

鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 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：2025 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 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。

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 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	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	11
3.3 其他指标	14
3.4 过去三年基金的利润分配情况	14
§ 4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
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	17
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	19
4.10 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
§ 5 托管人报告	19
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	19
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§ 7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	26
§ 8 投资组合报告	60

8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
8.3 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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
8.6 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	72
8.7 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	72
8.8 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	72
8.9 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	72
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12 投资组合报告附注	73
§ 9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
9.3 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	74
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	75
§ 10 开放式基金份额变动	75
§ 11 重大事件揭示	75
11.1 基金份额持有人大会决议	75
11.2 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	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.8 其他重大事件	78
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	80
12.1 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	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§ 13 备查文件目录	80
13.1 备查文件目录	80
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华新能源汽车混合	
基金主代码	016067	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 7 月 26 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 额总额	2,333,250,315.16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	鹏华新能源汽车混合 A	鹏华新能源汽车混合 C
下属分级基金的交 易代码	016067	016068
报告期末下属分级 基金的份额总额	1,911,112,809.67 份	422,137,505.49 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资新能源汽车主题的上市公司股票，采用积极主动的投资策略，在有效控制投资组合风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 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。 2、股票投资策略 本基金将深度挖掘新能源汽车主题股票的投资机会，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。 （1）新能源汽车主题界定 新能源汽车指的是采用非常规车用燃料作为动力来源（或使用常规车用燃料、采用新型车载动力装置），综合车辆的动力控制和驱动方面的先进技术，形成的技术原理先进、具有新技术、新结构的汽车。本基金界定的新能源汽车主题包括新能源汽车全产业链所涉及的细分领域，重点包括：1）上游基础原材料领域：有色金属行业，包含锂、钴、镍、稀土；相关基础化工行业，包含塑料、磁性材料、硅钢片、特钢；锂电池材料行业，包含正负极材料、电解液、隔膜、铜箔/铝箔、铝塑膜；2）中游新能源汽车

	配件领域：主要包括新能源汽车锂动力电池、锂电池生产设备制造业、电池管理系统及配件、电机及配件、电机控制系统及配件、车载充电机、监测模块、动力总成、车身材料；3）下游消费、服务及应用领域：主要集中在新能源车生产和销售和保养维护、充电设备、车载电子产品、智能驾驶、新能源汽车系统升级、新能源汽车的运营服务。 （2）自上而下的行业遴选 本基金将在考虑当前经济形势和资本市场特征的基础上，结合行业生命周期、宏观经济周期不同阶段的行业景气程度以及股票市场行业轮动规律的基础上，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。同时，本基金将根据宏观经济及证券市场环境的变化，及时对行业配置进行动态调整。 （3）自下而上的个股选择 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，对企业成长性及其基本面进行综合的研判，精选优质个股。 1）定性分析 本基金通过以下两方面标准对股票的成长性及基本面进行研究分析并筛选出优质的公司： 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。 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。 2）定量分析 A、估值水平合理。本基金考察企业贴现现金流以及内在价值贴现，结合市盈率（市值/净利润）、市净率（市值/净资产）、市销率（市值/营业收入）等指标衡量股价是否处于合理的估值区间，并且基于公司所属的不同行业，采取不同的估值方法，以此寻找不同行业股票的合理价格区间，并进行动态调整。 B、成长性较高。本基金采用年复合营业收入增长率、盈利增长率、息税前利润增长率、净资产收益率以及现金流量增长率等指标综合考察上市公司的成长性。一般来说，如果上述指标能够持续保持同步增长，且不低于行业平均水平，则基本可以认为这个企业具有良好的成长性。 C、盈利能力较强。本基金重点考察主营业务收入、ROE、经营现金流、盈利波动程度四大关键指标，关注具备领先优势、盈利质
--	--

	量较高、盈利能力较强的上市公司。 (4) 港股通标的股票投资策略 本基金所投资港股通标的股票除适用上述个股投资策略外，还需关注： 1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司； 2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司； 3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。 3、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 4、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。 5、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果。 6、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。 7、参与融资业务策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。
业绩比较基准	中证新能源汽车指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中债综合财富（总值）指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，可能会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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 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	4006788999	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	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	中国北京东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年		2023 年		2022 年 7 月 26 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日	
	鹏华新能源汽车混合 A	鹏华新能源汽车混合 C	鹏华新能源汽车混合 A	鹏华新能源汽车混合 C	鹏华新能源汽车混合 A	鹏华新能源汽车混合 C
本期已实现收益	- 82,663,478.94	- 26,704,176.65	- 267,882,224.13	- 58,044,902.50	- 526,759,954.70	- 100,818,183.15
本期	- 29,609,129.	- 24,917,809	- 129,086,905	- 33,269,670	- 664,847,988	- 127,697,79

利 润	33	. 36	. 00	. 91	. 25	3. 30
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	-0. 0139	-0. 0488	-0. 0539	-0. 0608	-0. 2536	-0. 2563
本 期 加 权 平 均 净 值 利 润 率	-2. 36%	-8. 39%	-7. 71%	-8. 78%	-29. 34%	-29. 67%
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	0. 44%	-0. 17%	-6. 56%	-7. 10%	-25. 28%	-25. 48%
3. 1 . 2 期 末 数 据 和 指 标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	

期末可供分配利润	- 641,442,873 .18	- 145,578,57 1.16	- 692,616,900 .76	- 192,056,87 0.38	- 644,234,565 .77	- 124,659,35 3.72
期末可供分配基金份额利润	-0.3356	-0.3449	-0.3075	-0.3133	-0.2528	-0.2548
期末基金资产净值	1,340,172,6 85.67	291,733,13 3.23	1,572,466,0 80.56	424,406,72 5.90	1,904,014,3 77.42	364,666,68 3.29
期末基金份额净值	0.7013	0.6911	0.6982	0.6923	0.7472	0.7452
3.1 .3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	

基金份额累计净值增长率	-29.87%	-30.89%	-30.18%	-30.77%	-25.28%	-25.48%
-------------	---------	---------	---------	---------	---------	---------

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 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

（4）本基金合同于 2022 年 07 月 26 日生效，至 2022 年 12 月 31 日未满一年，故 2022 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

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

鹏华新能源汽车混合 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	12.82%	3.02%	-0.73%	2.15%	13.55%	0.87%
过去六个月	33.10%	2.75%	17.31%	1.98%	15.79%	0.77%
过去一年	0.44%	2.71%	3.99%	1.74%	-3.55%	0.97%
自基金合同生效起至今	-29.87%	2.23%	-33.22%	1.44%	3.35%	0.79%

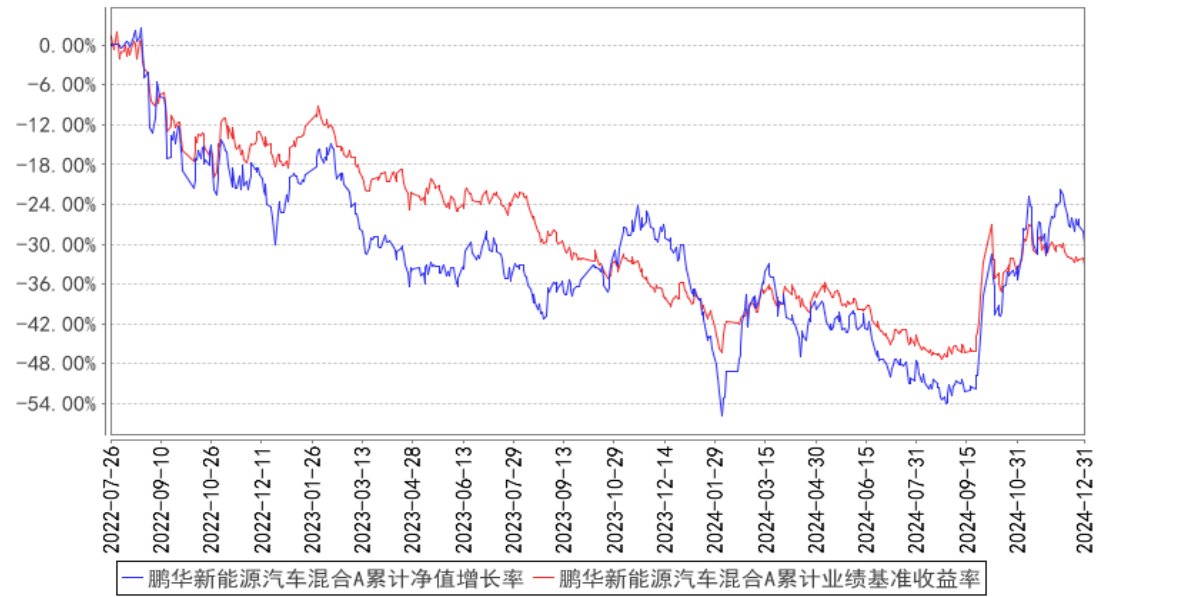
鹏华新能源汽车混合 C

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	12.65%	3.02%	-0.73%	2.15%	13.38%	0.87%
过去六个月	32.70%	2.75%	17.31%	1.98%	15.39%	0.77%
过去一年	-0.17%	2.71%	3.99%	1.74%	-4.16%	0.97%
自基金合同生效 起至今	-30.89%	2.23%	-33.22%	1.44%	2.33%	0.79%

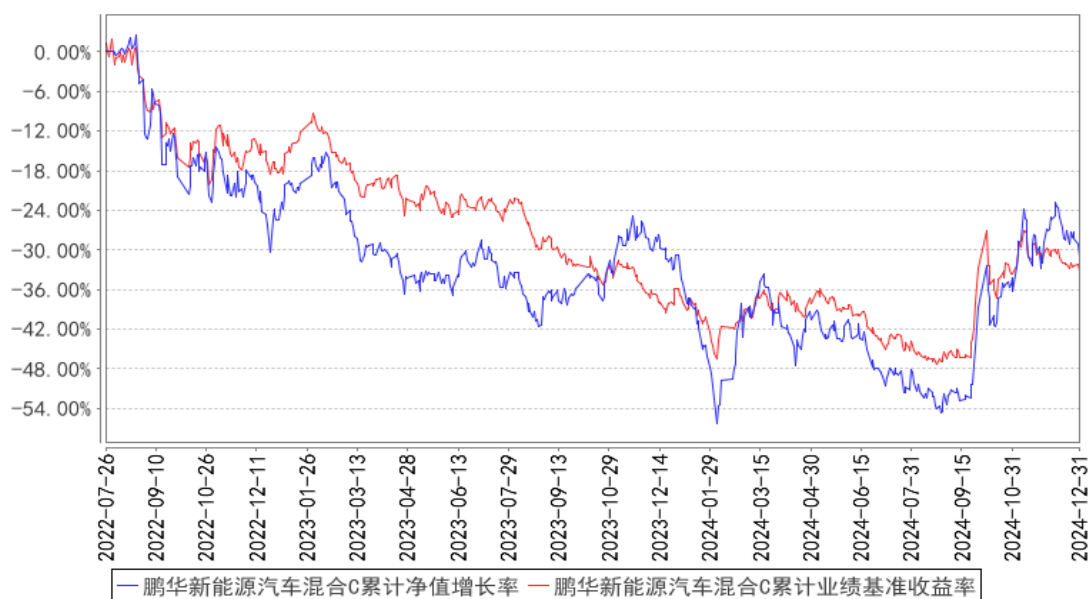
注：业绩比较基准=中证新能源汽车指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）
+中债综合财富（总值）指数收益率×20%。

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

鹏华新能源汽车混合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



鹏华新能源汽车混合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

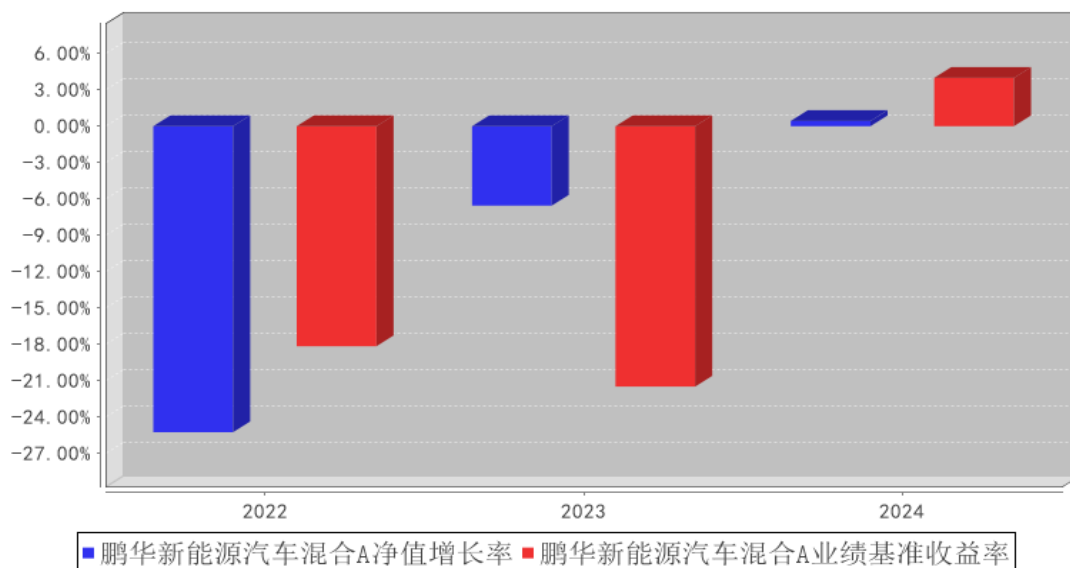


注：1、本基金基金合同于 2022 年 07 月 26 日生效。

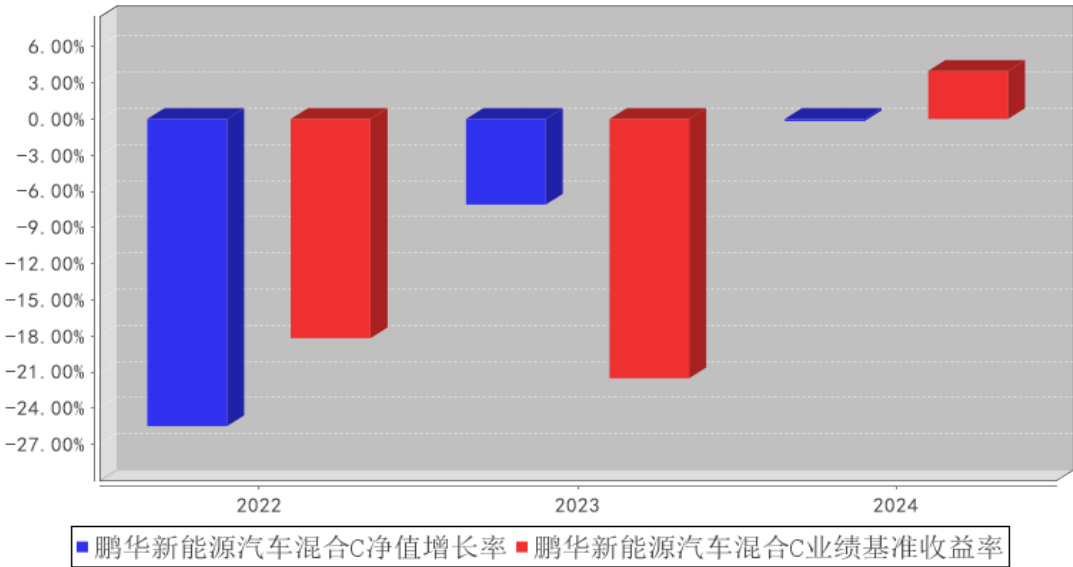
2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华新能源汽车混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



鹏华新能源汽车混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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达到 12,202 亿元，340 只公募基金、14 只全国社保投资组合、8 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、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		
闫思倩	基金经理	2022-07-26	-	14 年	闫思倩女士，国籍中国，工程硕士，14 年证券从业经验。曾任华创证券分析师，中

					银国际证券业务经理，工银瑞信基金研究部基金经理。2022 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任权益投资三部总经理/投资总监/基金经理。2022 年 05 月至今担任鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 07 月至今担任鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金基金经理，2023 年 03 月至今担任鹏华创新未来混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2023 年 05 月至今担任鹏华碳中和主题混合型证券投资基金基金经理，2024 年 08 月至今担任鹏华科技驱动混合型发起式证券投资基金基金经理，闫思倩女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	--

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

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、养老组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资

组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。

在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、风控管理部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生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% 的情况。

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

新能源汽车基金主要投资于新能源锂电、汽车及零部件等行业。过去 3 年新能源汽车行业蓬勃发展，爆款车型频出。2024 年中国一跃成为全球汽车出口第一大国，在全球竞争力进一步凸显。比亚迪、华为、小米等爆款车型大量出现，智能化、无人驾驶等趋势依然在继续。对于新能源汽车上游的锂电产业链，行业经历了产能过剩、行业价格战等压力，股价已经超跌，当前基本面处于见底修复前期，估值也处于历史低位。随着行业产能过剩的改善，贸易冲突政策落地，行业有望迎来触底反弹。上游价格已经接近历史底部，明年的基本面也降迎来改善。国内新能源汽车渗透率仍然有上升空间，而全球新能源汽车渗透率刚达到 20% 左右，未来成长空间依然广阔。无人驾驶发展空间广阔，车企与汽车零部件公司，在新技术、新产品等方向不断布局，打开更多成长空间。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期 A 类份额净值增长率为 0.44%，同期业绩比较基准增长率为 3.99%；C 类份额净值增长率为 -0.17%，同期业绩比较基准增长率为 3.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年我们对宏观经济触底修复保持乐观，财政与流动性充裕，证券市场预计总体表现较好。新能源汽车基金主要投资于新能源锂电、汽车及零部件等行业。我们看好汽车及零部件企业在行业变迁和竞争、以及全球化过程中，新的技术与新的产品、新业务布局频出，不断有带来新的成长点和更广阔的成长空间。同时，看好锂电需求持续超越行业增速的景气机会，随着需求向多行业延展，未来锂电需求展望终局至少还有 5 倍增长空间。锂电需求从消费电子、汽车动力电池扩

展到了储能、机器人、低空经济、终端 AI 等多领域。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求，不断优化现有的标准化业务流程体系，强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率，通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度，并不断优化。

2、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

报告期内，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

3、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内，监察稽核部开展了对信息技术管理、投资相关流程、员工行为、反洗钱业务、子公司管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核，通过稽核发现提高了公司标准化操作流程的执行效率，优化了标准化操作流程手册。报告期内，公司未发生重大风险事件。

4.7 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。

4.8 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，鹏华新能源汽车混合 A 期末可供分配利润为-641,442,873.18 元，期末基金份额净值 0.7013 元，不符合利润分配条件；鹏华新能源汽车混合 C 期末可供分配利润为-145,578,571.16 元，期末基金份额净值 0.6911 元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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 托管人对本年度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 2024 年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2502468 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金全体基金份额持

	有人
审计意见	我们审计了后附的鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金(以下简称“该基金”) 财务报表,包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表,2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》 (以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则 (以下简称“审计准则”) 的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	该基金管理人鹏华基金管理有限公司 (以下简称“该基金管理人”) 管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项 (如适用),并运用持续经营假设,除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报 (包括披露) 、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	叶凯韵	叶云晖
会计师事务所的地址	中国北京市	
审计报告日期	2025 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
资 产:			
货币资金	7.4.7.1	92,188,174.01	126,407,695.13
结算备付金		4,732,159.44	2,317,521.47
存出保证金		457,740.16	395,196.14
交易性金融资产	7.4.7.2	1,541,856,887.09	1,886,261,630.08
其中：股票投资		1,541,856,887.09	1,886,261,630.08
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		7,163,904.95	8,866,181.56
应收股利		-	-
应收申购款		915,157.42	1,647,601.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,647,314,023.07	2,025,895,826.17
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,796,416.47	19,700,858.65
应付赎回款		7,063,794.87	4,922,787.89
应付管理人报酬		1,777,121.16	2,061,887.05
应付托管费		296,186.87	343,647.84
应付销售服务费		158,570.27	213,446.50
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	7.4.7.9	1,316,114.53	1,780,391.78

负债合计		15,408,204.17	29,023,019.71
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	2,333,250,315.16	2,865,159,933.87
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-701,344,496.26	-868,287,127.41
净资产合计		1,631,905,818.90	1,996,872,806.46
负债和净资产总计		1,647,314,023.07	2,025,895,826.17

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额为 2,333,250,315.16 份，其中鹏华新能源汽车混合 A 基金份额总额为 1,911,112,809.67 份，基金份额净值 0.7013 元；鹏华新能源汽车混合 C 基金份额总额为 422,137,505.49 份，基金份额净值 0.6911 元。

7.2 利润表

会计主体：鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-30,887,850.86	-127,115,159.77
1. 利息收入		368,398.68	520,234.28
其中：存款利息收入	7.4.7.13	368,398.68	520,234.28
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）		-87,277,470.42	-291,862,846.44
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-98,269,437.06	-299,906,327.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投 资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	10,991,966.64	8,043,481.30
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)	7.4.7.20	54,840,716.90	163,570,550.72
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.21	1,180,503.98	656,901.67
减：二、营业总支出		23,639,087.83	35,241,416.14
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	18,574,575.54	28,054,062.60
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,095,762.62	4,675,677.04
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,778,845.96	2,271,188.85
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	189,903.71	240,487.65
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-54,526,938.69	-162,356,575.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-54,526,938.69	-162,356,575.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-54,526,938.69	-162,356,575.91

7.3 净资产变动表

会计主体：鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,865,159,933.87	-	-868,287,127.41	1,996,872,806.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	2,865,159,933.87	-	-868,287,127.41	1,996,872,806.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-531,909,618.71	-	166,942,631.15	-364,966,987.56
(一)、综合收益总额	-	-	-54,526,938.69	-54,526,938.69
(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)	-531,909,618.71	-	221,469,569.84	-310,440,048.87
其中：1. 基金申购款	759,190,089.82	-	-291,407,327.27	467,782,762.55
2. 基金赎回款	-1,291,099,708.53	-	512,876,897.11	-778,222,811.42
(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	2,333,250,315.16	-	-701,344,496.26	1,631,905,818.90
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	3,037,574,980.20	-	-768,893,919.49	2,268,681,060.71
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	3,037,574,980.20	-	-768,893,919.49	2,268,681,060.71
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-172,415,046.33	-	-99,393,207.92	-271,808,254.25
(一)、综合收益总额	-	-	-162,356,575.91	-162,356,575.91
(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)	-172,415,046.33	-	62,963,367.99	-109,451,678.34
其中：1. 基金申购款	822,852,187.80	-	237,167,936.82	585,684,250.98
2. 基金赎回款	-995,267,234.13	-	300,131,304.81	-695,135,929.32
(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	2,865,159,933.87	-	-868,287,127.41	1,996,872,806.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华新能源汽车主题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[2022]1184号《关于准予鹏华新能源汽车主题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《鹏华新能源汽车主题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3,159,757,478.83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(2022)第0492号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同》于2022年7月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,160,587,382.60份基金份额,其中认购资金利息折合829,903.77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。

7.4.2 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《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>》、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《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同》和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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年度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2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入

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

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

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

（2）金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类/级别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采

用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》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,暂适用简易计税方法,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、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	92,188,174.01	126,407,695.13
等于：本金	92,178,744.17	126,396,975.69
加：应计利息	9,429.84	10,719.44
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	92,188,174.01	126,407,695.13

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,488,413,263.17	-	1,541,856,887.09	53,443,623.92
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		1,488,413,263.17	-	1,541,856,887.09	53,443,623.92
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,887,658,723.06	-	1,886,261,630.08	-1,397,092.98
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		1,887,658,723.06	-	1,886,261,630.08	-1,397,092.98

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	73.24	736.14
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,146,041.29	1,559,655.64
其中：交易所市场	1,146,041.29	1,559,655.64
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	220,000.00
合计	1,316,114.53	1,780,391.78

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华新能源汽车混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,252,081,744.40	2,252,081,744.40
本期申购	228,656,432.62	228,656,432.62
本期赎回（以“-”号填列）	-569,625,367.35	-569,625,367.35
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	1,911,112,809.67	1,911,112,809.67

鹏华新能源汽车混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	613,078,189.47	613,078,189.47
本期申购	530,533,657.20	530,533,657.20
本期赎回（以“-”号填列）	-721,474,341.18	-721,474,341.18
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	422,137,505.49	422,137,505.49

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

鹏华新能源汽车混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-692,616,900.76	13,001,236.92	-679,615,663.84
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-692,616,900.76	13,001,236.92	-679,615,663.84
本期利润	-82,663,478.94	53,054,349.61	-29,609,129.33
本期基金份额交易产生的变动数	133,837,506.52	4,447,162.65	138,284,669.17
其中：基金申购款	-82,841,989.50	-2,732,821.13	-85,574,810.63
基金赎回款	216,679,496.02	7,179,983.78	223,859,479.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-641,442,873.18	70,502,749.18	-570,940,124.00

鹏华新能源汽车混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-192,056,870.38	3,385,406.81	-188,671,463.57
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-192,056,870.38	3,385,406.81	-188,671,463.57
本期利润	-26,704,176.65	1,786,367.29	-24,917,809.36
本期基金份额交易产生的变动数	73,182,475.87	10,002,424.80	83,184,900.67
其中：基金申购款	-194,314,132.12	-11,518,384.52	-205,832,516.64
基金赎回款	267,496,607.99	21,520,809.32	289,017,417.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-145,578,571.16	15,174,198.90	-130,404,372.26

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	332,773.44	427,847.57

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	31,145.45	81,001.03
其他	4,479.79	11,385.68
合计	368,398.68	520,234.28

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。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-98,269,437.06	-299,906,327.74
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	-98,269,437.06	-299,906,327.74

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	3,209,012,594.11	6,552,833,884.41
减：卖出股票成本 总额	3,301,682,589.08	6,833,639,477.63
减：交易费用	5,599,442.09	19,100,734.52
买卖股票差价收入	-98,269,437.06	-299,906,327.74

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	10,991,966.64	8,043,481.30
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	10,991,966.64	8,043,481.30

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	54,840,716.90	163,570,550.72
股票投资	54,840,716.90	163,570,550.72
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	54,840,716.90	163,570,550.72

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,099,352.29	635,069.22
基金转换费收入	81,151.69	21,832.45
合计	1,180,503.98	656,901.67

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	1,432.90	1,435.32
账户维护费	18,000.00	18,000.00
证券组合费	470.81	1,052.33
合计	189,903.71	240,487.65

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司（“Eurizon Capital SGR S.p.A.”）	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司（“鹏华资产”）	基金管理人的子公司

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	950,153,604.42	15.63	6,214,115,463.04	48.09

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31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	631,135.06	17.74	177,907.29	15.52
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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	5,754,305.25	48.12	533,116.25	34.18

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,574,575.54	28,054,062.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,915,680.77	8,960,814.89
应支付基金管理人的净管理费	12,658,894.77	19,093,247.71

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 1.20%，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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,095,762.62	4,675,677.04

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。

7.4.10.2.3 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华新能源汽车混合 A	鹏华新能源汽车混合 C	合计
国信证券	-	134,322.45	134,322.45
鹏华基金公司	-	43,013.83	43,013.83
中国工商银行	-	226,658.97	226,658.97
合计	-	403,995.25	403,995.25
	上年度可比期间		

获得销售服务费的各关联方名称	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华新能源汽车混合 A	鹏华新能源汽车混合 C	合计
国信证券	-	202,594.77	202,594.77
鹏华基金公司	-	72,496.89	72,496.89
中国工商银行	-	186,190.51	186,190.51
合计	-	461,282.17	461,282.17

注：鹏华新能源汽车混合 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华新能源汽车混合 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.6%，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×0.6%÷当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	92,188,174.01	332,773.44	126,407,695.13	427,847.57

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国信证券	603207	小方制药	网下申购	1,848	23,044.56
国信证券	603325	博隆技术	网下申购	660	47,823.60
国信证券	301585	蓝宇股份	网下申购	2,092	50,103.40
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	2,618	104,144.04
国信证券	603270	金帝股份	网下申购	1,943	42,299.11
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	688562	航天软件	网下申购	7,254	91,980.72

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001279	强邦新材	2024 年 9 月 27 日	6 个月	新股流通受限	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301522	上	2024	6 个月	新股	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-

	大股份	年 10 月 9 日		流通受限						
301551	无线传媒	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股流通受限	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
301552	科力装备	2024 年 7 月 15 日	6 个月	新股流通受限	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普云农	2024 年 10 月 10 日	6 个月	新股流通受限	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天成	2024 年 8 月 14 日	6 个月	新股流通受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	新股流通受限	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024 年 8 月 21 日	6 个月	新股流通受限	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024 年 7 月 3 日	6 个月	新股流通受限	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科技	2024 年 7 月 17 日	6 个月	新股流通受限	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301607	富特科技	2024 年 8 月 28 日	6 个月	新股流通受限	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	新股流通受限	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301611	珂	2024	6 个月	新股	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-

	玛科技	年 8 月 7 日		流通受限						
301613	新铝时代	2024 年 10 月 18 日	6 个月	新股流通受限	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301617	博苑股份	2024 年 12 月 3 日	6 个月	新股流通受限	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301622	英思特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	新股流通受限	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301626	苏州天脉	2024 年 10 月 17 日	6 个月	新股流通受限	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
301631	壹连科技	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股流通受限	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	1 个月内 (含)	新股未上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603194	中力股份	2024 年 12 月 17 日	6 个月	新股流通受限	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
603205	健尔康	2024 年 10 月 29 日	6 个月	新股流通受限	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603207	小方制药	2024 年 8 月 19 日	6 个月	新股流通受限	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键	2024	6 个月	新股	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-

	邦股份	年 6 月 28 日		流通受限						
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股流通受限	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	6 个月	新股流通受限	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
603395	红四方	2024 年 11 月 19 日	6 个月	新股流通受限	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新股流通受限	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	6 个月	新股流通受限	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688615	合合信息	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股流通受限	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	6 个月	新股流通受限	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688710	益诺思	2024 年 8 月 27 日	6 个月	新股流通受限	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙图光罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股流通受限	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688726	拉	2024	6 个月	新股	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-

	普 拉 斯	年 10 月 22 日		流通 受限						
688750	金 天 钛 业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-

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

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括境内依法发行或上市交易的股票（包含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、同业

存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

7.4.13.2 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。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2023 年 12 月 31 日：未持有）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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、组合在短期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 2024 年 12 月 31 日，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合

约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	92,188,174.01	-	-	-	92,188,174.01
结算备付金	4,732,159.44	-	-	-	4,732,159.44
存出保证金	457,740.16	-	-	-	457,740.16
交易性金融资产	-	-	-	1,541,856,887.09	1,541,856,887.09
应收申购款	-	-	-	915,157.42	915,157.42
应收清算款	-	-	-	7,163,904.95	7,163,904.95
资产总计	97,378,073.61	-	-	1,549,935,949.46	1,647,314,023.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,063,794.87	7,063,794.87
应付管理人报酬	-	-	-	1,777,121.16	1,777,121.16
应付托管费	-	-	-	296,186.87	296,186.87
应付清算款	-	-	-	4,796,416.47	4,796,416.47
应付销售服务费	-	-	-	158,570.27	158,570.27
其他负债	-	-	-	1,316,114.53	1,316,114.53
负债总计	-	-	-	15,408,204.17	15,408,204.17
利率敏感度缺口	97,378,073.61	-	-	1,534,527,745.29	1,631,905,818.90
上年度末 2023 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	126,407,695.13	-	-	-	126,407,695.13
结算备付金	2,317,521.47	-	-	-	2,317,521.47
存出保证金	395,196.14	-	-	-	395,196.14
交易性金融资产	-	-	-	1,886,261,630.08	1,886,261,630.08
应收申购款	-	-	-	1,647,601.79	1,647,601.79

应收清算款	-	-	-	8,866,181.56	8,866,181.56
资产总计	129,120,412.74	-	-	1,896,775,413.43	2,025,895,826.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,922,787.89	4,922,787.89
应付管理人报酬	-	-	-	2,061,887.05	2,061,887.05
应付托管费	-	-	-	343,647.84	343,647.84
应付清算款	-	-	-	19,700,858.65	19,700,858.65
应付销售服务费	-	-	-	213,446.50	213,446.50
其他负债	-	-	-	1,780,391.78	1,780,391.78
负债总计	-	-	-	29,023,019.71	29,023,019.71
利率敏感度缺口	129,120,412.74	-	-	1,867,752,393.72	1,996,872,806.46

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 12 月 31 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。

7.4.13.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	277,328.14	-	277,328.14
资产合计	-	277,328.14	-	277,328.14
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	277,328.14	-	277,328.14

项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	9,361,592.43	-	9,361,592.43
资产合计	-	9,361,592.43	-	9,361,592.43
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	9,361,592.43	-	9,361,592.43

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	13,866.41	468,079.62
	所有外币相对人民币贬值 5%	-13,866.41	-468,079.62

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券投资品种，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 60%-95%(其中，投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%)，投资于本基金界定的新能源汽车主题相关股票不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	1,541,856,887.09	94.48	1,886,261,630.08	94.46
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	1,541,856,887.09	94.48	1,886,261,630.08	94.46

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31	上年度末（2023 年 12 月

		日)	31 日)
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	110,684,012.17	107,920,990.83
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-110,684,012.17	-107,920,990.83

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	1,541,189,361.15	1,883,237,743.06
第二层次	27,736.50	1,758,328.00
第三层次	639,789.44	1,265,559.02
合计	1,541,856,887.09	1,886,261,630.08

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,265,559.02	1,265,559.02
当期购买	-	29,999,956.44	29,999,956.44
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	440,216.09	440,216.09
转出第三层次	-	27,427,452.70	27,427,452.70
当期利得或损失总额	-	-3,638,489.41	-3,638,489.41
其中：计入损益的利得或损失	-	-3,638,489.41	-3,638,489.41
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	639,789.44	639,789.44
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	381,559.35	381,559.35
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	12,242,197.16	12,242,197.16
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,399,735.53	2,399,735.53
转出第三层次	-	12,647,966.31	12,647,966.31
当期利得或损失总额	-	-728,407.36	-728,407.36
其中：计入损益的利得或损失	-	-728,407.36	-728,407.36
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,265,559.02	1,265,559.02

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	173,431.36	173,431.36
--	---	------------	------------

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	639,789.44	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	26.65%-574.44%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	1,265,559.02	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	18.55%-219.88%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,541,856,887.09	93.60
	其中：股票	1,541,856,887.09	93.60
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	96,920,333.45	5.88
8	其他各项资产	8,536,802.53	0.52
9	合计	1,647,314,023.07	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 277,328.14 元，占净值比 0.02%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	-	-
B	采矿业	2,860,301.60	0.18
C	制造业	1,518,346,295.65	93.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	367,537.92	0.02
E	建筑业	304,331.04	0.02
F	批发和零售业	1,141,582.08	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	566,908.74	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,935,987.07	0.30
J	金融业	2,946,427.44	0.18
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	26,183.64	0.00
M	科学研究和技术服务业	960,364.93	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	303,972.84	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	474,098.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	8,345,568.00	0.51
	合计	1,541,579,558.95	94.46

8.2.2 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	-	-

原材料	-	-
工业	277,328.14	0.02
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
通信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	277,328.14	0.02

注：以上分类采用国际通用行业分类标准。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300432	富临精工	5,684,200	87,422,996.00	5.36
2	601689	拓普集团	1,729,257	84,733,593.00	5.19
3	300100	双林股份	2,809,600	77,657,344.00	4.76
4	301358	湖南裕能	1,498,286	67,902,321.52	4.16
5	002709	天赐材料	3,072,342	60,586,584.24	3.71
6	603009	北特科技	1,478,130	57,765,320.40	3.54
7	603667	五洲新春	2,297,459	56,862,110.25	3.48
8	688116	天奈科技	1,336,247	51,859,746.07	3.18
9	001301	尚太科技	658,200	45,119,610.00	2.76
10	832522	纳科诺尔	667,230	33,708,459.60	2.07
11	002738	中矿资源	874,180	31,033,390.00	1.90
12	688326	经纬恒润-W	364,301	30,637,714.10	1.88
13	603659	璞泰来	1,782,650	28,361,961.50	1.74
14	688017	绿的谐波	256,770	27,746,566.20	1.70
15	002896	中大力德	713,300	27,397,853.00	1.68
16	300390	天华新能	1,075,860	24,798,573.00	1.52
17	002756	永兴材料	625,047	23,576,772.84	1.44
18	002466	天齐锂业	701,100	23,136,300.00	1.42
19	002850	科达利	229,900	22,456,632.00	1.38
20	603728	鸣志电器	412,590	22,279,860.00	1.37
21	300014	亿纬锂能	460,200	21,509,748.00	1.32
22	002497	雅化集团	1,828,400	21,392,280.00	1.31
23	301000	肇民科技	801,707	20,371,374.87	1.25
24	688160	步科股份	344,501	19,760,577.36	1.21
25	301550	斯菱股份	261,520	19,036,040.80	1.17
26	300580	贝斯特	775,975	17,808,626.25	1.09

27	688320	禾川科技	448,789	17,457,892.10	1.07
28	300450	先导智能	847,800	16,972,956.00	1.04
29	300568	星源材质	1,715,900	16,678,548.00	1.02
30	002460	赣锋锂业	454,520	15,912,745.20	0.98
31	600563	法拉电子	128,900	15,328,788.00	0.94
32	600418	江淮汽车	400,953	15,035,737.50	0.92
33	688577	浙海德曼	380,425	14,905,051.50	0.91
34	300969	恒帅股份	180,548	14,745,355.16	0.90
35	601238	广汽集团	1,497,700	13,988,518.00	0.86
36	603809	豪能股份	1,158,154	13,469,331.02	0.83
37	300035	中科电气	871,800	13,033,410.00	0.80
38	300073	当升科技	317,600	12,792,928.00	0.78
39	688005	容百科技	394,282	12,439,597.10	0.76
40	002407	多氟多	1,014,740	12,176,880.00	0.75
41	002126	银轮股份	648,800	12,145,536.00	0.74
42	603026	石大胜华	329,600	11,536,000.00	0.71
43	301413	安培龙	215,262	11,518,669.62	0.71
44	300953	震裕科技	163,200	11,365,248.00	0.70
45	835185	贝特瑞	565,223	11,084,023.03	0.68
46	600212	绿能慧充	1,457,500	11,018,700.00	0.68
47	600686	金龙汽车	763,100	10,729,186.00	0.66
48	002779	中坚科技	153,200	10,417,600.00	0.64
49	002384	东山精密	354,900	10,363,080.00	0.64
50	300680	隆盛科技	402,200	9,636,712.00	0.59
51	688779	五矿新能	1,716,733	9,133,019.56	0.56
52	688778	厦钨新能	199,660	9,112,482.40	0.56
53	300769	德方纳米	241,200	8,895,456.00	0.55
54	600673	东阳光	739,200	8,345,568.00	0.51
55	301368	丰立智能	170,268	7,857,868.20	0.48
56	688275	万润新能	144,878	7,001,953.74	0.43
57	600549	厦门钨业	362,800	6,991,156.00	0.43
58	603305	旭升集团	507,300	6,670,995.00	0.41
59	002812	恩捷股份	207,339	6,632,774.61	0.41
60	600609	金杯汽车	872,500	6,282,000.00	0.38
61	300919	中伟股份	170,100	6,144,012.00	0.38
62	603119	浙江荣泰	254,359	5,695,098.01	0.35
63	600699	均胜电子	337,300	5,285,491.00	0.32
64	600933	爱柯迪	309,700	5,048,110.00	0.31
65	605088	冠盛股份	195,700	4,908,156.00	0.30
66	605333	沪光股份	148,500	4,845,555.00	0.30
67	002920	德赛西威	42,661	4,697,402.71	0.29
68	301511	德福科技	359,938	4,520,821.28	0.28
69	300037	新宙邦	116,800	4,372,992.00	0.27

70	003021	兆威机电	57,700	4,264,607.00	0.26
71	300457	赢合科技	214,100	4,097,874.00	0.25
72	300438	鹏辉能源	122,500	3,443,475.00	0.21
73	301325	曼恩斯特	59,200	3,208,048.00	0.20
74	000009	中国宝安	312,800	2,862,120.00	0.18
75	300491	通合科技	179,700	2,860,824.00	0.18
76	002240	盛新锂能	206,200	2,841,436.00	0.17
77	603799	华友钴业	95,900	2,806,034.00	0.17
78	301238	瑞泰新材	178,700	2,798,442.00	0.17
79	301219	腾远钴业	61,700	2,789,457.00	0.17
80	002192	融捷股份	87,100	2,778,490.00	0.17
81	300694	蠡湖股份	170,900	2,725,855.00	0.17
82	600884	杉杉股份	340,100	2,533,745.00	0.16
83	603348	文灿股份	100,900	2,387,294.00	0.15
84	688170	德龙激光	93,770	2,108,887.30	0.13
85	603917	合力科技	163,900	1,925,825.00	0.12
86	000657	中钨高新	207,350	1,909,693.50	0.12
87	688716	中研股份	50,897	1,850,105.95	0.11
88	688249	晶合集成	74,041	1,728,116.94	0.11
89	605305	中际联合	57,540	1,630,108.20	0.10
90	688048	长光华芯	40,583	1,582,331.17	0.10
91	301487	盟固利	68,362	1,454,059.74	0.09
92	300343	联创股份	238,700	1,377,299.00	0.08
93	688533	上声电子	38,442	1,338,550.44	0.08
94	603556	海兴电力	33,900	1,253,961.00	0.08
95	002527	新时达	110,600	971,068.00	0.06
96	603063	禾望电气	45,300	904,188.00	0.06
97	688172	燕东微	40,177	805,548.85	0.05
98	002139	拓邦股份	48,900	665,529.00	0.04
99	002870	香山股份	20,500	641,650.00	0.04
100	688692	达梦数据	1,745	635,947.80	0.04
101	688443	智翔金泰-U	22,616	567,435.44	0.03
102	688449	联芸科技	14,052	557,728.82	0.03
103	688605	先锋精科	7,433	554,188.24	0.03
104	688563	航材股份	9,659	539,358.56	0.03
105	603296	华勤技术	7,577	537,588.15	0.03
106	301291	明阳电气	12,054	529,411.68	0.03
107	301611	珂玛科技	8,039	471,680.00	0.03
108	688708	佳驰科技	7,794	468,139.20	0.03
109	688702	盛科通信-U	5,488	460,992.00	0.03
110	301297	富乐德	10,147	431,247.50	0.03
111	688726	拉普拉斯	9,785	428,635.74	0.03
112	301301	川宁生物	35,740	423,876.40	0.03

113	001391	国货航	46,851	420,204.45	0.03
114	688548	广钢气体	40,476	407,593.32	0.02
115	301536	星宸科技	4,809	384,239.10	0.02
116	688549	中巨芯-U	42,933	365,789.16	0.02
117	301526	国际复材	97,225	359,732.50	0.02
118	301551	无线传媒	6,516	356,687.24	0.02
119	001286	陕西能源	37,667	349,549.76	0.02
120	688750	金天钛业	16,845	346,802.00	0.02
121	688522	纳睿雷达	6,019	339,110.46	0.02
122	688709	成都华微	10,448	322,634.24	0.02
123	688141	杰华特	9,946	304,447.06	0.02
124	688502	茂莱光学	1,509	303,912.60	0.02
125	688146	中船特气	10,101	293,333.04	0.02
126	688631	莱斯信息	3,357	292,361.13	0.02
127	601061	中信金属	40,154	291,518.04	0.02
128	301522	上大股份	8,151	287,996.94	0.02
129	301267	华夏眼科	15,078	287,085.12	0.02
130	688352	顾中科技	23,609	286,377.17	0.02
131	688525	佰维存储	4,614	285,929.58	0.02
132	001287	中电港	13,860	281,496.60	0.02
133	09880	优必选	5,450	277,328.14	0.02
134	301626	苏州天脉	3,190	271,826.28	0.02
135	688362	甬矽电子	7,779	261,996.72	0.02
136	688114	华大智造	5,336	249,671.44	0.02
137	688543	国科军工	4,913	246,239.56	0.02
138	688531	日联科技	5,017	238,959.71	0.01
139	688629	华丰科技	7,073	236,874.77	0.01
140	301486	致尚科技	4,820	230,637.00	0.01
141	301303	真兰仪表	14,804	226,797.28	0.01
142	688432	有研硅	20,044	226,497.20	0.01
143	301556	托普云农	2,663	222,828.67	0.01
144	688486	龙迅股份	2,793	217,965.72	0.01
145	688591	泰凌微	6,806	213,708.40	0.01
146	301371	敷尔佳	5,637	213,022.23	0.01
147	300712	永福股份	8,700	209,409.00	0.01
148	688652	京仪装备	4,157	204,108.70	0.01
149	301559	中集环科	13,144	201,760.40	0.01
150	301367	怡和嘉业	3,121	196,623.00	0.01
151	301631	壹连科技	1,525	196,429.48	0.01
152	688539	高华科技	7,468	189,761.88	0.01
153	688691	灿芯股份	2,461	189,497.00	0.01
154	301293	三博脑科	4,321	187,012.88	0.01
155	301622	英思特	3,056	185,015.52	0.01

156	688035	德邦科技	4,981	183,051.75	0.01
157	300904	威力传动	3,037	182,736.29	0.01
158	601033	永兴股份	12,577	181,863.42	0.01
159	301421	波长光电	3,315	177,916.05	0.01
160	688507	索辰科技	3,231	176,735.70	0.01
161	688593	新相微	9,584	175,387.20	0.01
162	301345	涛涛车业	2,652	175,297.20	0.01
163	301262	海看股份	6,917	172,025.79	0.01
164	601096	宏盛华源	39,171	170,393.85	0.01
165	688570	天玛智控	8,837	169,758.77	0.01
166	688584	上海合晶	8,659	169,370.04	0.01
167	688147	微导纳米	6,293	169,218.77	0.01
168	688721	龙图光罩	2,786	163,874.43	0.01
169	301377	鼎泰高科	7,695	162,749.25	0.01
170	688603	天承科技	1,391	162,051.50	0.01
171	688627	精智达	2,212	161,276.92	0.01
172	301348	蓝箭电子	6,124	156,896.88	0.01
173	688392	骄成超声	3,843	156,794.40	0.01
174	301613	新铝时代	2,756	154,500.52	0.01
175	301315	威士顿	2,253	153,857.37	0.01
176	301361	众智科技	5,169	153,054.09	0.01
177	301565	中仑新材	7,103	152,004.20	0.01
178	301311	昆船智能	8,320	150,508.80	0.01
179	301606	绿联科技	3,959	149,131.44	0.01
180	301571	国科天成	3,499	148,154.49	0.01
181	688334	西高院	8,879	144,994.07	0.01
182	301488	豪恩汽电	2,618	144,749.22	0.01
183	301202	朗威股份	3,060	142,871.40	0.01
184	301508	中机认检	4,186	142,324.00	0.01
185	301382	蜂助手	5,304	140,662.08	0.01
186	603341	龙旗科技	2,978	139,221.50	0.01
187	301317	鑫磊股份	6,936	137,957.04	0.01
188	688581	安杰思	2,281	136,152.89	0.01
189	301392	汇成真空	2,189	135,192.64	0.01
190	301370	国科恒泰	12,395	133,866.00	0.01
191	301141	中科磁业	3,664	133,003.20	0.01
192	301439	泓淋电力	9,486	130,432.50	0.01
193	301381	赛维时代	5,710	129,959.60	0.01
194	301558	三态股份	14,578	127,703.28	0.01
195	301277	新天地	9,205	127,305.15	0.01
196	301617	博苑股份	2,524	126,387.49	0.01
197	301608	博实结	1,835	124,925.30	0.01
198	301586	佳力奇	2,146	121,704.51	0.01

199	601083	锦江航运	12,630	120,237.60	0.01
200	301322	绿通科技	5,467	120,164.66	0.01
201	688535	华海诚科	1,607	119,480.45	0.01
202	301172	君逸数码	4,376	117,451.84	0.01
203	688710	益诺思	3,320	117,252.44	0.01
204	301580	爱迪特	2,018	117,245.80	0.01
205	301399	英特科技	4,241	116,754.73	0.01
206	301516	中远通	6,033	116,436.90	0.01
207	688562	航天软件	7,254	115,411.14	0.01
208	301538	骏鼎达	1,491	114,911.37	0.01
209	688478	晶升股份	4,013	113,206.73	0.01
210	301332	德尔玛	11,211	112,334.22	0.01
211	301251	威尔高	3,207	111,892.23	0.01
212	001389	广合科技	2,219	111,615.70	0.01
213	301507	民生健康	8,509	107,979.21	0.01
214	688084	晶品特装	1,875	105,562.50	0.01
215	001279	强邦新材	2,642	105,138.39	0.01
216	301393	昊帆生物	2,597	103,646.27	0.01
217	688496	清越科技	12,000	102,840.00	0.01
218	688620	安凯微	10,157	102,077.85	0.01
219	688489	三未信安	2,953	101,878.50	0.01
220	603194	中力股份	2,904	101,705.10	0.01
221	688458	美芯晟	3,088	101,132.00	0.01
222	301281	科源制药	3,366	100,677.06	0.01
223	301517	陕西华达	1,841	99,469.23	0.01
224	301419	阿莱德	3,292	99,385.48	0.01
225	688612	威迈斯	4,218	99,291.72	0.01
226	301603	乔锋智能	2,326	99,194.30	0.01
227	688433	华曙高科	4,171	97,351.14	0.01
228	301607	富特科技	2,567	96,906.28	0.01
229	301408	华人健康	8,784	96,887.52	0.01
230	301329	信音电子	4,577	96,345.85	0.01
231	301320	豪江智能	6,416	95,662.56	0.01
232	301585	蓝宇股份	2,092	95,304.98	0.01
233	301566	达利凯普	5,755	94,612.20	0.01
234	688419	耐科装备	3,039	94,452.12	0.01
235	688523	航天环宇	4,717	94,340.00	0.01
236	603121	华培动力	8,400	92,652.00	0.01
237	688152	麒麟信安	1,772	92,214.88	0.01
238	301456	盘古智能	4,061	91,737.99	0.01
239	301323	新莱福	2,277	90,783.99	0.01
240	688391	钜泉科技	2,938	89,168.30	0.01
241	301428	世纪恒通	2,289	88,698.75	0.01

242	301357	北方长龙	2,660	88,418.40	0.01
243	301489	思泉新材	1,278	87,210.72	0.01
244	301548	崇德科技	1,959	85,255.68	0.01
245	601059	信达证券	5,628	84,307.44	0.01
246	301459	丰茂股份	2,077	84,139.27	0.01
247	301591	肯特股份	2,184	83,625.36	0.01
248	301568	思泰克	2,456	83,504.00	0.01
249	301552	科力装备	1,423	83,191.61	0.01
250	688435	英方软件	2,728	82,331.04	0.01
251	688653	康希通信	6,478	82,270.60	0.01
252	301500	飞南资源	4,550	81,900.00	0.01
253	301376	致欧科技	4,192	80,151.04	0.00
254	301386	未来电器	3,776	79,635.84	0.00
255	603395	红四方	1,531	77,966.32	0.00
256	603135	中重科技	8,782	77,808.52	0.00
257	688719	爱科赛博	2,714	76,806.20	0.00
258	601065	江盐集团	8,748	76,719.96	0.00
259	301290	东星医疗	3,291	76,482.84	0.00
260	301292	海科新源	5,824	76,177.92	0.00
261	301578	辰奕智能	1,527	74,593.95	0.00
262	601133	柏诚股份	6,632	74,411.04	0.00
263	301355	南王科技	5,624	74,349.28	0.00
264	688646	逸飞激光	2,190	73,824.90	0.00
265	688602	康鹏科技	10,653	73,612.23	0.00
266	301265	华新环保	8,181	73,301.76	0.00
267	301359	东南电子	3,271	73,204.98	0.00
268	301360	荣旗科技	1,340	71,904.40	0.00
269	301587	中瑞股份	3,056	71,816.00	0.00
270	603193	润本股份	3,022	70,563.70	0.00
271	688648	中邮科技	3,025	70,452.25	0.00
272	301373	凌玮科技	2,764	70,150.32	0.00
273	301337	亚华电子	2,318	67,453.80	0.00
274	301157	华塑科技	1,498	67,410.00	0.00
275	301388	欣灵电气	2,920	67,130.80	0.00
276	301539	宏鑫科技	3,607	66,765.57	0.00
277	301533	威马农机	2,243	66,168.50	0.00
278	688720	艾森股份	1,644	65,036.64	0.00
279	688530	欧莱新材	3,437	63,653.24	0.00
280	301418	协昌科技	1,886	62,898.10	0.00
281	688651	盛邦安全	1,778	62,887.86	0.00
282	301295	美硕科技	3,004	62,783.60	0.00
283	688480	赛恩斯	2,302	62,476.28	0.00
284	688693	锆威特	1,773	62,303.22	0.00

285	301518	长华化学	3,850	61,869.50	0.00
286	301520	万邦医药	1,596	61,446.00	0.00
287	301272	英华特	1,729	59,667.79	0.00
288	301519	舜禹股份	4,414	59,633.14	0.00
289	301502	华阳智能	1,375	59,262.50	0.00
290	688307	中润光学	2,455	58,920.00	0.00
291	688479	友车科技	3,318	58,894.50	0.00
292	688429	时创能源	3,452	58,856.60	0.00
293	301528	多浦乐	1,478	57,642.00	0.00
294	301170	锡南科技	2,496	57,208.32	0.00
295	688695	中创股份	1,856	56,440.96	0.00
296	688143	长盈通	2,519	55,468.38	0.00
297	301555	惠柏新材	2,235	52,455.45	0.00
298	301529	福赛科技	1,816	52,228.16	0.00
299	603325	博隆技术	660	52,212.60	0.00
300	301588	美新科技	2,568	51,976.32	0.00
301	603207	小方制药	1,848	51,643.92	0.00
302	603107	上海汽配	2,920	48,880.80	0.00
303	001379	腾达科技	2,128	48,624.80	0.00
304	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
305	301505	苏州规划	1,934	47,731.12	0.00
306	603205	健尔康	1,278	47,522.80	0.00
307	001359	平安电工	1,833	47,493.03	0.00
308	600925	苏能股份	8,960	47,488.00	0.00
309	001378	德冠新材	2,044	46,848.48	0.00
310	603310	巍华新材	2,538	46,699.10	0.00
311	001328	登康口腔	1,445	45,893.20	0.00
312	603062	麦加芯彩	1,258	45,275.42	0.00
313	603125	常青科技	2,314	44,428.80	0.00
314	603344	星德胜	1,813	44,291.59	0.00
315	301498	乖宝宠物	554	43,389.28	0.00
316	603312	西典新能	1,296	41,834.88	0.00
317	603391	力聚热能	991	41,637.19	0.00
318	301515	港通医疗	2,294	41,246.12	0.00
319	603004	鼎龙科技	1,948	40,148.28	0.00
320	603381	永臻股份	1,778	38,973.76	0.00
321	603350	安乃达	1,051	38,326.52	0.00
322	603270	金帝股份	1,943	37,888.50	0.00
323	603082	北自科技	1,070	36,273.00	0.00
324	001306	夏厦精密	631	35,462.20	0.00
325	603075	热威股份	1,812	33,757.56	0.00
326	001326	联域股份	986	33,307.08	0.00
327	001282	三联锻造	1,463	30,723.00	0.00

328	603281	江瀚新材	1,208	29,475.20	0.00
329	603285	键邦股份	1,287	29,319.09	0.00
330	603273	天元智能	1,772	29,273.44	0.00
331	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
332	001239	永达股份	1,887	27,682.29	0.00
333	001358	兴欣新材	1,214	27,047.92	0.00
334	603375	盛景微	714	26,696.46	0.00
335	603231	索宝蛋白	1,610	26,355.70	0.00
336	001314	亿道信息	508	26,339.80	0.00
337	603373	安邦护卫	876	26,183.64	0.00
338	001387	雪祺电气	1,729	23,981.23	0.00
339	603276	恒兴新材	1,737	23,692.68	0.00
340	001367	海森药业	813	22,146.12	0.00
341	001311	多利科技	844	21,766.76	0.00
342	603137	恒尚节能	1,935	20,511.00	0.00
343	001324	长青科技	1,131	19,362.72	0.00
344	001338	永顺泰	1,649	17,941.12	0.00
345	601121	宝地矿业	2,532	17,724.00	0.00
346	001337	四川黄金	795	16,599.60	0.00
347	603172	万丰股份	1,220	16,055.20	0.00
348	601022	宁波远洋	1,983	15,923.49	0.00
349	603153	上海建科	740	15,369.80	0.00
350	603173	福斯达	588	13,553.40	0.00
351	001376	百通能源	804	11,754.48	0.00
352	603130	云中马	480	10,632.00	0.00
353	603162	海通发展	1,146	10,543.20	0.00
354	603190	亚通精工	470	10,537.40	0.00
355	300274	阳光电源	126	9,302.58	0.00
356	001300	三柏硕	763	8,782.13	0.00
357	001278	一彬科技	473	7,686.25	0.00
358	603280	南方路机	363	7,579.44	0.00
359	001256	炜冈科技	474	7,536.60	0.00
360	001333	光华股份	426	7,374.06	0.00
361	001366	播恩集团	645	6,753.15	0.00
362	603282	亚光股份	457	6,681.34	0.00
363	001368	通达创智	351	6,619.86	0.00
364	603182	嘉华股份	546	6,284.46	0.00
365	603291	联合水务	536	6,233.68	0.00
366	002648	卫星化学	300	5,637.00	0.00
367	603065	宿迁联盛	581	4,223.87	0.00
368	600586	金晶科技	28	157.36	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	001301	尚太科技	119,402,358.86	5.98
2	601127	赛力斯	110,644,767.07	5.54
3	002594	比亚迪	98,105,496.72	4.91
4	301358	湖南裕能	96,968,702.40	4.86
5	000625	长安汽车	95,930,818.58	4.80
6	603009	北特科技	90,232,322.54	4.52
7	002709	天赐材料	80,523,200.92	4.03
8	002050	三花智控	76,066,470.22	3.81
9	300014	亿纬锂能	75,120,841.00	3.76
10	300100	双林股份	73,290,465.00	3.67
11	603659	璞泰来	61,167,374.48	3.06
12	300432	富临精工	56,546,923.50	2.83
13	002738	中矿资源	55,504,958.64	2.78
14	688116	天奈科技	54,296,527.76	2.72
15	601689	拓普集团	53,862,983.64	2.70
16	603596	伯特利	52,719,005.40	2.64
17	603667	五洲新春	52,320,146.20	2.62
18	603179	新泉股份	47,006,461.51	2.35
19	002466	天齐锂业	43,970,896.52	2.20
20	002384	东山精密	40,777,022.00	2.04
21	688017	绿的谐波	40,421,868.48	2.02
22	002460	赣锋锂业	40,289,513.80	2.02
23	603799	华友钴业	40,261,838.70	2.02

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。

8.4.2 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	600418	江淮汽车	314,902,698.88	15.77
2	002050	三花智控	151,549,042.07	7.59
3	603009	北特科技	121,504,272.55	6.08
4	000625	长安汽车	114,774,243.23	5.75
5	601127	赛力斯	110,916,921.70	5.55
6	603667	五洲新春	102,662,130.53	5.14
7	002594	比亚迪	96,884,810.00	4.85
8	601689	拓普集团	96,274,903.20	4.82
9	300580	贝斯特	82,792,360.68	4.15

10	603179	新泉股份	74,370,413.26	3.72
11	688160	步科股份	66,477,926.70	3.33
12	603596	伯特利	66,306,575.20	3.32
13	001301	尚太科技	65,778,015.00	3.29
14	688017	绿的谐波	64,315,582.31	3.22
15	688320	禾川科技	54,418,741.75	2.73
16	300258	精锻科技	53,275,735.00	2.67
17	603728	鸣志电器	52,077,734.86	2.61
18	688698	伟创电气	51,167,493.64	2.56
19	002920	德赛西威	48,034,150.56	2.41
20	603662	柯力传感	46,887,805.16	2.35
21	300014	亿纬锂能	44,581,655.47	2.23
22	002896	中大力德	42,865,005.00	2.15
23	301368	丰立智能	42,231,248.50	2.11

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。

8.4.3 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	2,902,437,129.19
卖出股票收入（成交）总额	3,209,012,594.11

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

8.12.3 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	457,740.16
2	应收清算款	7,163,904.95
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	915,157.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,536,802.53

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	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 (%)
鹏华新能源汽车混合 A	22,613	84,513.90	6,047,969.91	0.32	1,905,064,839.76	99.68
鹏华新能源汽车混合 C	20,153	20,946.63	7,747,930.38	1.84	414,389,575.11	98.16
合计	42,766	54,558.54	13,795,900.29	0.59	2,319,454,414.87	99.41

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华新能源汽车混合 A	2,654,507.36	0.1389
	鹏华新能源汽车混合 C	517,999.62	0.1227
	合计	3,172,506.98	0.1360

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。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	鹏华新能源汽车混合 A	>100
	鹏华新能源汽车混合 C	—
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏华新能源汽车混合 A	—
	鹏华新能源汽车混合 C	—
	合计	—

注：1、截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

2、截至本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金份额。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华新能源汽车混合 A	鹏华新能源汽车混合 C
基金合同生效日 (2022 年 7 月 26 日) 基金份额总额	2,651,431,178.01	509,156,204.59
本报告期期初基金份额总额	2,252,081,744.40	613,078,189.47
本报告期基金总申购份额	228,656,432.62	530,533,657.20
减：本报告期基金总赎回份额	569,625,367.35	721,474,341.18
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,911,112,809.67	422,137,505.49

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，公司原副总经理王宗合先生因个人身体原因辞职，经公司第六届董事会第二百零四次会议审议通过，自 2024 年 2 月 6 日起，王宗合先生不再担任公司副总经理。

报告期内，公司原副总经理邢彪先生因个人原因辞职，经公司第六届董事会第二百一十七次董事会审议通过，自 2024 年 4 月 11 日起，邢彪先生不再担任公司副总经理。

报告期内，公司原董事长、董事何如先生因退休原因不再担任公司第六届董事会董事长、董事，经公司 2024 年第三次临时股东会会议、第六届董事会第二百一十八次董事会审议通过，聘任张纳沙女士担任公司第六届董事会董事长、董事，任职日期自 2024 年 4 月 12 日起。

报告期内，公司副总经理刘嵌先生不再兼任北京分公司总经理，经公司 2024 年第十五次总裁办公会审议通过，聘任田智勇先生担任北京分公司总经理，任职日期自 2024 年 5 月 7 日

起。

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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

经履行必要程序，本基金本报告期内改聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所。本基金本年度支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关责任人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 19 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正及警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定未严格执行，个别业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人高度重视，按照法律法规及相关要求积极落实整改工作。截至报告日，上述事项已整改完毕
其他	—

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用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 (%)	
招商证券	2	1,420,716.0	23.38	810,516.29	22.78	—

		21.32				
国泰君安	2	1,321,906,594.01	21.75	764,422.93	21.48	—
国信证券	2	950,153,604.42	15.63	631,135.06	17.74	—
东吴证券	1	381,006,119.40	6.27	198,996.37	5.59	—
中金公司	1	378,043,014.03	6.22	209,903.19	5.90	—
兴业证券	1	327,964,442.45	5.40	163,177.75	4.59	—
长江证券	1	241,977,689.32	3.98	143,466.88	4.03	—
广发证券	1	198,376,964.72	3.26	175,580.41	4.93	—
华西证券	2	188,709,638.72	3.11	118,482.86	3.33	—
中信证券	1	174,594,891.93	2.87	78,715.32	2.21	—
国元证券	1	146,251,334.78	2.41	65,945.11	1.85	—
中信建投证券	1	140,998,728.56	2.32	79,886.04	2.25	—
申万宏源证券	3	139,902,810.93	2.30	91,396.58	2.57	—
海通证券	2	50,489,817.46	0.83	19,185.96	0.54	—
开源证券	1	16,069,885.22	0.26	7,246.49	0.20	本报告期新增
高华证券	1	—	—	—	—	—
华鑫证券	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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 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	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购博隆技术首次公开发行 A 股的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 04 日
2	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 18 日
3	鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 19 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 23 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 02 日
6	鹏华基金管理有限公司关于暂停北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 02 日
7	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 08 日
8	鹏华基金管理有限公司关于终止与北京中期时代基金销售有限公司销售合作关系的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 04 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 16 日
10	鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金 2023 年年度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 28 日

11	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 30 日
12	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
13	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
14	鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 19 日
15	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 10 日
16	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 16 日
17	鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金更新的招募说明书	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 07 日
18	鹏华新能源汽车主题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）	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 07 日
19	鹏华新能源汽车主题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）	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 07 日
20	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低赎回份额和账户最低份额余额限制的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 12 日
21	鹏华基金管理有限公司关于终止与喜鹊财富基金销售有限公司销售合作关系的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 12 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 13 日
23	鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 18 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与渤海证券股份有限公司认/申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 29 日
25	关于鹏华基金管理有限公司旗下部	《证券时报》、基金管	2024 年 08 月 21 日

	分基金申购小方制药首次公开发行 A 股的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
26	鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金 2024 年中期报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 08 月 29 日
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 09 月 25 日
28	鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 24 日
29	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 02 日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 06 日
31	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购蓝宇股份首次公开发行 A 股的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 12 日
32	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 18 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加招商银行股份有限公司基金转换业务申购补差费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 19 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- （一）《鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金 2024 年年度报告》（原文）。

13.2 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。

13.3 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：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2025 年 3 月 28 日