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

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，除卖出回购金融资产款余额 86,000,000.00 元将在一个月内到期且计息外，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

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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                   | 19,845,556.83  | -              | -             | -             | 19,845,556.83  |
| 结算备付金                  | 8,184,851.82   | -              | -             | -             | 8,184,851.82   |
| 存出保证金                  | 29,880.04      | -              | -             | -             | 29,880.04      |
| 交易性金融资产                | 117,670,080.83 | 168,394,007.78 | 25,464,050.14 | 38,327,653.00 | 349,855,791.75 |
| 应收申购款                  | -              | -              | -             | 222,961.88    | 222,961.88     |

|                          |                |                |               |               |                |
|--------------------------|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 资产总计                     | 145,730,369.52 | 168,394,007.78 | 25,464,050.14 | 38,550,614.88 | 378,139,042.32 |
| 负债                       |                |                |               |               |                |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -             | 5,133,856.22  | 5,133,856.22   |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -             | 278,694.48    | 278,694.48     |
| 应付托管费                    | -              | -              | -             | 46,449.08     | 46,449.08      |
| 应付清算款                    | -              | -              | -             | 14,742,011.60 | 14,742,011.60  |
| 卖出回购金融资产款                | 86,000,000.00  | -              | -             | -             | 86,000,000.00  |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -             | 304.82        | 304.82         |
| 应交税费                     | -              | -              | -             | 16,486.79     | 16,486.79      |
| 其他负债                     | -              | -              | -             | 155,080.69    | 155,080.69     |
| 负债总计                     | 86,000,000.00  | -              | -             | 20,372,883.68 | 106,372,883.68 |
| 利率敏感度缺口                  | 59,730,369.52  | 168,394,007.78 | 25,464,050.14 | 18,177,731.20 | 271,766,158.64 |
| 上年度末<br>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                     | 1,892,200.52   | -              | -             | -             | 1,892,200.52   |
| 结算备付金                    | 699,394.76     | -              | -             | -             | 699,394.76     |
| 存出保证金                    | 15,028.32      | -              | -             | -             | 15,028.32      |
| 交易性金融资产                  | 87,306,022.32  | 105,805,331.79 | 5,352,561.64  | 24,364,732.80 | 222,828,648.55 |
| 应收申购款                    | -              | -              | -             | 10,009.99     | 10,009.99      |
| 应收清算款                    | -              | -              | -             | 94,130.82     | 94,130.82      |
| 资产总计                     | 89,912,645.92  | 105,805,331.79 | 5,352,561.64  | 24,468,873.61 | 225,539,412.96 |
| 负债                       |                |                |               |               |                |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -             | 263,477.23    | 263,477.23     |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -             | 206,993.89    | 206,993.89     |
| 应付托管费                    | -              | -              | -             | 34,498.96     | 34,498.96      |
| 卖出回购金融资产款                | 20,995,304.66  | -              | -             | -             | 20,995,304.66  |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -             | 15.88         | 15.88          |
| 应交税费                     | -              | -              | -             | 7,020.58      | 7,020.58       |
| 其他负债                     | -              | -              | -             | 45,274.38     | 45,274.38      |
| 负债总计                     | 20,995,304.66  | -              | -             | 557,280.92    | 21,552,585.58  |
| 利率敏感度缺口                  | 68,917,341.26  | 105,805,331.79 | 5,352,561.64  | 23,911,592.69 | 203,986,827.38 |

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

|    |                                                           |
|----|-----------------------------------------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。 |
|    | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。                    |
|    | 此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。                          |

| 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） |
|    | 市场利率下降 25 个基点 | 1,448,658.07                | 639,393.21             |
|    | 市场利率上升 25 个基点 | -1,434,499.60               | -634,934.09            |

注：无。

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（含存托凭证）资产占基金资产的比例不超过 30%；债券资产占基金资产的比例不低于 70%；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。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调

整上述投资品种的投资比例。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<br>2026 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2025年12月31日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 38,327,653.00          | 14.10            | 24,364,732.80       | 11.94            |
| 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            | 38,327,653.00          | 14.10            | 24,364,732.80       | 11.94            |

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

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为 14.10%，因此除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

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：<br><br>第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。<br><br>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。<br><br>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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次          | 38,327,653.00          |
| 第二层次          | 311,528,138.75         |
| 第三层次          | —                      |
| 合计            | 349,855,791.75         |

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

|                                                                                                                                                                                                                            |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>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。</p> <p>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。</p> |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## 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<br>(%) |
|----|-------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资  | 38,327,653.00 | 10.14            |
|    | 其中：股票 | 38,327,653.00 | 10.14            |
| 2  | 基金投资  | —             | —                |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 3 | 固定收益投资            | 311,528,138.75 | 82.38  |
|   | 其中：债券             | 311,528,138.75 | 82.38  |
|   | 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      | 28,030,408.65  | 7.41   |
| 8 | 其他各项资产            | 252,841.92     | 0.07   |
| 9 | 合计                | 378,139,042.32 | 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         | 116,516.70    | 0.04         |
| B  | 采矿业              | 1,936,032.00  | 0.71         |
| C  | 制造业              | 26,457,000.40 | 9.74         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 854,911.00    | 0.31         |
| E  | 建筑业              | 126,053.00    | 0.05         |
| F  | 批发和零售业           | 335,413.00    | 0.12         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 921,226.00    | 0.34         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 17,472.00     | 0.01         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,363,027.90  | 1.24         |
| J  | 金融业              | 2,513,670.00  | 0.92         |
| K  | 房地产业             | 423,169.00    | 0.16         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 69,823.00     | 0.03         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 456,062.00    | 0.17         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 355,828.00    | 0.13         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 73,884.00     | 0.03         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 307,565.00    | 0.11         |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 38,327,653.00 | 14.10        |

### 7.2.2 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量<br>(股) | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|-------|-----------|--------------|------------------|
| 1  | 300308 | 中际旭创  | 900       | 1,143,000.00 | 0.42             |
| 2  | 300750 | 宁德时代  | 2,200     | 864,622.00   | 0.32             |
| 3  | 300502 | 新易盛   | 1,000     | 607,000.00   | 0.22             |
| 4  | 600519 | 贵州茅台  | 500       | 592,745.00   | 0.22             |
| 5  | 688256 | 寒武纪   | 300       | 478,665.00   | 0.18             |
| 6  | 000333 | 美的集团  | 6,000     | 453,180.00   | 0.17             |
| 7  | 600030 | 中信证券  | 13,900    | 399,347.00   | 0.15             |
| 8  | 301217 | 铜冠铜箔  | 2,300     | 379,661.00   | 0.14             |
| 9  | 688498 | 源杰科技  | 200       | 377,200.00   | 0.14             |
| 10 | 601318 | 中国平安  | 7,700     | 367,598.00   | 0.14             |
| 11 | 688213 | 思特威-W | 3,300     | 353,331.00   | 0.13             |
| 12 | 300604 | 长川科技  | 1,000     | 341,420.00   | 0.13             |
| 13 | 002080 | 中材科技  | 3,700     | 333,000.00   | 0.12             |
| 14 | 601211 | 国泰海通  | 17,600    | 320,320.00   | 0.12             |
| 15 | 601688 | 华泰证券  | 15,300    | 315,486.00   | 0.12             |
| 16 | 002475 | 立讯精密  | 4,400     | 309,760.00   | 0.11             |
| 17 | 601168 | 西部矿业  | 11,000    | 298,540.00   | 0.11             |
| 18 | 601899 | 紫金矿业  | 11,800    | 296,652.00   | 0.11             |
| 19 | 688041 | 海光信息  | 800       | 296,240.00   | 0.11             |
| 20 | 600166 | 福田汽车  | 101,400   | 295,074.00   | 0.11             |
| 21 | 605011 | 杭州热电  | 19,000    | 293,740.00   | 0.11             |
| 22 | 002266 | 浙富控股  | 57,800    | 292,468.00   | 0.11             |
| 23 | 600276 | 恒瑞医药  | 5,600     | 291,424.00   | 0.11             |
| 24 | 603806 | 福斯特   | 17,200    | 288,788.00   | 0.11             |
| 25 | 002065 | 东华软件  | 40,200    | 287,028.00   | 0.11             |
| 26 | 002552 | 宝鼎科技  | 4,600     | 280,600.00   | 0.10             |
| 27 | 688008 | 澜起科技  | 900       | 278,910.00   | 0.10             |
| 28 | 600887 | 伊利股份  | 11,400    | 273,144.00   | 0.10             |
| 29 | 002158 | 汉钟精机  | 7,300     | 270,684.00   | 0.10             |
| 30 | 600150 | 中国船舶  | 7,800     | 263,562.00   | 0.10             |
| 31 | 000967 | 盈峰环境  | 25,000    | 263,250.00   | 0.10             |
| 32 | 002008 | 大族激光  | 1,700     | 255,187.00   | 0.09             |
| 33 | 601156 | 东航物流  | 15,500    | 249,860.00   | 0.09             |
| 34 | 603885 | 吉祥航空  | 24,000    | 246,960.00   | 0.09             |
| 35 | 603986 | 兆易创新  | 300       | 244,500.00   | 0.09             |
| 36 | 600131 | 国网信通  | 16,500    | 240,900.00   | 0.09             |
| 37 | 000338 | 潍柴动力  | 8,800     | 239,800.00   | 0.09             |
| 38 | 601601 | 中国太保  | 8,300     | 236,716.00   | 0.09             |
| 39 | 688012 | 中微公司  | 500       | 234,250.00   | 0.09             |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 40 | 600266 | 城建发展 | 59,700 | 233,427.00 | 0.09 |
| 41 | 603737 | 三棵树  | 9,660  | 232,806.00 | 0.09 |
| 42 | 688232 | 新点软件 | 13,000 | 231,140.00 | 0.09 |
| 43 | 600685 | 中船防务 | 9,000  | 228,960.00 | 0.08 |
| 44 | 600888 | 新疆众和 | 14,400 | 228,816.00 | 0.08 |
| 45 | 600517 | 国网英大 | 48,000 | 224,640.00 | 0.08 |
| 46 | 600353 | 旭光电子 | 4,800  | 218,880.00 | 0.08 |
| 47 | 002396 | 星网锐捷 | 11,400 | 218,538.00 | 0.08 |
| 48 | 002273 | 水晶光电 | 6,100  | 216,428.00 | 0.08 |
| 49 | 002444 | 巨星科技 | 6,900  | 214,590.00 | 0.08 |
| 50 | 301631 | 壹连科技 | 2,920  | 209,831.20 | 0.08 |
| 51 | 603063 | 禾望电气 | 3,900  | 206,271.00 | 0.08 |
| 52 | 600201 | 生物股份 | 17,700 | 206,205.00 | 0.08 |
| 53 | 601020 | 华钰矿业 | 8,500  | 203,915.00 | 0.08 |
| 54 | 000598 | 兴蓉环境 | 31,100 | 199,662.00 | 0.07 |
| 55 | 603085 | 天成自控 | 18,300 | 198,921.00 | 0.07 |
| 56 | 600389 | 江山股份 | 10,100 | 197,152.00 | 0.07 |
| 57 | 688107 | 安路科技 | 4,200  | 191,520.00 | 0.07 |
| 58 | 300274 | 阳光电源 | 1,200  | 190,824.00 | 0.07 |
| 59 | 688486 | 龙迅股份 | 3,000  | 190,740.00 | 0.07 |
| 60 | 600361 | 创新新材 | 52,900 | 190,440.00 | 0.07 |
| 61 | 603317 | 天味食品 | 14,600 | 189,946.00 | 0.07 |
| 62 | 300757 | 罗博特科 | 300    | 185,700.00 | 0.07 |
| 63 | 002536 | 飞龙股份 | 3,800  | 179,284.00 | 0.07 |
| 64 | 688209 | 英集芯  | 6,144  | 178,667.52 | 0.07 |
| 65 | 603259 | 药明康德 | 1,400  | 174,314.00 | 0.06 |
| 66 | 300113 | 顺网科技 | 9,400  | 171,174.00 | 0.06 |
| 67 | 300684 | 中石科技 | 2,800  | 170,800.00 | 0.06 |
| 68 | 600282 | 南钢股份 | 37,200 | 170,748.00 | 0.06 |
| 69 | 300857 | 协创数据 | 500    | 169,950.00 | 0.06 |
| 70 | 688122 | 西部超导 | 2,700  | 169,587.00 | 0.06 |
| 71 | 600875 | 东方电气 | 5,800  | 166,866.00 | 0.06 |
| 72 | 600301 | 华锡有色 | 2,700  | 165,564.00 | 0.06 |
| 73 | 601988 | 中国银行 | 28,900 | 165,308.00 | 0.06 |
| 74 | 600578 | 京能电力 | 25,400 | 163,830.00 | 0.06 |
| 75 | 601155 | 新城控股 | 15,700 | 161,082.00 | 0.06 |
| 76 | 002415 | 海康威视 | 4,700  | 160,740.00 | 0.06 |
| 77 | 601019 | 山东出版 | 25,000 | 160,000.00 | 0.06 |
| 78 | 603228 | 景旺电子 | 2,200  | 159,302.00 | 0.06 |
| 79 | 603505 | 金石资源 | 7,900  | 159,185.00 | 0.06 |
| 80 | 600893 | 航发动力 | 4,100  | 157,194.00 | 0.06 |
| 81 | 600036 | 招商银行 | 4,400  | 156,200.00 | 0.06 |
| 82 | 301219 | 腾远钴业 | 2,800  | 153,440.00 | 0.06 |

|     |        |        |        |            |      |
|-----|--------|--------|--------|------------|------|
| 83  | 600416 | 湘电股份   | 15,400 | 150,920.00 | 0.06 |
| 84  | 300408 | 三环集团   | 900    | 150,210.00 | 0.06 |
| 85  | 600026 | 中远海能   | 8,000  | 143,520.00 | 0.05 |
| 86  | 600746 | 江苏索普   | 27,300 | 142,779.00 | 0.05 |
| 87  | 002859 | 洁美科技   | 1,300  | 142,363.00 | 0.05 |
| 88  | 600409 | 三友化工   | 22,900 | 139,919.00 | 0.05 |
| 89  | 688779 | 五矿新能   | 17,100 | 138,681.00 | 0.05 |
| 90  | 601699 | 潞安环能   | 9,700  | 138,516.00 | 0.05 |
| 91  | 000066 | 中国长城   | 7,200  | 137,160.00 | 0.05 |
| 92  | 688182 | 灿勤科技   | 3,165  | 136,316.55 | 0.05 |
| 93  | 603663 | 三祥新材   | 1,400  | 134,820.00 | 0.05 |
| 94  | 688347 | 华虹宏力   | 400    | 134,520.00 | 0.05 |
| 95  | 002913 | 奥士康    | 2,100  | 134,274.00 | 0.05 |
| 96  | 688172 | 燕东微    | 1,600  | 133,856.00 | 0.05 |
| 97  | 601918 | 新集能源   | 15,500 | 133,145.00 | 0.05 |
| 98  | 600801 | 华新建材   | 8,500  | 132,600.00 | 0.05 |
| 99  | 002182 | 宝武镁业   | 8,400  | 130,788.00 | 0.05 |
| 100 | 300357 | 我武生物   | 5,400  | 125,928.00 | 0.05 |
| 101 | 603915 | 国茂股份   | 8,700  | 123,453.00 | 0.05 |
| 102 | 603698 | 航天工程   | 3,200  | 123,392.00 | 0.05 |
| 103 | 601098 | 中南传媒   | 12,400 | 122,016.00 | 0.04 |
| 104 | 002353 | 杰瑞股份   | 800    | 122,000.00 | 0.04 |
| 105 | 688141 | 杰华特    | 791    | 121,418.50 | 0.04 |
| 106 | 688262 | 国芯科技   | 2,800  | 121,044.00 | 0.04 |
| 107 | 300475 | 香农芯创   | 400    | 120,000.00 | 0.04 |
| 108 | 301031 | 中熔电气   | 1,000  | 119,450.00 | 0.04 |
| 109 | 600391 | 航发科技   | 3,500  | 117,075.00 | 0.04 |
| 110 | 688332 | 中科蓝讯   | 740    | 116,550.00 | 0.04 |
| 111 | 688352 | 顾中科技   | 4,800  | 116,064.00 | 0.04 |
| 112 | 601872 | 招商轮船   | 6,600  | 115,962.00 | 0.04 |
| 113 | 002597 | 金禾实业   | 5,900  | 115,640.00 | 0.04 |
| 114 | 688099 | 晶晨股份   | 1,100  | 113,190.00 | 0.04 |
| 115 | 600031 | 三一重工   | 6,500  | 112,320.00 | 0.04 |
| 116 | 688220 | 翱捷科技-U | 900    | 111,888.00 | 0.04 |
| 117 | 301487 | 盟固利    | 5,800  | 111,070.00 | 0.04 |
| 118 | 688630 | 芯碁微装   | 200    | 109,878.00 | 0.04 |
| 119 | 601598 | 中国外运   | 21,800 | 108,128.00 | 0.04 |
| 120 | 688167 | 炬光科技   | 300    | 106,263.00 | 0.04 |
| 121 | 002324 | 普利特    | 8,800  | 106,216.00 | 0.04 |
| 122 | 300383 | 光环新网   | 8,500  | 105,740.00 | 0.04 |
| 123 | 600577 | 精达股份   | 10,800 | 105,624.00 | 0.04 |
| 124 | 300236 | 上海新阳   | 800    | 105,200.00 | 0.04 |
| 125 | 688676 | 金盘科技   | 1,200  | 101,568.00 | 0.04 |

|     |        |        |        |            |      |
|-----|--------|--------|--------|------------|------|
| 126 | 688027 | 国盾量子   | 200    | 100,802.00 | 0.04 |
| 127 | 688048 | 长光华芯   | 200    | 100,400.00 | 0.04 |
| 128 | 300171 | 东富龙    | 9,000  | 99,540.00  | 0.04 |
| 129 | 688525 | 佰维存储   | 200    | 98,946.00  | 0.04 |
| 130 | 301297 | 富乐德    | 1,600  | 97,984.00  | 0.04 |
| 131 | 300257 | 开山股份   | 3,400  | 97,512.00  | 0.04 |
| 132 | 601665 | 齐鲁银行   | 16,800 | 96,936.00  | 0.04 |
| 133 | 688362 | 甬矽电子   | 1,000  | 96,400.00  | 0.04 |
| 134 | 688195 | 腾景科技   | 500    | 96,290.00  | 0.04 |
| 135 | 600330 | 天通股份   | 3,100  | 95,604.00  | 0.04 |
| 136 | 605333 | 沪光股份   | 5,600  | 95,480.00  | 0.04 |
| 137 | 301087 | 可孚医疗   | 2,000  | 95,300.00  | 0.04 |
| 138 | 300738 | 奥飞数据   | 4,700  | 95,034.00  | 0.03 |
| 139 | 601126 | 四方股份   | 1,500  | 94,800.00  | 0.03 |
| 140 | 688800 | 瑞可达    | 980    | 94,050.60  | 0.03 |
| 141 | 300398 | 飞凯材料   | 1,500  | 92,625.00  | 0.03 |
| 142 | 600352 | 浙江龙盛   | 7,500  | 90,825.00  | 0.03 |
| 143 | 688190 | 云路股份   | 1,000  | 90,710.00  | 0.03 |
| 144 | 603132 | 金徽股份   | 5,800  | 90,364.00  | 0.03 |
| 145 | 688206 | 概伦电子   | 2,000  | 88,740.00  | 0.03 |
| 146 | 688097 | 博众精工   | 1,400  | 88,270.00  | 0.03 |
| 147 | 688158 | 优刻得-W  | 2,400  | 88,224.00  | 0.03 |
| 148 | 601069 | 西部黄金   | 4,000  | 88,000.00  | 0.03 |
| 149 | 688037 | 芯源微    | 200    | 87,810.00  | 0.03 |
| 150 | 600596 | 新安股份   | 5,500  | 87,780.00  | 0.03 |
| 151 | 300659 | 中孚信息   | 9,200  | 87,400.00  | 0.03 |
| 152 | 600000 | 浦发银行   | 10,000 | 86,100.00  | 0.03 |
| 153 | 601288 | 农业银行   | 14,100 | 85,587.00  | 0.03 |
| 154 | 300751 | 迈为股份   | 300    | 84,738.00  | 0.03 |
| 155 | 002025 | 航天电器   | 1,100  | 83,842.00  | 0.03 |
| 156 | 688306 | 均普智能   | 8,300  | 83,830.00  | 0.03 |
| 157 | 600114 | 东睦股份   | 2,200  | 83,072.00  | 0.03 |
| 158 | 300438 | 鹏辉能源   | 1,000  | 82,850.00  | 0.03 |
| 159 | 300487 | 蓝晓科技   | 1,400  | 82,390.00  | 0.03 |
| 160 | 600986 | 浙文互联   | 11,800 | 82,364.00  | 0.03 |
| 161 | 002588 | 史丹利    | 10,300 | 81,370.00  | 0.03 |
| 162 | 300820 | 英杰电气   | 900    | 81,207.00  | 0.03 |
| 163 | 688382 | 益方生物-U | 4,500  | 81,000.00  | 0.03 |
| 164 | 300260 | 新莱应材   | 800    | 80,368.00  | 0.03 |
| 165 | 688586 | 江航装备   | 6,813  | 79,643.97  | 0.03 |
| 166 | 600900 | 长江电力   | 3,000  | 79,410.00  | 0.03 |
| 167 | 603279 | 景津装备   | 6,600  | 79,200.00  | 0.03 |
| 168 | 688523 | 航天环宇   | 1,500  | 78,600.00  | 0.03 |

|     |        |        |        |           |      |
|-----|--------|--------|--------|-----------|------|
| 169 | 002683 | 广东宏大   | 2,600  | 76,154.00 | 0.03 |
| 170 | 600486 | 扬农化工   | 1,500  | 76,050.00 | 0.03 |
| 171 | 603659 | 璞泰来    | 2,600  | 75,218.00 | 0.03 |
| 172 | 600366 | 宁波韵升   | 5,100  | 74,868.00 | 0.03 |
| 173 | 688388 | 嘉元科技   | 1,700  | 74,800.00 | 0.03 |
| 174 | 600458 | 时代新材   | 4,500  | 74,475.00 | 0.03 |
| 175 | 600499 | 科达制造   | 5,300  | 73,140.00 | 0.03 |
| 176 | 688536 | 思瑞浦    | 200    | 72,818.00 | 0.03 |
| 177 | 603328 | 依顿电子   | 5,800  | 72,674.00 | 0.03 |
| 178 | 601611 | 中国核建   | 6,400  | 71,360.00 | 0.03 |
| 179 | 601231 | 环旭电子   | 2,200  | 71,280.00 | 0.03 |
| 180 | 301000 | 肇民科技   | 2,200  | 70,422.00 | 0.03 |
| 181 | 600096 | 云天化    | 2,300  | 69,920.00 | 0.03 |
| 182 | 605358 | 立昂微    | 900    | 69,840.00 | 0.03 |
| 183 | 601888 | 中国中免   | 1,300  | 69,823.00 | 0.03 |
| 184 | 002458 | 益生股份   | 8,710  | 67,676.70 | 0.02 |
| 185 | 600380 | 健康元    | 7,000  | 65,940.00 | 0.02 |
| 186 | 688062 | 迈威生物-U | 2,300  | 64,975.00 | 0.02 |
| 187 | 603127 | 昭衍新药   | 1,700  | 64,974.00 | 0.02 |
| 188 | 002534 | 西子洁能   | 3,500  | 64,925.00 | 0.02 |
| 189 | 002518 | 科士达    | 1,200  | 64,308.00 | 0.02 |
| 190 | 301510 | 固高科技   | 2,000  | 63,860.00 | 0.02 |
| 191 | 300456 | 赛微电子   | 1,500  | 63,705.00 | 0.02 |
| 192 | 600601 | 方正科技   | 4,600  | 63,664.00 | 0.02 |
| 193 | 301177 | 迪阿股份   | 2,300  | 63,411.00 | 0.02 |
| 194 | 300693 | 盛弘股份   | 1,300  | 63,375.00 | 0.02 |
| 195 | 603588 | 高能环境   | 3,300  | 63,360.00 | 0.02 |
| 196 | 002484 | 江海股份   | 600    | 63,000.00 | 0.02 |
| 197 | 000534 | 万泽股份   | 2,300  | 62,928.00 | 0.02 |
| 198 | 688549 | 中巨芯-U  | 1,700  | 62,577.00 | 0.02 |
| 199 | 688205 | 德科立    | 300    | 62,457.00 | 0.02 |
| 200 | 601677 | 明泰铝业   | 3,700  | 61,420.00 | 0.02 |
| 201 | 600782 | 新钢股份   | 24,700 | 61,256.00 | 0.02 |
| 202 | 600105 | 永鼎股份   | 900    | 60,732.00 | 0.02 |
| 203 | 300394 | 天孚通信   | 200    | 60,536.00 | 0.02 |
| 204 | 002064 | 华峰化学   | 6,300  | 59,787.00 | 0.02 |
| 205 | 688188 | 柏楚电子   | 560    | 59,752.00 | 0.02 |
| 206 | 688403 | 汇成股份   | 1,500  | 59,550.00 | 0.02 |
| 207 | 000987 | 越秀资本   | 7,600  | 59,432.00 | 0.02 |
| 208 | 002541 | 鸿路钢构   | 3,400  | 58,888.00 | 0.02 |
| 209 | 000703 | 恒逸石化   | 4,300  | 58,351.00 | 0.02 |
| 210 | 601061 | 中信金属   | 5,400  | 58,158.00 | 0.02 |
| 211 | 688691 | 灿芯股份   | 500    | 57,965.00 | 0.02 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 212 | 688052 | 纳芯微  | 200    | 57,662.00 | 0.02 |
| 213 | 688629 | 华丰科技 | 300    | 56,253.00 | 0.02 |
| 214 | 603530 | 神马电力 | 1,100  | 55,990.00 | 0.02 |
| 215 | 600850 | 电科数字 | 3,840  | 55,910.40 | 0.02 |
| 216 | 300415 | 伊之密  | 2,800  | 55,748.00 | 0.02 |
| 217 | 688150 | 莱特光电 | 800    | 54,896.00 | 0.02 |
| 218 | 002237 | 恒邦股份 | 3,700  | 54,353.00 | 0.02 |
| 219 | 605376 | 博迁新材 | 200    | 54,260.00 | 0.02 |
| 220 | 600452 | 涪陵电力 | 5,800  | 54,114.00 | 0.02 |
| 221 | 600764 | 中国海防 | 3,100  | 54,033.00 | 0.02 |
| 222 | 603516 | 淳中科技 | 400    | 53,844.00 | 0.02 |
| 223 | 002929 | 润建股份 | 800    | 53,504.00 | 0.02 |
| 224 | 603979 | 金诚信  | 900    | 53,127.00 | 0.02 |
| 225 | 300747 | 锐科激光 | 1,000  | 53,090.00 | 0.02 |
| 226 | 688234 | 天岳先进 | 300    | 52,053.00 | 0.02 |
| 227 | 600267 | 海正药业 | 5,100  | 51,561.00 | 0.02 |
| 228 | 300809 | 华辰装备 | 1,900  | 51,395.00 | 0.02 |
| 229 | 002978 | 安宁股份 | 2,000  | 51,260.00 | 0.02 |
| 230 | 600176 | 中国巨石 | 700    | 51,016.00 | 0.02 |
| 231 | 601619 | 嘉泽新能 | 11,700 | 50,310.00 | 0.02 |
| 232 | 300779 | 惠城环保 | 980    | 49,196.00 | 0.02 |
| 233 | 002488 | 金固股份 | 5,500  | 49,005.00 | 0.02 |
| 234 | 603477 | 巨星农牧 | 3,300  | 48,840.00 | 0.02 |
| 235 | 688127 | 蓝特光学 | 500    | 48,800.00 | 0.02 |
| 236 | 002364 | 中恒电气 | 900    | 48,420.00 | 0.02 |
| 237 | 002011 | 盾安环境 | 4,500  | 47,745.00 | 0.02 |
| 238 | 601609 | 金田股份 | 4,400  | 47,520.00 | 0.02 |
| 239 | 000923 | 河钢资源 | 3,800  | 47,158.00 | 0.02 |
| 240 | 300416 | 苏试试验 | 2,300  | 46,874.00 | 0.02 |
| 241 | 002928 | 华夏航空 | 6,700  | 46,833.00 | 0.02 |
| 242 | 600295 | 鄂尔多斯 | 4,300  | 46,096.00 | 0.02 |
| 243 | 300705 | 九典制药 | 4,700  | 45,966.00 | 0.02 |
| 244 | 002916 | 深南电路 | 100    | 45,790.00 | 0.02 |
| 245 | 688568 | 中科星图 | 1,100  | 45,617.00 | 0.02 |
| 246 | 002004 | 华邦健康 | 11,600 | 45,588.00 | 0.02 |
| 247 | 603699 | 纽威股份 | 900    | 45,270.00 | 0.02 |
| 248 | 300244 | 迪安诊断 | 2,400  | 44,976.00 | 0.02 |
| 249 | 605020 | 永和股份 | 1,100  | 44,792.00 | 0.02 |
| 250 | 002615 | 哈尔斯  | 6,400  | 44,160.00 | 0.02 |
| 251 | 603179 | 新泉股份 | 880    | 43,692.00 | 0.02 |
| 252 | 000636 | 风华高科 | 600    | 43,344.00 | 0.02 |
| 253 | 603920 | 世运电路 | 900    | 43,236.00 | 0.02 |
| 254 | 688449 | 联芸科技 | 500    | 43,155.00 | 0.02 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 255 | 688584 | 上海合晶 | 1,200 | 43,140.00 | 0.02 |
| 256 | 300699 | 光威复材 | 1,500 | 42,975.00 | 0.02 |
| 257 | 002993 | 奥海科技 | 600   | 42,966.00 | 0.02 |
| 258 | 301363 | 美好医疗 | 2,300 | 42,159.00 | 0.02 |
| 259 | 000034 | 神州数码 | 1,500 | 41,625.00 | 0.02 |
| 260 | 301018 | 申菱环境 | 360   | 41,619.60 | 0.02 |
| 261 | 603678 | 火炬电子 | 500   | 41,500.00 | 0.02 |
| 262 | 601101 | 昊华能源 | 3,900 | 41,184.00 | 0.02 |
| 263 | 301458 | 钧崴电子 | 700   | 40,922.00 | 0.02 |
| 264 | 300814 | 中富电路 | 200   | 40,900.00 | 0.02 |
| 265 | 600259 | 中稀有色 | 400   | 40,644.00 | 0.01 |
| 266 | 000928 | 中钢国际 | 8,100 | 40,338.00 | 0.01 |
| 267 | 300613 | 富瀚微  | 500   | 40,040.00 | 0.01 |
| 268 | 600363 | 联创光电 | 1,100 | 39,358.00 | 0.01 |
| 269 | 300765 | 石药创新 | 1,400 | 38,122.00 | 0.01 |
| 270 | 603124 | 江南新材 | 200   | 37,396.00 | 0.01 |
| 271 | 688372 | 伟测科技 | 200   | 37,200.00 | 0.01 |
| 272 | 300037 | 新宙邦  | 400   | 37,140.00 | 0.01 |
| 273 | 603308 | 应流股份 | 600   | 36,240.00 | 0.01 |
| 274 | 301200 | 大族数控 | 100   | 36,065.00 | 0.01 |
| 275 | 688522 | 纳睿雷达 | 1,800 | 36,036.00 | 0.01 |
| 276 | 688385 | 复旦微电 | 500   | 35,645.00 | 0.01 |
| 277 | 600328 | 中盐化工 | 5,900 | 35,400.00 | 0.01 |
| 278 | 300724 | 捷佳伟创 | 500   | 35,300.00 | 0.01 |
| 279 | 688208 | 道通科技 | 1,400 | 35,266.00 | 0.01 |
| 280 | 301563 | 云汉芯城 | 200   | 34,878.00 | 0.01 |
| 281 | 300759 | 康龙化成 | 1,200 | 34,716.00 | 0.01 |
| 282 | 600595 | 中孚实业 | 6,100 | 34,282.00 | 0.01 |
| 283 | 300073 | 当升科技 | 700   | 33,628.00 | 0.01 |
| 284 | 301205 | 联特科技 | 100   | 33,410.00 | 0.01 |
| 285 | 300772 | 运达股份 | 2,700 | 33,210.00 | 0.01 |
| 286 | 688778 | 厦钨新能 | 600   | 32,640.00 | 0.01 |
| 287 | 603283 | 赛腾股份 | 390   | 31,582.20 | 0.01 |
| 288 | 688166 | 博瑞医药 | 900   | 31,509.00 | 0.01 |
| 289 | 600299 | 安迪苏  | 4,000 | 31,400.00 | 0.01 |
| 290 | 301606 | 绿联科技 | 500   | 30,510.00 | 0.01 |
| 291 | 601777 | 千里科技 | 3,700 | 30,192.00 | 0.01 |
| 292 | 688475 | 萤石网络 | 1,100 | 30,085.00 | 0.01 |
| 293 | 603013 | 亚普股份 | 1,900 | 30,001.00 | 0.01 |
| 294 | 605123 | 派克新材 | 300   | 29,103.00 | 0.01 |
| 295 | 301293 | 三博脑科 | 600   | 28,908.00 | 0.01 |
| 296 | 603786 | 科博达  | 700   | 28,637.00 | 0.01 |
| 297 | 688183 | 生益电子 | 200   | 26,480.00 | 0.01 |

|     |        |        |       |           |      |
|-----|--------|--------|-------|-----------|------|
| 298 | 002545 | 东方铁塔   | 1,600 | 25,952.00 | 0.01 |
| 299 | 300327 | 中颖电子   | 800   | 25,640.00 | 0.01 |
| 300 | 605577 | 龙版传媒   | 2,900 | 25,549.00 | 0.01 |
| 301 | 002706 | 良信股份   | 2,300 | 25,093.00 | 0.01 |
| 302 | 600007 | 中国国贸   | 1,300 | 24,674.00 | 0.01 |
| 303 | 688266 | 泽璟制药-U | 200   | 23,332.00 | 0.01 |
| 304 | 000603 | 盛达资源   | 1,000 | 23,100.00 | 0.01 |
| 305 | 601857 | 中国石油   | 2,600 | 22,568.00 | 0.01 |
| 306 | 601702 | 华峰铝业   | 1,600 | 22,560.00 | 0.01 |
| 307 | 603338 | 浙江鼎力   | 500   | 21,250.00 | 0.01 |
| 308 | 603225 | 新凤鸣    | 1,000 | 19,650.00 | 0.01 |
| 309 | 600456 | 宝钛股份   | 700   | 19,145.00 | 0.01 |
| 310 | 603766 | 隆鑫通用   | 1,600 | 19,088.00 | 0.01 |
| 311 | 600563 | 法拉电子   | 100   | 19,080.00 | 0.01 |
| 312 | 605589 | 圣泉集团   | 300   | 19,071.00 | 0.01 |
| 313 | 300811 | 铂科新材   | 200   | 18,978.00 | 0.01 |
| 314 | 600273 | 嘉化能源   | 2,800 | 18,256.00 | 0.01 |
| 315 | 600884 | 杉杉股份   | 1,300 | 17,615.00 | 0.01 |
| 316 | 002897 | 意华股份   | 200   | 17,596.00 | 0.01 |
| 317 | 300919 | 中伟新材   | 400   | 17,500.00 | 0.01 |
| 318 | 600258 | 首旅酒店   | 1,600 | 17,472.00 | 0.01 |
| 319 | 300972 | 万辰集团   | 100   | 17,341.00 | 0.01 |
| 320 | 002539 | 云图控股   | 1,500 | 16,980.00 | 0.01 |
| 321 | 688349 | 三一重能   | 1,000 | 15,180.00 | 0.01 |
| 322 | 002831 | 裕同科技   | 421   | 14,970.76 | 0.01 |
| 323 | 600502 | 安徽建工   | 3,300 | 14,355.00 | 0.01 |
| 324 | 601636 | 旗滨集团   | 1,400 | 14,322.00 | 0.01 |
| 325 | 600210 | 紫江企业   | 2,300 | 14,260.00 | 0.01 |
| 326 | 600362 | 江西铜业   | 300   | 12,990.00 | 0.00 |
| 327 | 002096 | 易普力    | 1,300 | 11,414.00 | 0.00 |
| 328 | 002270 | 华明装备   | 600   | 11,310.00 | 0.00 |
| 329 | 300624 | 万兴科技   | 200   | 10,374.00 | 0.00 |
| 330 | 601778 | 晶科科技   | 2,400 | 10,320.00 | 0.00 |
| 331 | 688114 | 华大智造   | 200   | 10,216.00 | 0.00 |
| 332 | 600588 | 用友网络   | 1,100 | 10,098.00 | 0.00 |
| 333 | 600020 | 中原高速   | 2,700 | 9,963.00  | 0.00 |
| 334 | 300855 | 图南股份   | 300   | 9,378.00  | 0.00 |
| 335 | 601001 | 晋控煤业   | 400   | 6,956.00  | 0.00 |
| 336 | 603919 | 金徽酒    | 400   | 6,020.00  | 0.00 |
| 337 | 000951 | 中国重汽   | 300   | 5,853.00  | 0.00 |
| 338 | 600641 | 先导基电   | 100   | 3,986.00  | 0.00 |
| 339 | 600032 | 浙江新能   | 500   | 3,525.00  | 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  | 688256 | 寒武纪  | 689,054.00 | 0.34           |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 685,108.00 | 0.34           |
| 3  | 601965 | 中国汽研 | 620,367.00 | 0.30           |
| 4  | 300308 | 中际旭创 | 618,063.00 | 0.30           |
| 5  | 600150 | 中国船舶 | 605,177.00 | 0.30           |
| 6  | 601155 | 新城控股 | 604,041.00 | 0.30           |
| 7  | 002436 | 兴森科技 | 585,904.00 | 0.29           |
| 8  | 603505 | 金石资源 | 579,248.00 | 0.28           |
| 9  | 601899 | 紫金矿业 | 578,402.00 | 0.28           |
| 10 | 600166 | 福田汽车 | 569,239.00 | 0.28           |
| 11 | 600030 | 中信证券 | 562,160.00 | 0.28           |
| 12 | 605011 | 杭州热电 | 545,205.00 | 0.27           |
| 13 | 600900 | 长江电力 | 531,045.00 | 0.26           |
| 14 | 002415 | 海康威视 | 503,453.00 | 0.25           |
| 15 | 601166 | 兴业银行 | 495,387.00 | 0.24           |
| 16 | 600100 | 同方股份 | 479,811.00 | 0.24           |
| 17 | 002011 | 盾安环境 | 467,268.00 | 0.23           |
| 18 | 300502 | 新易盛  | 467,031.00 | 0.23           |
| 19 | 600685 | 中船防务 | 466,747.00 | 0.23           |
| 20 | 002738 | 中矿资源 | 458,153.00 | 0.22           |

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  | 600519 | 贵州茅台 | 845,107.00 | 0.41           |
| 2  | 601166 | 兴业银行 | 766,735.00 | 0.38           |
| 3  | 688256 | 寒武纪  | 764,840.04 | 0.37           |
| 4  | 600900 | 长江电力 | 745,460.00 | 0.37           |
| 5  | 002436 | 兴森科技 | 742,755.00 | 0.36           |
| 6  | 002138 | 顺络电子 | 733,051.00 | 0.36           |
| 7  | 300308 | 中际旭创 | 696,694.00 | 0.34           |
| 8  | 601899 | 紫金矿业 | 683,986.00 | 0.34           |
| 9  | 002371 | 北方华创 | 628,955.00 | 0.31           |
| 10 | 300502 | 新易盛  | 590,223.00 | 0.29           |
| 11 | 688012 | 中微公司 | 576,082.95 | 0.28           |
| 12 | 601965 | 中国汽研 | 535,976.00 | 0.26           |
| 13 | 000657 | 中钨高新 | 528,395.00 | 0.26           |
| 14 | 688766 | 普冉股份 | 519,713.00 | 0.25           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 15 | 000811 | 冰轮环境 | 512,999.00 | 0.25 |
| 16 | 603505 | 金石资源 | 498,007.00 | 0.24 |
| 17 | 002531 | 天顺风能 | 482,968.00 | 0.24 |
| 18 | 002738 | 中矿资源 | 465,641.00 | 0.23 |
| 19 | 601328 | 交通银行 | 452,328.00 | 0.22 |
| 20 | 601801 | 皖新传媒 | 432,140.00 | 0.21 |

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 | 126,943,227.27 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 116,766,762.27 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 9,012,366.77   | 3.32         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 84,642,789.15  | 31.15        |
|    | 其中：政策性金融债 | 7,044,140.27   | 2.59         |
| 4  | 企业债券      | 217,872,982.83 | 80.17        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 311,528,138.75 | 114.63       |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称                   | 数量<br>（张） | 公允价值          | 占基金资产净值比例<br>（%） |
|----|-----------|------------------------|-----------|---------------|------------------|
| 1  | 240876    | 24 唐新 Y2               | 200,000   | 20,237,396.16 | 7.45             |
| 2  | 232680002 | 26 民生银行<br>二级资本债<br>01 | 200,000   | 20,223,226.30 | 7.44             |
| 3  | 242580034 | 25 成都银行<br>永续债 01      | 150,000   | 15,488,870.96 | 5.70             |
| 4  | 137943    | 22 电建 Y2               | 100,000   | 10,366,467.40 | 3.81             |
| 5  | 115743    | 建材 YK06                | 100,000   | 10,234,939.73 | 3.77             |

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  
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

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

成都银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局四川监管局的处罚。  
平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。  
中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局宁波监管局的处罚。

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 | 29,880.04  |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 222,961.88 |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |

|   |    |            |
|---|----|------------|
| 9 | 合计 | 252,841.92 |
|---|----|------------|

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

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<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>额比例<br>(%) | 持有份额           | 占总份<br>额比例<br>(%) |
| 鹏华安益<br>增强混合<br>A | 75               | 3,055.05      | 0.00          | 0.00              | 229,128.73     | 100.00            |
| 鹏华安益<br>增强混合<br>C | 79               | 14,043.29     | 0.00          | 0.00              | 1,109,419.77   | 100.00            |
| 鹏华安益<br>增强混合<br>D | 1,446            | 129,621.42    | 21,500,350.83 | 11.47             | 165,932,219.27 | 88.53             |
| 合计                | 1,600            | 117,981.95    | 21,500,350.83 | 11.39             | 167,270,767.77 | 88.61             |

8.2 盈利投资者数量占比

| 项目           | 过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日） |
|--------------|--------------------------------------|
| 盈利投资者数量占比（%） | 95.84                                |

注：无。

8.3 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<br>（%） |
|-------------------------|------------|------------|-----------------|
| 基金管<br>理人所有从业<br>人员持有本基 | 鹏华安益增强混合 A | 4,836.06   | 2.1106          |
|                         | 鹏华安益增强混合 C | -          | -               |
|                         | 鹏华安益增强混合 D | 214,528.70 | 0.1145          |

|   |    |            |        |
|---|----|------------|--------|
| 金 |    |            |        |
|   | 合计 | 219,364.76 | 0.1162 |

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。

8.4 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 | 鹏华安益增强混合 A | —                 |
|                                | 鹏华安益增强混合 C | —                 |
|                                | 鹏华安益增强混合 D | —                 |
|                                | 合计         | —                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 鹏华安益增强混合 A | 0~10              |
|                                | 鹏华安益增强混合 C | —                 |
|                                | 鹏华安益增强混合 D | 10~50             |
|                                | 合计         | 10~50             |

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未持有本基金份额。

2、截至本报告期末，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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 鹏华安益增强混合 A | 鹏华安益增强混合 C   | 鹏华安益增强混合 D     |
|--------------------------------|------------|--------------|----------------|
| 基金合同生效日（2017 年 2 月 22 日）基金份额总额 | —          | —            | 240,287,044.75 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 17,577.77  | 56,497.63    | 144,675,637.76 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 382,058.79 | 3,386,644.23 | 110,270,354.47 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 170,507.83 | 2,333,722.09 | 67,513,422.13  |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | —          | —            | —              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 229,128.73 | 1,109,419.77 | 187,432,570.10 |

## § 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：本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

#### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

#### 10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易           |                 | 应支付该券商的佣金 |               | 备注 |
|--------|--------|----------------|-----------------|-----------|---------------|----|
|        |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例(%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例(%) |    |
| 中金公司   | 1      | 106,985,531.39 | 43.90           | 48,237.16 | 43.90         | -  |
| 国泰海通证券 | 2      | 82,875,630.82  | 34.01           | 37,369.13 | 34.01         | -  |
| 国联民生证券 | 1      | 33,883,857.13  | 13.90           | 15,277.20 | 13.90         | -  |
| 兴业证券   | 1      | 19,964,970.20  | 8.19            | 9,002.35  | 8.19          | -  |
| 东方财富证券 | 1      | -              | -               | -         | -             | -  |
| 东吴证券   | 1      | -              | -               | -         | -             | -  |
| 方正证券   | 1      | -              | -               | -         | -             | -  |
| 国盛证券   | 1      | -              | -               | -         | -             | -  |
| 国信证券   | 2      | -              | -               | -         | -             | -  |
| 国元证券   | 1      | -              | -               | -         | -             | -  |
| 华西证券   | 1      | -              | -               | -         | -             | -  |
| 开源证券   | 1      | -              | -               | -         | -             | -  |
| 平安证券   | 1      | -              | -               | -         | -             | -  |
| 申万宏源证券 | 2      | -              | -               | -         | -             | -  |
| 世纪证券   | 1      | -              | -               | -         | -             | -  |
| 西南证券   | 1      | -              | -               | -         | -             | -  |
| 招商证券   | 1      | -              | -               | -         | -             | -  |
| 中泰证券   | 1      | -              | -               | -         | -             | -  |

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(%) |
| 中金公司   | 75,483,650.00 | 100.00          | 4,748,390,000.00 | 72.18             | -    | -               |
| 国泰海通证券 | -             | -               | 38,000,000.00    | 0.58              | -    | -               |
| 国联民生证券 | -             | -               | 1,792,530,000.00 | 27.25             | -    | -               |
| 兴业证券   | -             | -               | -                | -                 | -    | -               |
| 东方财富证券 | -             | -               | -                | -                 | -    | -               |
| 东吴证券   | -             | -               | -                | -                 | -    | -               |
| 方正证券   | -             | -               | -                | -                 | -    | -               |
| 国盛证券   | -             | -               | -                | -                 | -    | -               |
| 国信证券   | -             | -               | -                | -                 | -    | -               |
| 国元证券   | -             | -               | -                | -                 | -    | -               |
| 华西证券   | -             | -               | -                | -                 | -    | -               |
| 开源证券   | -             | -               | -                | -                 | -    | -               |
| 平安证券   | -             | -               | -                | -                 | -    | -               |
| 申万宏源证券 | -             | -               | -                | -                 | -    | -               |
| 世纪证券   | -             | -               | -                | -                 | -    | -               |
| 西南证券   | -             | -               | -                | -                 | -    | -               |

|          |   |   |   |   |   |   |
|----------|---|---|---|---|---|---|
| 招商证<br>券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证<br>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               | 《上海证券报》、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  | 鹏华安益增强混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告                     | 《上海证券报》、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               | 《上海证券报》、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 | 《上海证券报》、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  | 鹏华安益增强混合型证券投资基金（C 类基金份额）基金产品资料概要（更新）               | 《上海证券报》、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  | 鹏华安益增强混合型证券投资基金（A 类基金份额）基金产品资料概要（更新）               | 《上海证券报》、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  | 鹏华安益增强混合型证券投资基金更新的招募说明书                            | 《上海证券报》、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  | 鹏华安益增强混合型证券投资基金（D 类基金份额）基金产品资料概要（更新）               | 《上海证券报》、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  | 鹏华安益增强混合型证券投资基金 2025 年年度报告                         | 《上海证券报》、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 30 日 |
| 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                     | 《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国            | 2026 年 03 月 31 日 |

|    |                                                |                                 |                  |
|----|------------------------------------------------|---------------------------------|------------------|
|    | 有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告                       | 证监会基金电子披露网站                     |                  |
| 11 | 鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告                           | 《上海证券报》、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                        | 《上海证券报》、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 | 鹏华安益增强混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告                 | 《上海证券报》、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 | 《上海证券报》、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           | 《上海证券报》、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       | 《上海证券报》、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）《鹏华安益增强混合型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华安益增强混合型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华安益增强混合型证券投资基金 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