鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 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

报告送出日期：2026 年 10 月 26 日

§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责任。

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 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华恒生 ETF
场内简称	恒生 ETF 鹏华
基金主代码	159271
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 7 月 30 日
报告期末基金份额总额	229,386,731.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。
投资策略	本基金主要通过投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）等实现对标的指数的紧密跟踪，本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 1、股票投资策略 本基金主要采取抽样复制法，基金管理人将综合考虑代表性、相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中成份股或备选成份股构建指数化投资组合，使构建的投资组合与标的指数在风险收益特征上尽可能相似，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过投资目标所述范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

	为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人还可以综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本及基金规模等因素，决定是否采用完全复制法的策略。完全复制法指完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整；当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差。因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）标的指数成份股进行配股、增发或被吸收合并；（5）标的指数成份股派发现金股息；（6）指数成份股定期或临时调整；（7）标的指数编制方法发生变化；（8）其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。若本基金决定修改复制方法，将在更换复制方法前按规定履行适当程序并公告。 2、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 3、债券投资策略 本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。 本基金可投资可转换债券及可交换债券，可转换债券及可交换债券兼具债权和股权双重属性，本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析，结合本基金的产品定位和投资目标综合开展投资决策。 4、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 5、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

	6、融资及转融通投资策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。
业绩比较基准	恒生指数收益率（经汇率调整后）
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 本基金主要通过港股通投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。
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

注：无。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）
1.本期已实现收益	10,475,754.72
2.本期利润	32,216,733.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.0995
4.期末基金资产净值	214,400,799.89
5.期末基金份额净值	0.9347

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。

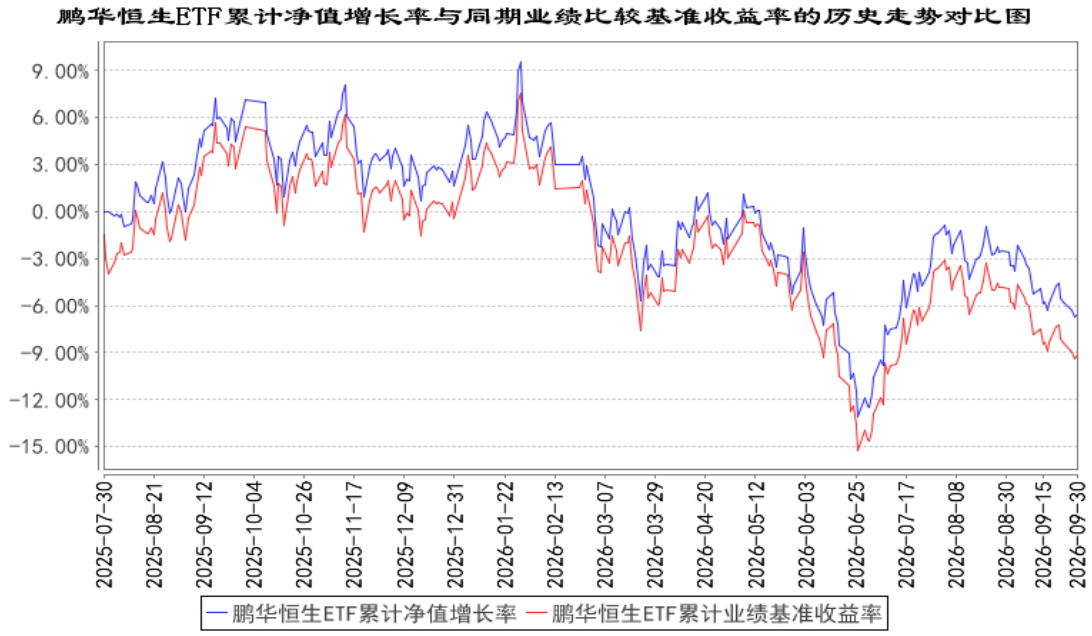
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.69%	0.96%	6.32%	0.97%	0.37%	-0.01%
过去六个月	-2.51%	1.04%	-3.46%	1.06%	0.95%	-0.02%
过去一年	-12.76%	1.10%	-13.83%	1.13%	1.07%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-6.53%	1.08%	-9.14%	1.12%	2.61%	-0.04%

注：业绩比较基准=恒生指数收益率（经汇率调整后）。

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



注：1、本基金基金合同于　2025 年 07 月 30 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张羽翔	本基金的基金经理	2025-07-30	2026-08-06	19 年	张羽翔先生,国籍中国,工学硕士,19 年证券从业经验。曾任招商银行软件中心(原深圳市融博技术公司)数据分析师;2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司,历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员,先后从事金融工程、量化研究等工作;现担任指数与量化投资部基金经理。2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2016 年 06 月至 2018 年 05 月担任鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金经理,2016 年 07 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理,2016 年 09 月至 2022 年 08 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理,2016 年 09 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理,2016 年 11 月至 2020 年 07 月担任鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金经理,2016 年 11 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理,2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理,2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华创业板指数分级证券投资基金基金经理,2018 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理,2018 年 05 月至 2020 年 12 月担任鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金经理,2018 年 05 月至 2021 年 10 月担任鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金（LOF）基金经理,2019 年 04 月至今担任鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019 年 07 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证国防交易型开放式指数证券投资

					基金基金经理,2019 年 11 月至今担任鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金（LOF）基金经理,2019 年 12 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2020 年 02 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证 800 证券保险交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2020 年 03 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证移动互联网指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证高铁产业指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至 2022 年 08 月担任鹏华创业板指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至今担任鹏华中证酒指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证传媒指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证银行指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 07 月至今担任鹏华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021 年 08 月至今担任鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021 年 08 月至 2026 年 06 月担任鹏华中证医药卫生指数证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 12 月至今担任鹏华中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2022 年 07 月至今担任鹏华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2022 年 11 月至今担任鹏华中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2023 年 05 月至今担任鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2024 年 07 月至今担任鹏华中证港股通科技交

					易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,2024 年 07 月至今担任鹏华中证港股通医药卫生综合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 01 月至 2026 年 09 月担任鹏华恒生港股通红利指数发起式证券投资基金基金经理,2025 年 04 月至 2026 年 05 月担任鹏华上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2025 年 06 月至今担任鹏华国证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2025 年 07 月至 2026 年 08 月担任鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2025 年 08 月至今担任鹏华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2025 年 11 月至今担任鹏华恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2026 年 04 月至今担任鹏华恒生港股通汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2026 年 05 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份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,2026 年 05 月至今担任鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2026 年 06 月至今担任鹏华中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2026 年 08 月至今担任鹏华中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金基金经理,张羽翔先生具备基金从业资格。
余展昌	本基金的基金经理	2025-07-30	-	9 年	余展昌先生,国籍中国,金融硕士,9 年证券从业经验。2017 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量化研究员、高级量化研究员,2020 年 8 月至 2022 年 10 月担任量化及衍生品投资部投资经理,现担任指数与量化投资部总经理助理/基金经理。2022 年 10 月至今担任鹏华中证 800 证券保险交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2022 年 10 月至今担任鹏华中证 800 证券保险指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2022 年 10 月至今担任鹏华中证全指证券公司指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2022 年 10 月至今担任鹏华中证

					银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2022 年 10 月至今担任鹏华中证银行指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2022 年 10 月至今担任鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2023 年 08 月至今担任鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理,2023 年 08 月至 2026 年 03 月担任鹏华创业板指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2024 年 04 月至今担任鹏华恒生中国央企交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理,2024 年 11 月至今担任鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2024 年 12 月至今担任鹏华上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2024 年 12 月至 2025 年 01 月担任鹏华中证 A500 指数证券投资基金基金经理,2025 年 01 月至今担任鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2025 年 01 月至 2025 年 03 月担任鹏华上证 180 指数发起式证券投资基金基金经理,2025 年 01 月至 2026 年 03 月担任鹏华恒生港股通高股息率指数发起式证券投资基金基金经理,2025 年 02 月至今担任鹏华上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2025 年 03 月至今担任鹏华恒生中国央企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 03 月至今担任鹏华上证 180 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 05 月至今担任鹏华上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2025 年 07 月至今担任鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2025 年 09 月至今担任鹏华标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2026 年 05 月至今担任鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,余展昌先生具备基金从业资格。

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 6 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

作为宽基指数基金，本基金旨在为看好该主题的投资者提供投资工具。本报告期内，本基金秉承指数基金的投资策略，力争跟踪指数的收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。ETF 的跟踪误差的主要来源分为几个方面，包括成分股的调整、港股日常申赎的交易、股票的分红等。为了进一步控制跟踪误差，鹏华基金建立了一套完备的 ETF 跟踪机制，事前对成分股的异动进行密切跟踪，及时调整，在交易环节采用算法交易等方式进一步减少交易冲击成本和摩擦，在仓位控制上，基金经理在紧密跟踪指数的基础上，也会针对客户申赎的情况做优化调整。

2026 年三季度，恒生指数三季度走出 7 月强劲反弹、8 月冲高回落、9 月再度调整的“先扬后抑”震荡行情。整体呈现强价值、弱科技的极致风格分化。作为离岸人民币资产，恒指同时受美债美元（外部流动性）、国内基本面、南向资金三重驱动。7 月份，恒生指数前期的悲观预期修复，叠加南向资金大幅进场、美债阶段性缓和，恒指从低位启动反弹，一度上探阶段高点；金融、能源、原材料顺周期板块领涨，互联网与医药同步修复，是本季度最强窗口。8 月后美联储

释放偏鹰信号，美债长端再度上行、美元走强，外资风险偏好快速回落；叠加港股大规模解禁供给压力，资金兑现离场，指数高位震荡走弱。内部风格迅速转向红利，互联网、创新药等长久期成长率先回调。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 6.69%，同期业绩比较基准增长率为 6.32%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	209,047,818.99	96.57
	其中：股票	209,047,818.99	96.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,857,790.55	2.71
8	其他资产	1,567,199.98	0.72
9	合计	216,472,809.52	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

2、本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 209,047,818.99 元，占净值比 97.50%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

注：无。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：无。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	10,395,174.34	4.85
原材料	4,444,048.93	2.07
工业	10,752,582.64	5.02
非日常生活消费品	35,079,595.97	16.36
日常消费品	4,166,660.37	1.94
医疗保健	12,272,574.08	5.72
金融	70,107,187.15	32.70
信息技术	14,477,843.89	6.75
通信服务	35,350,575.13	16.49
公用事业	5,166,735.57	2.41
房地产	6,834,840.92	3.19
合计	209,047,818.99	97.50

注：以上分类采用国际通用行业分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	56,000	20,718,825.12	9.66
2	00005	汇丰控股	124,800	16,926,668.93	7.89
3	09988	阿里巴巴-W	181,800	16,636,076.59	7.76
4	00939	建设银行	1,419,000	11,961,722.16	5.58
5	01299	友邦保险	152,600	9,641,224.05	4.50
6	01398	工商银行	1,216,000	8,047,996.53	3.75
7	00941	中国移动	92,000	6,274,535.15	2.93
8	03690	美团-W	101,000	6,216,420.11	2.90
9	00388	香港交易所	17,800	5,925,535.91	2.76
10	01810	小米集团-W	266,200	5,767,627.84	2.69

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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

中国工商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、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。

中国建设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、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。

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。

5.11.2 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约定的证券备选库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	875,074.04
3	应收股利	661,880.15
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,245.79
8	其他	-
9	合计	1,567,199.98

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	306,386,731.00
报告期期间基金总申购份额	324,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	401,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	229,386,731.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20260701~20260930	233,706,616.00	228,426,200.00	294,356,200.00	167,776,616.00	73.14
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（一）《鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

（二）《鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

（三）《鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 3 季度报告》（原文）。

9.2 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。

9.3 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 10 月 26 日