

鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指 数证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51

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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
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	54
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	1000ETF 增强
场内简称	1000 鹏华(扩位简称:中证 1000 增强 ETF 鹏华)
基金主代码	560590
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 1 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,710,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求有效跟踪标的指数基础上，通过主动化投资管理，力争获取超越指数表现的投资收益。
投资策略	1、股票投资策略 本基金以中证 1000 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争获取超越指数表现的投资收益。 指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子量化选股模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，力求实现超额收益。 （1）多因子量化选股模型 本基金将以多因子量化选股模型构建股票组合。多因子模型针对个股构建价值、质量、动量、成长、一致预期等因子，通过量化方法处理因子与个股超额回报之间的特征关系，挑选出具有基本面逻辑支撑和统计意义有效的因子组合，进而得出具有稳定超额回报的股票组合。本基金对因子的有效性进行持续的跟踪，分析其变化规律，基金经理根据市场状况结合因子变化趋势，对模型使用的因子结构进行动态调整。 （2）风险控制与调整 本基金在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。 本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 6.5%。

	(3) 投资组合优化模型 本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。选股范围以标的指数成份股为主，也包括非成份股中与成份股相关性强，流动性好，基本面信息充足的股票。 (4) 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。 2、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综合开展投资决策，以增强本基金的收益。 3、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，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。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。 4、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。 5、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，本基金在履行适当程序后可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
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。
--	----------------------

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高永杰	张姗
	联系电话	0755-81395402	400-61-95555
	电子邮箱	xxp1@phfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4006788533	400-61-95555
传真		0755-82021126	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		张纳沙	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告置备地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,406,348.93
本期利润	3,791,938.44
加权平均基金份额本期利润	0.2042
本期加权平均净值利润率	13.12%
本期基金份额净值增长率	12.71%
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	8,496,462.24
期末可供分配基金份额利润	0.6197
期末基金资产净值	22,206,462.24

期末基金份额净值	1.6197
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	61.97%

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

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

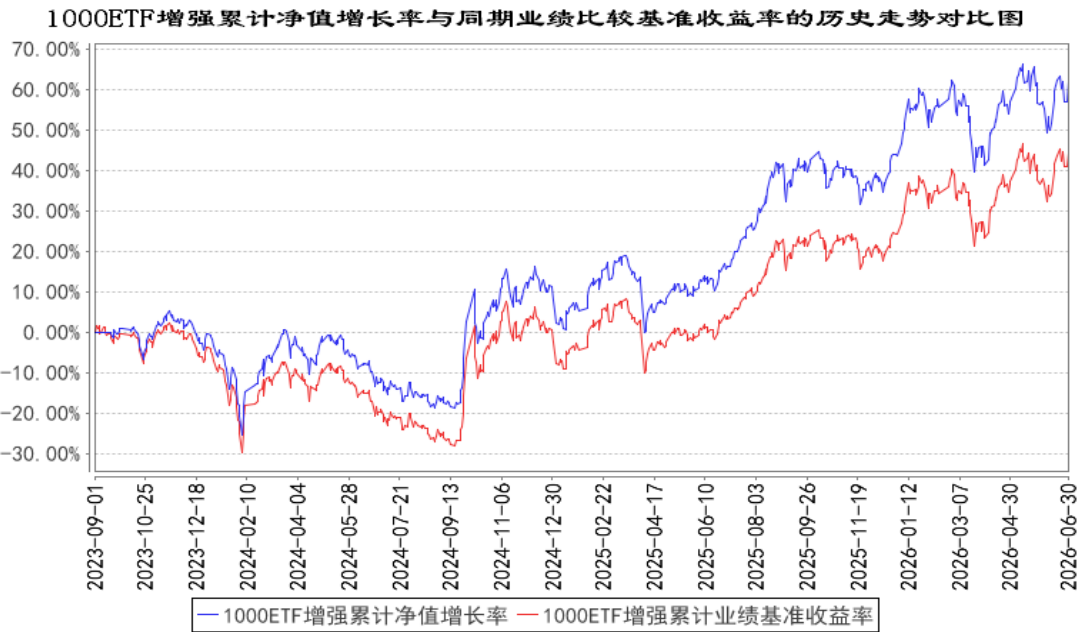
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.00%	1.66%	15.62%	1.61%	-2.62%	0.05%
过去六个月	12.71%	1.66%	15.99%	1.62%	-3.28%	0.04%
过去一年	38.63%	1.42%	38.60%	1.38%	0.03%	0.04%
自基金合同生效起至今	61.97%	1.63%	44.32%	1.69%	17.65%	-0.06%

注：业绩比较基准=中证 1000 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



注：1、本基金基金合同于 2023 年 09 月 01 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		

寇斌权	本基金的基金经理	2023-12-09	2026-04-11	8 年	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。
陈鸿旭	本基金的基金经理	2026-04-11	-	5 年	陈鸿旭先生, 国籍中国, 理学硕士, 5 年证券从业经验。2021 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任量化及衍生品投资部助理量化研究员、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。2026 年 04 月至今担任鹏华上证科创

					板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2026 年 04 月至今担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 05 月至今担任鹏华中证科创创业 50 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基金经理，陈鸿旭先生具备基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金严格控制中证 1000 基准指数跟踪误差，依托量化模型动态选股，稳健博取超额收益。组合持续优化多周期、多维度因子配置，加大低相关性优质因子研发迭代力度，适配

市场快速轮动的特征。同时紧密跟踪资金面、市场情绪变化对风格切换的影响，从策略优化、风险管控双向发力，持续提升组合收益风险比，在模型长期有效性与短期市场适应性之间寻求均衡，保持稳健均衡的运作风格。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 12.71%，同期业绩比较基准增长率为 15.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年下半年国内经济将持续推进由总量驱动向结构驱动的中长期转型，增长动能逐步脱离地产、高杠杆旧路径，核心依靠科技赋能带来的生产效率改善、高端产业升级与新旧动能持续转换，AI 已成为重塑国内经济产业格局的核心底层变量。内需维持温和修复、长期向好的格局，地产行业拖累效应将继续边际弱化，基建、制造业投资持续发挥经济“稳定器”作用；消费板块虽受居民收入预期约束存在修复节奏波动，但稳内需政策持续落地有望带动消费需求稳步回暖。

产业维度呈现清晰分化特征：一批前期高速扩张的大盘科技赛道步入成熟发展期，行业竞争格局出清优化，资本开支回归平稳，盈利、现金流稳定性持续增强，具备新经济红利属性，逐步成为传统价值红利资产的优质替代。而以中证 1000 成分标的为代表的中小盘科创企业仍处在创新成长红利期，AI 场景落地、先进制造升级、半导体设备与材料国产替代多重逻辑共振，持续释放稳定超额收益，是权益增强策略核心布局方向。

权益市场整体维持结构性行情主导，市场风格轮动特征显著，科技成长贯穿全年主线。行情轮动将主要体现为大盘成长与中小盘成长内部切换：具备全球竞争力的大盘科技龙头延续强势行情，若阶段性交易拥挤，资金将持续向估值、成长性价比更优的小盘科创分流，AI 全行业渗透持续为中小市值企业提供持续 Alpha 收益；成长板块高波动特性下，市场轮动将更多在成长、均衡大中盘宽基间展开，传统成长与价值大幅跷跷板行情弱化。

风险层面，外部地缘博弈、全球宏观波动、高端 GPU、光刻机等核心设备技术限制将阶段性压制市场风险偏好；内部传统行业盈利承压、地方财政修复偏慢等转型摩擦因素，仅会扰动市场短期节奏，难以扭转中期结构向好主线。

综合来看，2026 年下半年市场结构性机会充足，中证 1000 覆盖的中小盘科创赛道兼具成长空间与估值优势，AI 应用、半导体国产替代、高端制造细分具备持续超额收益潜力；同时兼顾现金流稳定的成熟科技龙头做均衡配置，能够更好把握市场内部风格轮动行情，实现增强组合长期收益增厚。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引

和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、风控管理部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 8,496,462.24 元，期末基金份额净值 1.6197 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

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的

全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	519,859.16	697,708.64
结算备付金		146,600.39	-
存出保证金		22,818.58	15,978.25
交易性金融资产	6.4.7.2	21,322,636.85	19,019,290.64
其中：股票投资		21,322,636.85	19,019,290.64
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		108,502.01	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	120,000.00	-
资产总计		22,240,416.99	19,732,977.53
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		18,141.95	15,201.79
应付托管费		3,401.61	2,850.34
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	12,411.19	12,032.10
负债合计		33,954.75	30,084.23
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	13,710,000.00	13,710,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	8,496,462.24	5,992,893.30
净资产合计		22,206,462.24	19,702,893.30
负债和净资产总计		22,240,416.99	19,732,977.53

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6197 元，基金份额总额 13,710,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,928,817.07	1,603,093.82
1. 利息收入		1,558.86	2,085.59
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,558.86	2,085.59
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,450,662.82	149,833.92
其中：股票投资收益	6.4.7.14	4,327,898.29	56,971.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	122,764.53	92,862.33
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	-614,410.49	1,344,708.41
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	91,005.88	106,465.90
减：二、营业总支出		136,878.63	74,293.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	114,528.42	61,825.91
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	21,474.05	11,592.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	876.16	875.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,791,938.44	1,528,799.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,791,938.44	1,528,799.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,791,938.44	1,528,799.87

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	13,710,000.00	-	5,992,893.30	19,702,893.30
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	13,710,000.00	-	5,992,893.30	19,702,893.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	2,503,568.94	2,503,568.94
(一)、综合收益总额	-	-	3,791,938.44	3,791,938.44
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-1,288,369.50	-1,288,369.50
其中：1. 基金申购款	33,000,000.00	-	17,355,832.03	50,355,832.03
2. 基金赎回款	-33,000,000.00	-	-18,644,201.53	-51,644,201.53
(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	13,710,000.00	-	8,496,462.24	22,206,462.24
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	16,710,000.00	-	1,344,990.74	18,054,990.74

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	16,710,000.00	-	1,344,990.74	18,054,990.74
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,000,000.00	-	963,710.40	-2,036,289.60
(一)、综合收益总额	-	-	1,528,799.87	1,528,799.87
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-3,000,000.00	-	-565,089.47	-3,565,089.47
其中：1. 基金申购款	36,000,000.00	-	3,993,655.11	39,993,655.11
2. 基金赎回款	-39,000,000.00	-	-4,558,744.58	-43,558,744.58
(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	13,710,000.00	-	2,308,701.14	16,018,701.14

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

聂连杰

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]428 号《关于准予鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数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《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,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 205,710,000.00 元,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(23)第 00220 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2023 年 9 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 205,710,000.00 份基金份额,无认购资金利息份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》和《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》和财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，截至 2027 年 12 月 31 日适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股

息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	519,859.16
等于：本金	519,803.61
加：应计利息	55.55
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	519,859.16

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	21,308,315.24	-	21,322,636.85	14,321.61

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	21,308,315.24	-	21,322,636.85	14,321.61

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	120,000.00
待摊费用	-
合计	120,000.00

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	12,411.19
其中：交易所市场	12,411.19
银行间市场	-
应付利息	-
合计	12,411.19

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,710,000.00	13,710,000.00
本期申购	33,000,000.00	33,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-33,000,000.00	-33,000,000.00

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	13,710,000.00	13,710,000.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,374,373.95	-381,480.65	5,992,893.30
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	6,374,373.95	-381,480.65	5,992,893.30
本期利润	4,406,348.93	-614,410.49	3,791,938.44
本期基金份额交易产生的变动数	-1,335,193.52	46,824.02	-1,288,369.50
其中：基金申购款	17,672,633.93	-316,801.90	17,355,832.03
基金赎回款	-19,007,827.45	363,625.92	-18,644,201.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,445,529.36	-949,067.12	8,496,462.24

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,357.05
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	175.01
其他	26.80
合计	1,558.86

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
----	----

	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	3,559,734.27
股票投资收益——赎回差价收入	768,164.02
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	4,327,898.29

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	53,604,835.03
减：卖出股票成本总额	49,991,354.96
减：交易费用	53,745.80
买卖股票差价收入	3,559,734.27

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	51,644,201.53
减：现金支付赎回款总额	28,169,543.53
减：赎回股票成本总额	22,706,493.98
减：交易费用	—
赎回差价收入	768,164.02

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	122,764.53
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	122,764.53

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-614,410.49
股票投资	-614,410.49
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	-614,410.49

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	91,005.88
合计	91,005.88

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	876.16
合计	876.16

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金的一级交易商

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金 额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
国信证券	-	-	71,186,144.78	71.61

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
国信证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
国信证券	13,229.46	71.60	3,531.58	64.44

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	114,528.42	61,825.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	25,748.70	8,102.83
应支付基金管理人的净管理费	88,779.72	53,723.08

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.80%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.80%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	21,474.05	11,592.31

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	519,859.16	1,357.05	1,054,767.96	1,810.74

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

本报告期内，本基金在迷你期间如涉及信息披露费、审计费等固定费用的，上述费用由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。本基金本报告期内基金管理人承担的上述各类费用合计为人民币 73,887.67 元（该金额为未经审计的预估金额）。

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

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金。本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理

人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时或于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	519,859.16	-	-	-	519,859.16
结算备付金	146,600.39	-	-	-	146,600.39
存出保证金	22,818.58	-	-	-	22,818.58
交易性金融资产	-	-	-	21,322,636.85	21,322,636.85
应收清算款	-	-	-	108,502.01	108,502.01
其他资产	-	-	-	120,000.00	120,000.00
资产总计	689,278.13	-	-	21,551,138.86	22,240,416.99
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	18,141.95	18,141.95
应付托管费	-	-	-	3,401.61	3,401.61

其他负债	-	-	-	12,411.19	12,411.19
负债总计	-	-	-	33,954.75	33,954.75
利率敏感度缺口	689,278.13	-	-	21,517,184.11	22,206,462.24
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	697,708.64	-	-	-	697,708.64
存出保证金	15,978.25	-	-	-	15,978.25
交易性金融资产	-	-	-	19,019,290.64	19,019,290.64
资产总计	713,686.89	-	-	19,019,290.64	19,732,977.53
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	15,201.79	15,201.79
应付托管费	-	-	-	2,850.34	2,850.34
其他负债	-	-	-	12,032.10	12,032.10
负债总计	-	-	-	30,084.23	30,084.23
利率敏感度缺口	713,686.89	-	-	18,989,206.41	19,702,893.30

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份券和备选成份券证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个券在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应调整。

同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：投资于股票及存托凭证资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，可在履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	21,322,636.85	96.02	19,019,290.64	96.53
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	21,322,636.85	96.02	19,019,290.64	96.53

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	1, 127, 866. 22	969, 185. 32
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-1, 127, 866. 22	-969, 185. 32

注：无。

6. 4. 13. 4. 4 采用风险价值法管理风险

无。

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	21, 322, 636. 85
第二层次	-
第三层次	-
合计	21, 322, 636. 85

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易

不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	21,322,636.85	95.87
	其中：股票	21,322,636.85	95.87
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	666,459.55	3.00
8	其他各项资产	251,320.59	1.13
9	合计	22,240,416.99	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	207,285.60	0.93
B	采矿业	646,339.00	2.91

C	制造业	12,245,067.95	55.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	237,073.00	1.07
E	建筑业	62,370.00	0.28
F	批发和零售业	133,181.00	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	244,536.00	1.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,400,844.40	10.81
J	金融业	238,983.00	1.08
K	房地产业	151,917.00	0.68
L	租赁和商务服务业	83,752.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	404,152.60	1.82
N	水利、环境和公共设施管理业	195,289.00	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	22,916.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	180,250.00	0.81
S	综合	9,368.00	0.04
	合计	17,463,324.55	78.64

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	210,765.00	0.95
C	制造业	2,519,062.50	11.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	120,995.00	0.54
E	建筑业	29,000.00	0.13
F	批发和零售业	58,460.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	61,815.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件	320,339.00	1.44

	和信息技术服务业		
J	金融业	198,271.00	0.89
K	房地产业	134,700.00	0.61
L	租赁和商务服务业	128,920.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	64,172.80	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	12,812.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	3,859,312.30	17.38

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688596	正帆科技	2,800	221,368.00	1.00
2	688484	南芯科技	3,600	203,364.00	0.92
3	688001	华兴源创	2,300	197,110.00	0.89
4	002947	恒铭达	2,400	182,520.00	0.82
5	300693	盛弘股份	3,600	175,500.00	0.79
6	688141	杰华特	1,100	168,850.00	0.76
7	002531	天顺风能	20,000	168,600.00	0.76
8	688593	新相微	4,300	167,356.00	0.75
9	002237	恒邦股份	11,300	165,997.00	0.75
10	002497	雅化集团	8,100	164,997.00	0.74
11	301297	富乐德	2,600	159,224.00	0.72
12	688432	有研硅	3,800	151,886.00	0.68
13	300438	鹏辉能源	1,800	149,130.00	0.67
14	300811	铂科新材	1,560	148,028.40	0.67
15	300672	国科微	500	147,500.00	0.66
16	301316	慧博云通	3,700	145,706.00	0.66

17	002145	钛能化学	30,700	144,597.00	0.65
18	688150	莱特光电	2,100	144,102.00	0.65
19	300257	开山股份	5,000	143,400.00	0.65
20	688167	炬光科技	400	141,684.00	0.64
21	603283	赛腾股份	1,690	136,856.20	0.62
22	002458	益生股份	17,580	136,596.60	0.62
23	300687	赛意信息	4,400	136,400.00	0.61
24	600114	东睦股份	3,600	135,936.00	0.61
25	601918	新集能源	15,600	134,004.00	0.60
26	688352	顾中科技	5,500	132,990.00	0.60
27	603063	禾望电气	2,500	132,225.00	0.60
28	300199	翰宇药业	5,900	130,272.00	0.59
29	300602	飞荣达	2,500	128,000.00	0.58
30	301238	瑞泰新材	5,100	124,440.00	0.56
31	002396	星网锐捷	6,490	124,413.30	0.56
32	000612	焦作万方	11,700	123,903.00	0.56
33	688107	安路科技	2,600	118,560.00	0.53
34	002324	普利特	9,800	118,286.00	0.53
35	688559	海目星	1,400	117,488.00	0.53
36	603588	高能环境	6,000	115,200.00	0.52
37	601519	大智慧	13,200	113,916.00	0.51
38	688279	峰昭科技	500	112,220.00	0.51
39	600577	精达股份	10,900	106,602.00	0.48
40	002897	意华股份	1,200	105,576.00	0.48
41	601020	华钰矿业	4,400	105,556.00	0.48
42	002745	木林森	8,100	101,655.00	0.46
43	600850	电科数字	6,960	101,337.60	0.46
44	301511	德福科技	700	100,695.00	0.45
45	600409	三友化工	16,300	99,593.00	0.45
46	300031	宝通科技	3,400	97,138.00	0.44
47	601069	西部黄金	4,400	96,800.00	0.44
48	300762	上海瀚讯	2,100	95,865.00	0.43
49	600331	宏达股份	8,700	95,613.00	0.43
50	300682	朗新科技	9,500	94,050.00	0.42
51	688025	杰普特	200	94,000.00	0.42
52	001339	智微智能	910	93,074.80	0.42
53	688392	骄成超声	400	90,872.00	0.41
54	002545	东方铁塔	5,600	90,832.00	0.41
55	688321	微芯生物	3,400	89,522.00	0.40
56	300773	拉卡拉	5,700	87,210.00	0.39
57	688123	聚辰股份	400	85,040.00	0.38
58	300363	博腾股份	5,200	84,448.00	0.38
59	600641	先导基电	2,100	83,706.00	0.38

60	688403	汇成股份	2,100	83,370.00	0.38
61	688548	广钢气体	1,600	83,360.00	0.38
62	688605	先锋精科	800	83,216.00	0.37
63	300322	硕贝德	3,300	83,160.00	0.37
64	603306	华懋科技	800	82,952.00	0.37
65	002004	华邦健康	20,800	81,744.00	0.37
66	688110	东芯股份	400	81,480.00	0.37
67	000058	深赛格	13,100	80,434.00	0.36
68	688652	京仪装备	400	80,068.00	0.36
69	688503	聚和材料	600	79,620.00	0.36
70	000534	万泽股份	2,900	79,344.00	0.36
71	688195	腾景科技	400	77,032.00	0.35
72	301268	铭利达	5,500	76,890.00	0.35
73	301626	苏州天脉	200	76,792.00	0.35
74	603083	剑桥科技	300	76,461.00	0.34
75	300726	宏达电子	900	76,113.00	0.34
76	688486	龙迅股份	1,180	75,024.40	0.34
77	688668	鼎通科技	200	74,660.00	0.34
78	688372	伟测科技	400	74,400.00	0.34
79	300131	英唐智控	3,900	74,217.00	0.33
80	300457	赢合科技	3,500	73,780.00	0.33
81	300130	新国都	3,500	73,640.00	0.33
82	688182	灿勤科技	1,700	73,219.00	0.33
83	688800	瑞可达	760	72,937.20	0.33
84	000917	电广传媒	10,900	72,921.00	0.33
85	002979	雷赛智能	1,300	72,514.00	0.33
86	301327	华宝新能	1,500	72,105.00	0.32
87	002978	安宁股份	2,800	71,764.00	0.32
88	301031	中熔电气	600	71,670.00	0.32
89	688531	日联科技	400	71,136.00	0.32
90	300134	大富科技	8,200	70,110.00	0.32
91	300133	华策影视	9,900	70,092.00	0.32
92	688146	中船特气	200	69,998.00	0.32
93	601126	四方股份	1,100	69,520.00	0.31
94	688262	国芯科技	1,600	69,168.00	0.31
95	300870	欧陆通	200	69,138.00	0.31
96	688449	联芸科技	800	69,048.00	0.31
97	002097	山河智能	9,500	68,685.00	0.31
98	600623	华谊集团	8,500	68,595.00	0.31
99	688433	华曙高科	800	68,480.00	0.31
100	600509	天富能源	8,100	68,445.00	0.31
101	600773	西藏城投	5,300	68,211.00	0.31
102	600428	中远海特	8,700	67,947.00	0.31

103	300684	中石科技	1,100	67,100.00	0.30
104	301205	联特科技	200	66,820.00	0.30
105	002151	北斗星通	2,100	66,675.00	0.30
106	603612	索通发展	3,600	65,268.00	0.29
107	000935	四川双马	2,500	65,225.00	0.29
108	002290	禾盛新材	700	64,309.00	0.29
109	002518	科士达	1,200	64,308.00	0.29
110	002468	申通快递	4,400	64,064.00	0.29
111	300613	富瀚微	800	64,064.00	0.29
112	601975	招商南油	17,000	63,410.00	0.29
113	688779	五矿新能	7,800	63,258.00	0.28
114	002484	江海股份	600	63,000.00	0.28
115	000685	中山公用	5,600	62,496.00	0.28
116	300101	振芯科技	3,800	61,446.00	0.28
117	688409	富创精密	200	61,250.00	0.28
118	300416	苏试试验	3,000	61,140.00	0.28
119	300171	东富龙	5,500	60,830.00	0.27
120	601963	重庆银行	6,000	60,480.00	0.27
121	601101	昊华能源	5,700	60,192.00	0.27
122	605111	新洁能	600	59,484.00	0.27
123	605090	九丰能源	1,600	59,472.00	0.27
124	301095	广立微	500	59,025.00	0.27
125	688158	优刻得-W	1,600	58,816.00	0.26
126	300049	福瑞医科	1,500	58,320.00	0.26
127	603057	紫燕食品	2,600	57,980.00	0.26
128	300861	美畅股份	2,300	57,937.00	0.26
129	600963	岳阳林纸	19,000	57,760.00	0.26
130	300925	法本信息	3,900	57,681.00	0.26
131	300761	立华股份	3,500	57,435.00	0.26
132	301029	怡合达	2,100	56,721.00	0.26
133	600718	东软集团	7,800	56,472.00	0.25
134	301219	腾远钴业	1,030	56,444.00	0.25
135	603279	景津装备	4,700	56,400.00	0.25
136	300806	斯迪克	500	56,000.00	0.25
137	002389	航天彩虹	3,100	55,087.00	0.25
138	601677	明泰铝业	3,300	54,780.00	0.25
139	600201	生物股份	4,700	54,755.00	0.25
140	002270	华明装备	2,900	54,665.00	0.25
141	301196	唯科科技	430	53,930.60	0.24
142	603219	富佳股份	3,400	52,972.00	0.24
143	300236	上海新阳	400	52,600.00	0.24
144	688698	伟创电气	1,000	52,450.00	0.24
145	600961	株冶集团	1,605	51,985.95	0.23

146	688102	斯瑞新材	1,100	51,898.00	0.23
147	301510	固高科技	1,600	51,088.00	0.23
148	300775	三角防务	2,300	50,692.00	0.23
149	002006	精工科技	3,400	50,014.00	0.23
150	603319	美湖股份	1,500	49,815.00	0.22
151	688717	艾罗能源	600	49,542.00	0.22
152	600619	海立股份	3,100	49,135.00	0.22
153	002048	宁波华翔	2,100	48,300.00	0.22
154	002174	游族网络	3,800	47,918.00	0.22
155	600395	盘江股份	10,300	46,968.00	0.21
156	300568	星源材质	2,500	46,800.00	0.21
157	688691	灿芯股份	400	46,372.00	0.21
158	301345	涛涛车业	200	46,200.00	0.21
159	002338	奥普光电	800	45,760.00	0.21
160	301550	斯菱智驱	500	45,715.00	0.21
161	603108	润达医疗	5,100	45,390.00	0.20
162	601801	皖新传媒	9,100	44,863.00	0.20
163	600888	新疆众和	2,800	44,492.00	0.20
164	605198	安德利	700	44,352.00	0.20
165	600933	爱柯迪	3,000	44,340.00	0.20
166	688368	晶丰明源	200	43,304.00	0.20
167	601777	千里科技	5,300	43,248.00	0.19
168	300776	帝尔激光	200	42,992.00	0.19
169	300034	钢研高纳	2,500	42,850.00	0.19
170	300618	寒锐钴业	1,200	42,840.00	0.19
171	002073	软控股份	8,200	42,148.00	0.19
172	300409	道氏技术	2,100	41,853.00	0.19
173	300348	长亮科技	4,700	41,360.00	0.19
174	300036	超图软件	3,600	40,572.00	0.18
175	600210	紫江企业	6,500	40,300.00	0.18
176	300779	惠城环保	800	40,160.00	0.18
177	603305	旭升集团	3,300	39,996.00	0.18
178	301291	明阳电气	1,100	39,589.00	0.18
179	603619	中曼石油	2,100	39,291.00	0.18
180	688127	蓝特光学	400	39,040.00	0.18
181	688306	均普智能	3,835	38,733.50	0.17
182	600531	豫光金铅	2,600	38,376.00	0.17
183	002913	奥士康	600	38,364.00	0.17
184	002320	海峡股份	6,100	38,247.00	0.17
185	000923	河钢资源	3,000	37,230.00	0.17
186	603355	莱克电气	1,400	36,932.00	0.17
187	300777	中简科技	1,400	36,792.00	0.17
188	301363	美好医疗	2,000	36,660.00	0.17

189	002276	万马股份	3,600	36,396.00	0.16
190	300045	华力创通	2,100	36,204.00	0.16
191	300153	科泰电源	1,600	36,192.00	0.16
192	601137	博威合金	1,600	35,728.00	0.16
193	600323	瀚蓝环境	1,300	35,698.00	0.16
194	301413	安培龙	500	35,440.00	0.16
195	000762	西藏矿业	1,300	34,710.00	0.16
196	301018	申菱环境	300	34,683.00	0.16
197	688062	迈威生物-U	1,200	33,900.00	0.15
198	301500	飞南资源	1,300	33,865.00	0.15
199	600783	鲁信创投	1,700	33,864.00	0.15
200	603950	长源东谷	400	33,772.00	0.15
201	600629	华建集团	2,760	33,423.60	0.15
202	000543	皖能电力	4,400	33,308.00	0.15
203	603826	坤彩科技	1,300	33,228.00	0.15
204	000628	高新发展	700	33,180.00	0.15
205	300593	新雷能	1,100	33,066.00	0.15
206	300253	卫宁健康	4,900	32,977.00	0.15
207	301489	思泉新材	200	32,916.00	0.15
208	000990	诚志股份	4,000	32,720.00	0.15
209	301571	国科天成	500	32,590.00	0.15
210	000035	中国天楹	6,700	32,361.00	0.15
211	002408	齐翔腾达	6,800	31,892.00	0.14
212	002011	盾安环境	3,000	31,830.00	0.14
213	600459	贵研铂业	1,100	31,768.00	0.14
214	688523	航天环宇	600	31,440.00	0.14
215	600645	中源协和	1,800	30,798.00	0.14
216	601375	中原证券	7,700	30,723.00	0.14
217	603127	昭衍新药	800	30,576.00	0.14
218	300580	贝斯特	1,500	30,165.00	0.14
219	002215	诺普信	3,600	29,628.00	0.13
220	603297	永新光学	200	29,390.00	0.13
221	600267	海正药业	2,900	29,319.00	0.13
222	002163	海南发展	3,500	29,190.00	0.13
223	000156	华数传媒	4,600	29,026.00	0.13
224	000902	新洋丰	2,500	28,900.00	0.13
225	300378	鼎捷数智	800	28,880.00	0.13
226	601949	中国出版	6,000	27,900.00	0.13
227	002017	东信和平	1,900	27,797.00	0.13
228	688591	泰凌微	800	27,504.00	0.12
229	301215	中汽股份	5,100	26,469.00	0.12
230	688388	嘉元科技	600	26,400.00	0.12
231	600761	安徽合力	1,600	26,176.00	0.12

232	605196	华通线缆	1,000	26,100.00	0.12
233	601858	中国科传	1,500	25,965.00	0.12
234	600446	金证股份	2,500	25,150.00	0.11
235	688351	微电生理	1,100	24,926.00	0.11
236	600388	龙净环保	1,700	24,735.00	0.11
237	600328	中盐化工	3,800	22,800.00	0.10
238	600640	国脉文化	2,300	22,241.00	0.10
239	002859	洁美科技	200	21,902.00	0.10
240	002182	宝武镁业	1,400	21,798.00	0.10
241	600728	佳都科技	5,000	21,300.00	0.10
242	300747	锐科激光	400	21,236.00	0.10
243	688333	铂力特	200	20,480.00	0.09
244	002537	海联金汇	3,800	20,102.00	0.09
245	688153	唯捷创芯	600	19,272.00	0.09
246	603663	三祥新材	200	19,260.00	0.09
247	600366	宁波韵升	1,300	19,084.00	0.09
248	002755	奥赛康	1,400	19,068.00	0.09
249	688131	皓元医药	200	18,920.00	0.09
250	002246	北化股份	1,000	18,800.00	0.08
251	600151	航天机电	1,600	17,952.00	0.08
252	601311	骆驼股份	2,300	17,917.00	0.08
253	301389	隆扬电子	200	17,358.00	0.08
254	600490	鹏欣资源	2,900	16,878.00	0.08
255	002534	西子洁能	900	16,695.00	0.08
256	603613	国联股份	900	16,578.00	0.07
257	002045	国光电器	2,100	16,485.00	0.07
258	600746	江苏索普	3,100	16,213.00	0.07
259	002840	华统股份	2,100	15,309.00	0.07
260	002020	京新药业	1,200	14,988.00	0.07
261	300113	顺网科技	800	14,568.00	0.07
262	000688	国城矿业	400	13,692.00	0.06
263	603733	仙鹤股份	500	13,505.00	0.06
264	603516	淳中科技	100	13,461.00	0.06
265	000048	京基智农	600	13,254.00	0.06
266	603567	珍宝岛	3,000	13,140.00	0.06
267	603915	国茂股份	900	12,771.00	0.06
268	600986	浙文互联	1,800	12,564.00	0.06
269	688660	电气风电	1,400	12,068.00	0.05
270	000885	城发环境	1,000	12,030.00	0.05
271	000059	华锦股份	3,200	12,000.00	0.05
272	301267	华夏眼科	800	11,672.00	0.05
273	000719	中原传媒	1,000	11,430.00	0.05
274	300598	诚迈科技	400	11,360.00	0.05

275	000690	宝新能源	2,400	11,280.00	0.05
276	300244	迪安诊断	600	11,244.00	0.05
277	600787	中储股份	2,600	10,868.00	0.05
278	688726	拉普拉斯	200	10,570.00	0.05
279	000973	佛塑科技	700	10,045.00	0.05
280	000065	北方国际	1,000	9,830.00	0.04
281	300969	恒帅股份	100	9,376.00	0.04
282	000833	粤桂股份	400	9,368.00	0.04
283	001301	尚太科技	100	9,351.00	0.04
284	300820	英杰电气	100	9,023.00	0.04
285	688584	上海合晶	200	7,190.00	0.03
286	600301	华锡有色	100	6,132.00	0.03
287	301602	超研股份	400	5,496.00	0.02
288	300624	万兴科技	100	5,187.00	0.02
289	002315	焦点科技	180	4,190.40	0.02
290	688165	埃夫特-U	200	4,080.00	0.02
291	605020	永和股份	100	4,072.00	0.02
292	600335	国机汽车	800	3,744.00	0.02
293	000901	航天科技	200	3,558.00	0.02
294	600113	浙江东日	100	3,318.00	0.01
295	301127	武汉天源	100	2,072.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	688343	云天励飞-U	1,900	155,154.00	0.70
2	300720	海川智能	1,500	144,300.00	0.65
3	300331	苏大维格	1,600	113,776.00	0.51
4	301285	鸿日达	900	99,297.00	0.45
5	001979	招商蛇口	14,900	95,807.00	0.43
6	301093	华兰股份	700	94,941.00	0.43
7	301248	杰创智能	1,100	92,323.00	0.42
8	600674	川投能源	6,500	92,105.00	0.41
9	601838	成都银行	5,200	92,040.00	0.41
10	301536	星宸科技	700	90,097.00	0.41
11	688359	三孚新科	400	79,376.00	0.36
12	600595	中孚实业	13,100	73,622.00	0.33
13	002422	科伦药业	1,800	69,336.00	0.31
14	000415	渤海租赁	16,800	68,376.00	0.31
15	601077	渝农商行	11,100	67,821.00	0.31
16	000975	山金国际	3,800	64,600.00	0.29
17	002487	大金重工	1,000	57,970.00	0.26
18	002294	信立泰	1,800	57,402.00	0.26

19	300151	昌红科技	2,300	57,385.00	0.26
20	002937	兴瑞科技	1,300	57,109.00	0.26
21	301070	开勒股份	640	56,320.00	0.25
22	301189	奥尼电子	860	50,679.80	0.23
23	002785	万里石	1,100	48,741.00	0.22
24	301310	鑫宏业	880	48,611.20	0.22
25	300668	杰恩股份	800	47,960.00	0.22
26	000683	博源化工	8,200	47,232.00	0.21
27	600482	中国动力	1,400	45,920.00	0.21
28	300835	龙磁科技	200	45,898.00	0.21
29	002311	海大集团	1,000	44,610.00	0.20
30	601699	潞安环能	3,100	44,268.00	0.20
31	300677	英科医疗	1,100	43,087.00	0.19
32	300755	华致酒行	3,700	42,143.00	0.19
33	002120	韵达股份	6,500	41,340.00	0.19
34	300863	卡倍亿	520	39,847.60	0.18
35	300731	科创新源	680	39,684.80	0.18
36	688628	优利德	400	39,576.00	0.18
37	301317	鑫磊股份	700	39,284.00	0.18
38	000036	华联控股	8,900	38,893.00	0.18
39	300347	泰格医药	800	38,400.00	0.17
40	000708	中信特钢	3,000	37,860.00	0.17
41	600066	宇通客车	1,400	37,534.00	0.17
42	000039	中集集团	4,600	37,306.00	0.17
43	002128	电投能源	1,600	36,992.00	0.17
44	301606	绿联科技	600	36,612.00	0.16
45	300842	帝科股份	400	35,668.00	0.16
46	605318	法狮龙	300	33,858.00	0.15
47	300715	凯伦股份	2,000	32,920.00	0.15
48	002179	中航光电	700	32,340.00	0.15
49	301382	蜂助手	700	32,200.00	0.15
50	000623	吉林敖东	1,800	31,914.00	0.14
51	301307	美利信	400	30,116.00	0.14
52	300079	数码视讯	7,100	29,820.00	0.13
53	605289	罗曼股份	200	29,000.00	0.13
54	000598	兴蓉环境	4,500	28,890.00	0.13
55	000893	亚钾国际	700	28,623.00	0.13
56	688257	新锐股份	280	28,532.00	0.13
57	688786	悦安新材	600	27,648.00	0.12
58	600426	华鲁恒升	1,100	26,312.00	0.12
59	002064	华峰化学	2,500	23,725.00	0.11
60	600985	淮北矿业	1,600	22,480.00	0.10
61	301349	信德新材	300	22,080.00	0.10

62	000983	山西焦煤	3,700	21,460.00	0.10
63	001203	大中矿业	700	20,965.00	0.09
64	300866	安克创新	200	20,900.00	0.09
65	600885	宏发股份	600	20,694.00	0.09
66	688227	品高股份	200	20,538.00	0.09
67	001311	多利科技	1,270	20,485.10	0.09
68	600233	圆通速递	1,300	20,475.00	0.09
69	688677	海泰新光	200	20,226.00	0.09
70	688720	艾森股份	200	20,200.00	0.09
71	601665	齐鲁银行	3,400	19,618.00	0.09
72	600100	同方股份	2,800	19,180.00	0.09
73	002966	苏州银行	2,700	18,792.00	0.08
74	688518	联赢激光	600	18,540.00	0.08
75	002532	天山铝业	1,700	18,241.00	0.08
76	300943	春晖智控	400	17,980.00	0.08
77	300938	信测标准	360	17,956.80	0.08
78	300572	安车检测	600	17,022.00	0.08
79	300022	吉峰科技	2,100	16,317.00	0.07
80	603538	美诺华	500	16,275.00	0.07
81	300232	洲明科技	2,700	15,471.00	0.07
82	688337	普源精电	200	14,986.00	0.07
83	000933	神火股份	700	14,840.00	0.07
84	300959	线上线下	100	14,781.00	0.07
85	000157	中联重科	2,100	14,637.00	0.07
86	300661	圣邦股份	100	14,348.00	0.06
87	300953	震裕科技	100	13,370.00	0.06
88	688485	九州一轨	200	12,812.00	0.06
89	002027	分众传媒	2,600	12,584.00	0.06
90	301021	英诺激光	100	12,190.00	0.05
91	688601	力芯微	200	12,110.00	0.05
92	301312	智立方	100	11,601.00	0.05
93	301387	光大同创	100	9,242.00	0.04
94	688226	威腾电气	200	8,566.00	0.04
95	688135	利扬芯片	200	8,416.00	0.04
96	301165	锐捷网络	100	8,045.00	0.04
97	301228	实朴检测	100	7,816.00	0.04
98	603931	格林达	100	5,940.00	0.03
99	300984	金沃股份	100	5,373.00	0.02
100	002970	锐明技术	100	5,343.00	0.02
101	301517	陕西华达	100	4,963.00	0.02
102	688678	福立旺	200	4,834.00	0.02
103	001212	中旗新材	100	4,738.00	0.02
104	002943	宇晶股份	100	4,423.00	0.02

105	300606	金太阳	100	4,256.00	0.02
-----	--------	-----	-----	----------	------

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	002531	天顺风能	553,262.00	2.81
2	002497	雅化集团	544,371.00	2.76
3	300438	鹏辉能源	543,457.00	2.76
4	002324	普利特	524,277.00	2.66
5	002484	江海股份	504,084.95	2.56
6	002237	恒邦股份	472,381.00	2.40
7	002897	意华股份	468,518.00	2.38
8	300693	盛弘股份	445,106.00	2.26
9	002985	北摩高科	434,571.00	2.21
10	300682	朗新科技	413,160.00	2.10
11	002004	华邦健康	411,722.00	2.09
12	002145	钛能化学	405,720.00	2.06
13	000612	焦作万方	402,615.00	2.04
14	300323	华灿光电	402,253.00	2.04
15	001309	德明利	400,434.00	2.03
16	002396	星网锐捷	386,609.00	1.96
17	002947	恒铭达	379,901.00	1.93
18	002458	益生股份	361,546.00	1.83
19	301316	慧博云通	349,572.00	1.77
20	001979	招商蛇口	346,512.00	1.76

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	688498	源杰科技	1,292,018.00	6.56
2	002484	江海股份	983,852.00	4.99
3	300323	华灿光电	822,817.00	4.18
4	300438	鹏辉能源	774,734.40	3.93
5	002897	意华股份	734,097.00	3.73
6	002985	北摩高科	688,256.00	3.49
7	001309	德明利	679,600.00	3.45
8	002531	天顺风能	651,759.00	3.31
9	002497	雅化集团	627,273.00	3.18
10	002324	普利特	591,300.00	3.00
11	002237	恒邦股份	558,818.00	2.84
12	300693	盛弘股份	530,624.00	2.69
13	300475	香农芯创	529,929.00	2.69

14	002004	华邦健康	526,723.00	2.67
15	300674	宇信科技	482,290.00	2.45
16	002947	恒铭达	478,071.00	2.43
17	000612	焦作万方	478,069.00	2.43
18	002145	钛能化学	474,387.00	2.41
19	300682	朗新科技	465,958.00	2.36
20	601126	四方股份	457,441.00	2.32
21	603005	晶方科技	449,908.00	2.28
22	002396	星网锐捷	441,806.40	2.24
23	300080	易成新能	434,856.00	2.21
24	002458	益生股份	425,241.00	2.16
25	002434	万里扬	405,717.00	2.06

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	54,133,752.62
卖出股票收入（成交）总额	53,604,835.03

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	22,818.58
2	应收清算款	108,502.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	120,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	251,320.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
487	28,151.95	6,240,000.00	45.51	7,470,000.00	54.49

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 9 月 1 日） 基金份额总额	205,710,000.00
本报告期期初基金份额总额	13,710,000.00
本报告期基金总申购份额	33,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	33,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	13,710,000.00

§ 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

针对市场风格轮动提速、波动加剧的运行特征，本基金将动态优化投资策略以适配市场变化：一是适度提升组合整体换手率，灵活捕捉板块轮动中的结构性交易机会，及时完成持仓的动态再平衡，更好地适配市场短期情绪与资金流向的快速切换；二是依托量价数据优化交易决策机制，通过对市场交易结构、资金流向及个股价量信号的持续跟踪，在严格控制组合回撤的前提下，持续挖掘中小盘成长标的的超额收益空间。

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，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
平安证券	1	51,117,882.62	47.45	9,503.53	47.45	—
招商证券	1	30,175,756.67	28.01	5,608.64	28.00	—

东吴证券	1	26,444,948.36	24.55	4,916.48	24.55	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	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 (%)
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰海 通证券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华源证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	《证券日报》、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 12 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	《证券日报》、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 15 日

3	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产品资料概要（更新）	《证券日报》、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 20 日
4	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	《证券日报》、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
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国国际金融股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券日报》、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 25 日
6	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	《证券日报》、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
7	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券日报》、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
8	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变更公告	《证券日报》、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 11 日
9	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产品资料概要（更新）	《证券日报》、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 15 日
10	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（2026 年第 1 号）	《证券日报》、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 15 日
11	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 17 日
12	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 21 日
13	鹏华基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券日报》、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
14	鹏华基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券日报》、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

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	20260114~20260118, 20260121~20260310, 20260313~20260329, 20260420~20260614	766, 510. 00	40, 058, 500. 00	40, 593, 800. 00	231, 210. 00	1. 69
	2	20260101~20260112	4, 313, 700. 00	6, 765, 000. 00	9, 733, 100. 00	1, 345, 600. 00	9. 81
	3	20260119~20260119	388, 690. 00	36, 493, 500. 00	35, 531, 300. 00	1, 350, 890. 00	9. 85
	4	20260101~20260108, 20260629~20260630	2, 813, 700. 00	12, 332, 400. 00	12, 318, 000. 00	2, 828, 100. 00	20. 63
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资份额；

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金在迷你期间如涉及信息披露费、审计费等固定费用的，上述费用由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）《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合同》；
- （二）《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 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