

# 鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 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，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
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	11
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61

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 .....	61
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 .....	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
7.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>63</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
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 .....	63
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>64</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
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 .....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
10.4 基金投资策略的改变 .....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
10.8 其他重大事件 .....	66
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
12.1 备查文件目录 .....	67
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金		
基金简称	鹏华中证 1000 指数增强		
基金主代码	016785		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2022 年 12 月 26 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	346, 555, 255. 04 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基 金简称	鹏华中证 1000 指数增强 A	鹏华中证 1000 指数增强 C	鹏华中证 1000 指数增强 I
下属分级基金的交 易代码	016785	016786	022822
报告期末下属分级 基金的份额总额	149, 819, 051. 53 份	196, 716, 671. 74 份	19, 531. 77 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金为指数增强型基金，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，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越业绩比较基准的超额收益。</p> <p>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。</p> <p>（1）多因子量化选股模型</p> <p>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。</p> <p>（2）风险控制与调整</p> <p>本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度</p>

	<p>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。</p> <p>本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。</p> <p>（3）投资组合优化模型</p> <p>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。</p> <p>2、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>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。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>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，实现股票组合的超额收益。</p> <p>5、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p> <p>6、参与融资及转融通证券出借业务策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票指数增强型基金，其预期的收益和风险高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

## 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	xxpl@phfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	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	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)		
	鹏华中证 1000 指数增强 A	鹏华中证 1000 指数增强 C	鹏华中证 1000 指数增强 I
本期已实现收益	15,903,111.71	19,467,887.40	3,033.78
本期利润	19,539,111.15	26,031,767.21	2,158.44
加权平均基金份额本期利润	0.1739	0.1824	0.1028
本期加权平均净值利润	14.87%	15.71%	9.49%

率			
本期基金份额净值增长率	16.01%	15.78%	16.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
期末可供分配利润	39,541,366.07	49,420,458.32	2,968.03
期末可供分配基金份额利润	0.2639	0.2512	0.1520
期末基金资产净值	189,360,417.60	246,137,130.06	22,499.80
期末基金份额净值	1.2639	1.2512	1.1520
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
基金份额累计净值增长率	26.39%	25.12%	15.20%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----



过去一个月	6.58%	0.90%	5.20%	0.89%	1.38%	0.01%
过去三个月	5.50%	1.83%	2.03%	1.73%	3.47%	0.10%
过去六个月	16.01%	1.58%	6.44%	1.56%	9.57%	0.02%
过去一年	41.57%	1.83%	28.45%	1.87%	13.12%	-0.04%
自基金合同生效 起至今	26.39%	1.50%	3.46%	1.55%	22.93%	-0.05%

鹏华中证 1000 指数增强 C

阶段	份额净 值增长 率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	6.54%	0.90%	5.20%	0.89%	1.34%	0.01%
过去三个月	5.40%	1.83%	2.03%	1.73%	3.37%	0.10%
过去六个月	15.78%	1.58%	6.44%	1.56%	9.34%	0.02%
过去一年	41.00%	1.83%	28.45%	1.87%	12.55%	-0.04%
自基金合同生效 起至今	25.12%	1.50%	3.46%	1.55%	21.66%	-0.05%

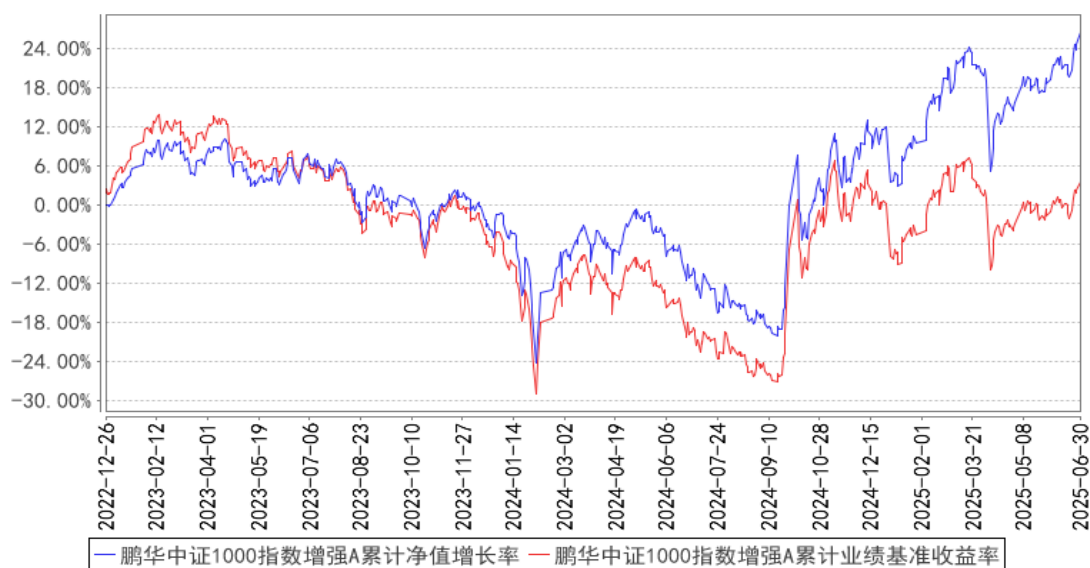
鹏华中证 1000 指数增强 I

阶段	份额净 值增长 率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	6.57%	0.90%	5.20%	0.89%	1.37%	0.01%
过去三个月	5.48%	1.83%	2.03%	1.73%	3.45%	0.10%
过去六个月	16.13%	1.58%	6.44%	1.56%	9.69%	0.02%
自基金合同生效 起至今	15.20%	1.56%	2.55%	1.56%	12.65%	0.00%

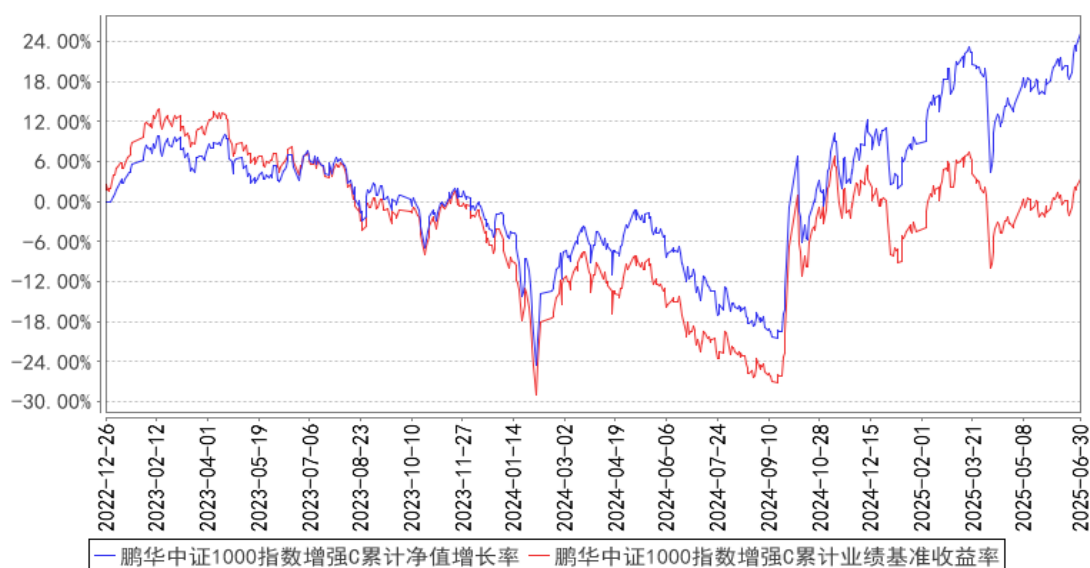
注：业绩比较基准=中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。鹏华中证 1000 指数增强 I 基金份额的首次确认日为 2024 年 12 月 19 日。

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

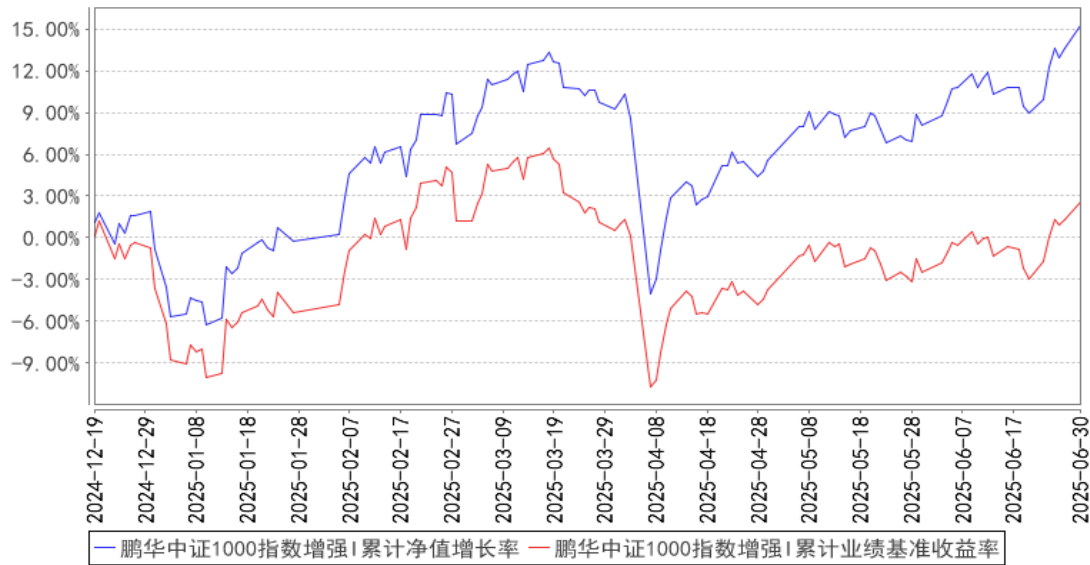
鹏华中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华中证1000指数增强I累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2022 年 12 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。鹏华中证 1000 指数增强 I 基金份额的首次确认日为 2024 年 12 月 19 日。

### 3.3 其他指标

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 12,513 亿元，359 只公募基金、12 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		
苏俊杰	本基金的基金经理	2022-12-26	-	13 年	苏俊杰先生，国籍中国，理学硕士，13 年证券从业经验。曾任 MSCI INC. 分析师，

					<p>华泰柏瑞基金管理有限公司专户投资经理，财通基金管理有限公司基金经理。2019 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部副总经理，现担任指数与量化投资部总经理/基金经理。2021 年 03 月至 2025 年 01 月担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理，2022 年 01 月至今担任鹏华中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 12 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华创业板指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，2023 年 02 月至今担任鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金基金经理，2023 年 06 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 08 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2023 年 09 月至 2024 年 10 月担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 09 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理，2024 年 01 月至 2025 年 06 月担任鹏华智投 800 混合型证券投资基金基金经理，2024 年 05 月至今担任鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金经理，2024 年 06 月至今担任鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年</p>
--	--	--	--	--	---

					02 月至今担任鹏华沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金经理，2025 年 02 月至今担任鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，苏俊杰先生具备基金从业资格。
时赟超	本基金的基金经理	2024-12-28	-	7 年	时赟超先生，国籍中国，工学硕士，7 年证券从业经验。曾任财通基金管理有限公司量化投资部研究助理。2019 年 11 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部量化研究员、高级量化研究员、资深量化研究员，现担任指数与量化投资部基金经理。时赟超具备基金从业资格。2024 年 12 月至今担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理，2024 年 12 月至今担任鹏华智投 800 混合型证券投资基金基金经理，2024 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华安泽混合型证券投资基金基金经理，时赟超先生具备基金从业资格。

注：1. 基金经理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

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

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

报告期内，本基金在控制相对中证 1000 指数跟踪误差的基础上，采用量化方法进行选股，在严格遵守指数成分股投资比例，控制包括行业、风格在内的各类风险暴露的前提下，力争在中证 1000 指数收益率的基础上进行增强。量化选股模型侧重于不同预测收益来源、不同预测周期因子的动态配置，辅以稳健均衡的风格，平衡模型长期有效性和对短期市场环境波动的适应性，力争获取稳健的超额收益。

我们的量化模型在基本面、量价、另类等因子上采用了相对均衡的配置以此应对各种行情，努力争取相对基准的超额收益。

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期 A 类份额净值增长率为 16.01%，同期业绩比较基准增长率为 6.44%；C 类份额净值增长率为 15.78%，同期业绩比较基准增长率为 6.44%；I 类份额净值增长率为 16.13%，同期业绩比较基准增长率为 6.44%。

#### 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 年下半年宏观经济预计仍然面临一系列挑战，一方面，美国对等关税政策对进出口贸易带来极大的不确定性，出口短期可能维持较高增速，但后期受关税上升影响易放缓；另一方面，国内有效需求仍然不足，价格仍然偏弱，需要重点关注政策的支持力度。预计政策会从需求和供给两个维度，双管齐下，通过反内卷出清行业过剩产能，提振价格，实现行业高质量发展，同时在需求端继续加力各类政策补贴、基建等。

市场走势上，在政策共识、盈利回升和资金回流共振驱动下，A 股可能在 2025 年下半年迎来真正行情拐点。美联储降息预期不断增强，全球流动性共振宽松，叠加中美关系缓和，将吸引外

资回流；赚钱效应的改善，将推动股市作为居民资产配置的新的蓄水池；此外机构的中长期配置资金也会继续有序的进入到市场中来。随着市场成熟度提升，未来市场的波动率有望实现系统性的降低，A 股市场可能会进入真正意义上的慢牛，长牛。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，鹏华中证 1000 指数增强 A 期末可供分配利润为 39,541,366.07 元，期末基金份额净值 1.2639 元；鹏华中证 1000 指数增强 C 期末可供分配利润为 49,420,458.32 元，期末基金份额净值 1.2512 元；鹏华中证 1000 指数增强 I 期末可供分配利润为 2,968.03 元，期末基金份额净值 1.1520 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	64,070,216.16	27,459,193.61
结算备付金		6,116,253.49	-
存出保证金		4,075,531.20	-
交易性金融资产	6.4.7.2	367,099,644.98	212,551,185.56
其中：股票投资		367,099,644.98	212,551,185.56
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-



买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		13,764,503.22	2,197,084.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		455,126,149.05	242,207,463.90
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		19,044,876.50	15,595,167.38
应付管理人报酬		259,829.80	164,651.05
应付托管费		48,718.09	30,872.06
应付销售服务费		72,834.21	45,534.55
应付投资顾问费		-	-
应交税费		71,089.77	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	108,753.22	160,000.00
负债合计		19,606,101.59	15,996,225.04
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	346,555,255.04	208,504,181.25
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	88,964,792.42	17,707,057.61
净资产合计		435,520,047.46	226,211,238.86
负债和净资产总计		455,126,149.05	242,207,463.90

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额为 346,555,255.04 份，其中鹏华中证 1000 指数增强 A 基金份额总额为 149,819,051.53 份，基金份额净值 1.2639 元；鹏华中证 1000 指数增强 C 基金份额总额为 196,716,671.74 份，基金份额净值 1.2512 元；鹏华中证 1000 指数增强 I 基金份额总额为 19,531.77 份，基金份额净值 1.1520 元。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		47,381,627.19	-28,456,695.49
1. 利息收入		47,892.13	35,034.43
其中：存款利息收入	6.4.7.13	47,892.13	35,034.43
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）		36,840,295.59	-9,762,536.94
其中：股票投资收益	6.4.7.14	32,655,268.54	-13,805,829.23
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	768,930.76	-
股利收益	6.4.7.19	3,416,096.29	4,043,292.29
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	10,203,843.99	-18,795,037.49
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	289,595.48	65,844.51
<b>减：二、营业总支出</b>		1,808,590.39	2,005,283.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,172,079.84	1,300,025.80
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	219,764.96	243,754.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	326,487.80	376,203.71
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		7,616.76	-
8. 其他费用	6.4.7.23	82,641.03	85,298.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		45,573,036.80	-30,461,978.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		45,573,036.80	-30,461,978.71
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		45,573,036.80	-30,461,978.71

### 6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	208,504,181.25	-	17,707,057.61	226,211,238.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	208,504,181.25	-	17,707,057.61	226,211,238.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	138,051,073.79	-	71,257,734.81	209,308,808.60
（一）、综合收益总额	-	-	45,573,036.80	45,573,036.80
（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）	138,051,073.79	-	25,684,698.01	163,735,771.80
其中：1. 基金申购款	481,561,611.48	-	85,088,274.64	566,649,886.12

2. 基金赎回款	- 343,510,537.69	-	-59,403,576.63	-402,914,114.32
(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	346,555,255.04	-	88,964,792.42	435,520,047.46
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	364,155,087.37	-	-6,171,082.52	357,984,004.85
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	364,155,087.37	-	-6,171,082.52	357,984,004.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-45,487,488.29	-	-29,016,600.00	-74,504,088.29
(一)、综合收益总额	-	-	-30,461,978.71	-30,461,978.71
(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)	-45,487,488.29	-	1,445,378.71	-44,042,109.58
其中：1. 基金申购款	285,506,678.12	-	-21,734,175.02	263,772,503.10
2. 基金赎回款	- 330,994,166.41	-	23,179,553.73	-307,814,612.68
(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	318,667,599.08	-	-35,187,682.52	283,479,916.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

基金管理人负责人

聂连杰

主管会计工作负责人

郝文高

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]2072 号《关于准予鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 208,363,141.89 元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(22)第 00615 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 12 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 208,459,648.51 份基金份额，其中认购资金利息折合 96,506.62 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《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》、《鹏华中证 1000 指数增强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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 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[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]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。

(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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	36,215,804.26
等于：本金	36,212,064.23
加：应计利息	3,740.03
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	27,854,411.90
等于：本金	27,853,568.33

加：应计利息	843.57
减：坏账准备	-
合计	64,070,216.16

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		351,288,543.99	-	367,099,644.98	15,811,100.99
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		351,288,543.99	-	367,099,644.98	15,811,100.99

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	32,577,960.00	-	-	-
其中：股指期货投资	32,577,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-



合计	32,577,960.00	-	-	-
----	---------------	---	---	---

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2507	IM2507	27.00	33,962,760.00	1,384,800.00
合计				1,384,800.00
减：可抵销期货暂收款				1,384,800.00
净额				0.00

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

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

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.06
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
其他	29,410.00
合计	108,753.22

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	100,364,309.14	100,364,309.14
本期申购	140,944,816.35	140,944,816.35
本期赎回（以“-”号填列）	-91,490,073.96	-91,490,073.96
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	149,819,051.53	149,819,051.53

鹏华中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	108,139,862.11	108,139,862.11
本期申购	340,551,155.02	340,551,155.02
本期赎回（以“-”号填列）	-251,974,345.39	-251,974,345.39
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	196,716,671.74	196,716,671.74

鹏华中证 1000 指数增强 I

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10.00	10.00
本期申购	65,640.11	65,640.11
本期赎回（以“-”号填列）	-46,118.34	-46,118.34
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	19,531.77	19,531.77

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

鹏华中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,139,137.98	-9,155,954.45	8,983,183.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	18,139,137.98	-9,155,954.45	8,983,183.53
本期利润	15,903,111.71	3,635,999.44	19,539,111.15
本期基金份额交易产生的变动数	15,859,438.87	-4,840,367.48	11,019,071.39
其中：基金申购款	40,566,883.21	-13,521,752.15	27,045,131.06
基金赎回款	-24,707,444.34	8,681,384.67	-16,026,059.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,901,688.56	-10,360,322.49	39,541,366.07

鹏华中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,596,293.37	-9,872,419.21	8,723,874.16
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	18,596,293.37	-9,872,419.21	8,723,874.16

本期利润	19,467,887.40	6,563,879.81	26,031,767.21
本期基金份额交易产生的变动数	25,022,093.32	-10,357,276.37	14,664,816.95
其中：基金申购款	94,380,280.09	-36,342,044.69	58,038,235.40
基金赎回款	-69,358,186.77	25,984,768.32	-43,373,418.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	63,086,274.09	-13,665,815.77	49,420,458.32

鹏华中证 1000 指数增强 I

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	0.26	-0.34	-0.08
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	0.26	-0.34	-0.08
本期利润	3,033.78	-875.34	2,158.44
本期基金份额交易产生的变动数	178.11	631.56	809.67
其中：基金申购款	5,972.13	-1,063.95	4,908.18
基金赎回款	-5,794.02	1,695.51	-4,098.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,212.15	-244.12	2,968.03

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	24,966.79
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	16,881.81
结算备付金利息收入	4,914.90
其他	1,128.63
合计	47,892.13

注：1、其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

2、其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	32,655,268.54
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	32,655,268.54

#### 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	536,413,249.44
减：卖出股票成本总额	503,181,848.89
减：交易费用	576,132.01
买卖股票差价收入	32,655,268.54

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

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

无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

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

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

无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

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

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	768,930.76

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,416,096.29
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	3,416,096.29

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	8,859,377.97
股票投资	8,859,377.97
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	1,384,800.00
权证投资	—
期货投资	1,384,800.00
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	40,333.98
合计	10,203,843.99

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	289,059.49
基金转换费收入	535.99
合计	289,595.48

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费用	3,290.21
存托服务费	7.66
合计	82,641.03

#### 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 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,183,854,993.31	100.00	1,649,713,225.18	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

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 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	231,960.58	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	871,729.27	100.00	-	-
------	------------	--------	---	---

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,172,079.84	1,300,025.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	450,949.96	481,445.42
应支付基金管理人的净管理费	721,129.88	818,580.38

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	219,764.96	243,754.79

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

单位：人民币元

	本期
--	----

获得销售服务费的各关联方名称	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	鹏华中证 1000 指数增强 A	鹏华中证 1000 指数增强 C	鹏华中证 1000 指数增强 I	合计
国信证券	-	76,671.71	-	76,671.71
鹏华基金公司	-	16,894.11	10.51	16,904.62
招商银行	-	13,148.94	-	13,148.94
合计	-	106,714.76	10.51	106,725.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	鹏华中证 1000 指数增强 A	鹏华中证 1000 指数增强 C	鹏华中证 1000 指数增强 I	合计
国信证券	-	153,613.97	-	153,613.97
鹏华基金公司	-	112,935.33	-	112,935.33
招商银行	-	4,360.08	-	4,360.08
合计	-	270,909.38	-	270,909.38

注：鹏华中证 1000 指数增强 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华中证 1000 指数增强 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.4%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.4%÷当年天数；支付基金销售机构的鹏华中证 1000 指数增强 I 基金份额的销售服务费年费率为 0.1%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.1%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

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

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
国信证券	27,854,411.90	16,881.81	14,442,145.17	17,310.63
招商银行	36,215,804.26	24,966.79	6,269,763.50	17,723.80

6.4.10.7 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	603325	博隆技术	网下申购	343	24,853.78

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	411	2,178.30	5,934.84	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	141	3,994.53	6,342.18	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	185	5,087.50	10,395.15	-
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	473	4,919.20	16,134.03	-
301479	弘景光	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	158	4,734.70	12,303.46	弘景光电于

	电	日								2025 年 5 月 28 日 每 10 股 送 4 股
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	173	4,750.48	7,823.06	恒鑫生活于 2025 年 6 月 6 日 每 10 股 送 4.5 股
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	574	3,845.80	14,235.20	-
301636	泽润新	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-

	能	日								
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	150	3,975.00	4,902.00	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	119	1,463.70	6,479.55	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	39	3,646.50	3,535.74	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-

	林	日								
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股 流通 受限	20.60	35.08	91	1,874.60	3,192.28	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股 流通 受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股 流通 受限	24.18	33.32	74	1,789.32	2,465.68	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	19.38	83.49	387	7,500.06	32,310.63	-
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	11.68	26.95	464	5,419.52	12,504.80	-
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	思看科技于 2025 年 6 月 19 日每 10 股送 3 股
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股 流通 受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛	2025	6 个月	新股	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-

	分科技	年 1 月 2 日		流通受限						
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	273	12,904.71	33,895.68	-

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

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	14,600	422,761.17	555,530.00	-

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

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行



或上市交易的股票（包含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行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 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2024 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

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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 2025 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

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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	64,070,216.16	-	-	-	64,070,216.16
结算备付金	6,116,253.49	-	-	-	6,116,253.49
存出保证金	4,075,531.20	-	-	-	4,075,531.20
交易性金融资产	-	-	-	367,099,644.98	367,099,644.98
应收申购款	-	-	-	13,764,503.22	13,764,503.22
资产总计	74,262,000.85	-	-	380,864,148.20	455,126,149.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,044,876.50	19,044,876.50
应付管理人报酬	-	-	-	259,829.80	259,829.80
应付托管费	-	-	-	48,718.09	48,718.09
应付销售服务费	-	-	-	72,834.21	72,834.21
应交税费	-	-	-	71,089.77	71,089.77
其他负债	-	-	-	108,753.22	108,753.22
负债总计	-	-	-	19,606,101.59	19,606,101.59
利率敏感度缺口	74,262,000.85	-	-	361,258,046.61	435,520,047.46
上年度末 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	27,459,193.61	-	-	-	27,459,193.61
交易性金融资产	-	-	-	212,551,185.56	212,551,185.56
应收申购款	-	-	-	2,197,084.73	2,197,084.73
资产总计	27,459,193.61	-	-	214,748,270.29	242,207,463.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,595,167.38	15,595,167.38
应付管理人报酬	-	-	-	164,651.05	164,651.05
应付托管费	-	-	-	30,872.06	30,872.06
应付销售服务费	-	-	-	45,534.55	45,534.55
其他负债	-	-	-	160,000.00	160,000.00

负债总计	-	-	-	15,996,225.04	15,996,225.04
利率敏感度缺口	27,459,193.61	-	-	-198,752,045.25	226,211,238.86

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

于 2025 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

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，本基金在履行适当程序后以变更后的比例为准。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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	367,099,644.98	84.29	212,551,185.56	93.96
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	367,099,644.98	84.29	212,551,185.56	93.96

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	19,951,173.37	10,129,739.28
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-19,951,173.37	-10,129,739.28

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	366,170,865.26
第二层次	570,915.54
第三层次	357,864.18
合计	367,099,644.98

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	367,099,644.98	80.66
	其中：股票	367,099,644.98	80.66
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	70,186,469.65	15.42
8	其他各项资产	17,840,034.42	3.92
9	合计	455,126,149.05	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：414,190.00 元，占净值比 0.10%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

### 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	171,720.00	0.04
B	采矿业	2,245,432.00	0.52
C	制造业	215,449,777.56	49.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,683,761.90	1.31
E	建筑业	867,508.00	0.20
F	批发和零售业	14,234,978.84	3.27
G	交通运输、仓储和邮政业	4,947,624.62	1.14
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,043,559.09	11.49
J	金融业	3,909,551.00	0.90
K	房地产业	6,063,591.00	1.39



L	租赁和商务服务业	5,584,156.00	1.28
M	科学研究和技术服务业	9,469,161.85	2.17
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
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	1,846,481.00	0.42
S	综合	—	—
	合计	320,517,302.86	73.59

### 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	—	—
C	制造业	35,876,292.00	8.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	951,727.00	0.22
E	建筑业	3,075.00	0.00
F	批发和零售业	1,608,231.00	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	8,775.92	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,105,895.00	1.17
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	1,100,700.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	1,863,582.20	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	64,064.00	0.01
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	46,582,342.12	10.70

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	300232	洲明科技	831,200	6,017,888.00	1.38
2	603236	移远通信	60,500	5,190,900.00	1.19
3	002405	四维图新	592,800	5,062,512.00	1.16
4	603444	吉比特	16,700	5,042,565.00	1.16
5	300363	博腾股份	285,100	4,869,508.00	1.12
6	688001	华兴源创	190,800	4,821,516.00	1.11
7	603766	隆鑫通用	366,100	4,671,436.00	1.07
8	001914	招商积余	368,400	4,557,108.00	1.05
9	002174	游族网络	352,600	4,277,038.00	0.98
10	688208	道通科技	121,775	3,726,315.00	0.86
11	002668	TCL 智家	356,676	3,484,724.52	0.80
12	300416	苏试试验	235,000	3,367,550.00	0.77
13	600782	新钢股份	950,000	3,363,000.00	0.77
14	600866	星湖科技	479,700	3,314,727.00	0.76
15	300184	力源信息	337,160	3,310,911.20	0.76
16	603698	航天工程	184,600	3,252,652.00	0.75
17	300768	迪普科技	188,700	3,236,205.00	0.74
18	600063	皖维高新	702,900	3,219,282.00	0.74
19	002597	金禾实业	136,000	3,202,800.00	0.74
20	002396	星网锐捷	139,700	3,136,265.00	0.72
21	600458	时代新材	219,003	3,004,721.16	0.69
22	300850	新强联	82,959	2,971,591.38	0.68
23	600728	佳都科技	537,900	2,931,555.00	0.67
24	002993	奥海科技	70,100	2,907,047.00	0.67
25	002139	拓邦股份	210,000	2,900,100.00	0.67
26	600335	国机汽车	436,000	2,812,200.00	0.65
27	688586	江航装备	249,355	2,805,243.75	0.64
28	688088	虹软科技	58,075	2,802,118.75	0.64
29	600267	海正药业	302,500	2,798,125.00	0.64
30	002891	中宠股份	43,700	2,703,719.00	0.62

31	002249	大洋电机	408,100	2,685,298.00	0.62
32	300113	顺网科技	135,400	2,675,504.00	0.61
33	001308	康冠科技	116,500	2,635,230.00	0.61
34	601519	大智慧	256,200	2,610,678.00	0.60
35	300456	赛微电子	151,200	2,599,128.00	0.60
36	300972	万辰集团	14,061	2,534,354.64	0.58
37	002242	九阳股份	265,300	2,520,350.00	0.58
38	301031	中熔电气	31,556	2,513,435.40	0.58
39	600664	哈药股份	675,200	2,484,736.00	0.57
40	300303	聚飞光电	383,100	2,428,854.00	0.56
41	688128	中国电研	98,800	2,420,600.00	0.56
42	301215	中汽股份	384,800	2,385,760.00	0.55
43	688252	天德钰	96,714	2,357,887.32	0.54
44	601609	金田股份	334,200	2,342,742.00	0.54
45	300596	利安隆	79,500	2,287,215.00	0.53
46	600305	恒顺醋业	294,100	2,273,393.00	0.52
47	002895	川恒股份	99,400	2,242,464.00	0.51
48	600216	浙江医药	150,800	2,230,332.00	0.51
49	002913	奥士康	75,800	2,229,278.00	0.51
50	301171	易点天下	82,800	2,213,244.00	0.51
51	603456	九洲药业	144,900	2,203,929.00	0.51
52	301069	凯盛新材	135,400	2,181,294.00	0.50
53	688018	乐鑫科技	14,620	2,135,982.00	0.49
54	002706	良信股份	239,300	2,132,163.00	0.49
55	002468	申通快递	198,300	2,119,827.00	0.49
56	603876	鼎胜新材	229,700	2,087,973.00	0.48
57	688327	云从科技-UW	149,838	2,066,266.02	0.47
58	300296	利亚德	334,700	2,041,670.00	0.47
59	300725	药石科技	52,600	2,035,620.00	0.47
60	688690	纳微科技	87,600	1,999,908.00	0.46
61	000058	深赛格	236,600	1,966,146.00	0.45
62	600073	光明肉业	262,500	1,937,250.00	0.44
63	300236	上海新阳	49,700	1,928,360.00	0.44
64	301029	怡合达	80,700	1,844,802.00	0.42
65	301327	华宝新能	35,800	1,838,688.00	0.42
66	300475	香农芯创	51,600	1,838,508.00	0.42
67	688209	英集芯	94,200	1,739,874.00	0.40
68	600338	西藏珠峰	156,800	1,738,912.00	0.40
69	603013	亚普股份	100,400	1,734,912.00	0.40
70	600812	华北制药	280,100	1,731,018.00	0.40
71	002434	万里扬	231,700	1,698,361.00	0.39
72	603039	泛微网络	30,200	1,682,140.00	0.39
73	000901	航天科技	133,600	1,660,648.00	0.38

74	688150	莱特光电	67,100	1,658,712.00	0.38
75	000672	上峰水泥	208,500	1,647,150.00	0.38
76	002815	崇达技术	143,600	1,626,988.00	0.37
77	688400	凌云光	58,200	1,604,574.00	0.37
78	600273	嘉化能源	188,900	1,598,094.00	0.37
79	300770	新媒股份	39,800	1,591,602.00	0.37
80	688523	航天环宇	73,800	1,587,438.00	0.36
81	605168	三人行	53,800	1,583,334.00	0.36
82	600757	长江传媒	170,400	1,581,312.00	0.36
83	688185	康希诺	26,400	1,574,232.00	0.36
84	002034	旺能环境	91,600	1,537,964.00	0.35
85	002075	沙钢股份	260,100	1,513,782.00	0.35
86	603699	纽威股份	48,300	1,505,511.00	0.35
87	000600	建投能源	202,400	1,398,584.00	0.32
88	688343	云天励飞-U	28,100	1,388,702.00	0.32
89	002010	传化智联	248,800	1,388,304.00	0.32
90	301078	孩子王	105,500	1,378,885.00	0.32
91	688029	南微医学	20,400	1,378,020.00	0.32
92	301039	中集车辆	168,200	1,367,466.00	0.31
93	002705	新宝股份	92,900	1,365,630.00	0.31
94	688289	圣湘生物	65,000	1,331,200.00	0.31
95	601126	四方股份	80,800	1,314,616.00	0.30
96	300035	中科电气	77,500	1,308,200.00	0.30
97	000059	华锦股份	242,400	1,306,536.00	0.30
98	600055	万东医疗	75,600	1,306,368.00	0.30
99	603118	共进股份	108,700	1,225,049.00	0.28
100	002245	蔚蓝锂芯	93,600	1,200,888.00	0.28
101	300034	钢研高纳	70,600	1,174,078.00	0.27
102	603043	广州酒家	75,300	1,173,174.00	0.27
103	300319	麦捷科技	107,800	1,157,772.00	0.27
104	600894	广日股份	109,500	1,148,655.00	0.26
105	600020	中原高速	237,800	1,136,684.00	0.26
106	600195	中牧股份	153,200	1,122,956.00	0.26
107	688048	长光华芯	19,400	1,120,156.00	0.26
108	603197	保隆科技	28,400	1,109,588.00	0.25
109	300080	易成新能	260,000	1,086,800.00	0.25
110	300755	华致酒行	55,500	1,071,150.00	0.25
111	688147	微导纳米	35,200	1,062,336.00	0.24
112	002315	焦点科技	23,000	1,050,870.00	0.24
113	600420	国药现代	97,700	1,040,505.00	0.24
114	600461	洪城环境	107,900	1,040,156.00	0.24
115	600640	国脉文化	84,000	1,018,080.00	0.23
116	600531	豫光金铅	130,700	1,011,618.00	0.23

117	000030	富奥股份	168,000	989,520.00	0.23
118	600459	贵研铂业	63,200	980,232.00	0.23
119	600961	株冶集团	85,900	960,362.00	0.22
120	002497	雅化集团	82,200	937,080.00	0.22
121	002036	联创电子	86,200	931,822.00	0.21
122	300101	振芯科技	40,500	916,515.00	0.21
123	300415	伊之密	45,200	910,780.00	0.21
124	000915	华特达因	25,600	904,960.00	0.21
125	300088	长信科技	145,600	867,776.00	0.20
126	601677	明泰铝业	69,400	861,948.00	0.20
127	002011	盾安环境	72,500	841,000.00	0.19
128	300777	中简科技	22,900	830,125.00	0.19
129	000156	华数传媒	101,800	808,292.00	0.19
130	002368	太极股份	34,400	805,648.00	0.18
131	002777	久远银海	44,000	803,440.00	0.18
132	002967	广电计量	45,400	798,586.00	0.18
133	600179	安通控股	288,100	795,156.00	0.18
134	002911	佛燃能源	77,215	792,225.90	0.18
135	601777	千里科技	92,800	787,872.00	0.18
136	002745	木林森	98,000	772,240.00	0.18
137	002985	北摩高科	24,800	750,200.00	0.17
138	600869	远东股份	145,700	740,156.00	0.17
139	600169	太原重工	305,500	739,310.00	0.17
140	002643	万润股份	64,200	738,942.00	0.17
141	002906	华阳集团	22,700	737,977.00	0.17
142	300602	飞荣达	34,600	733,866.00	0.17
143	300953	震裕科技	7,200	729,720.00	0.17
144	600012	皖通高速	42,769	726,217.62	0.17
145	603612	索通发展	39,500	726,010.00	0.17
146	600587	新华医疗	47,400	717,636.00	0.16
147	002081	金螳螂	205,800	705,894.00	0.16
148	000685	中山公用	78,000	684,840.00	0.16
149	603025	大豪科技	48,640	681,932.80	0.16
150	000829	天音控股	64,400	657,524.00	0.15
151	300655	晶瑞电材	64,900	649,649.00	0.15
152	300226	上海钢联	28,300	646,372.00	0.15
153	300298	三诺生物	28,600	646,074.00	0.15
154	002402	和而泰	27,500	637,175.00	0.15
155	002314	南山控股	241,000	633,830.00	0.15
156	002324	普利特	59,200	629,296.00	0.14
157	600550	保变电气	72,100	620,060.00	0.14
158	002588	史丹利	69,400	611,414.00	0.14
159	688484	南芯科技	15,400	609,070.00	0.14

160	688131	皓元医药	12,251	592,335.85	0.14
161	002063	远光软件	96,600	574,770.00	0.13
162	600908	无锡银行	89,800	566,638.00	0.13
163	301510	固高科技	18,000	540,900.00	0.12
164	688403	汇成股份	52,000	540,280.00	0.12
165	688007	光峰科技	37,000	535,020.00	0.12
166	002544	普天科技	22,600	529,970.00	0.12
167	688696	极米科技	4,600	526,056.00	0.12
168	600064	南京高科	66,300	511,173.00	0.12
169	001203	大中矿业	53,600	506,520.00	0.12
170	300687	赛意信息	18,200	505,596.00	0.12
171	603218	日月股份	39,300	498,717.00	0.11
172	300257	开山股份	49,400	497,458.00	0.11
173	002649	博彦科技	34,200	496,926.00	0.11
174	300224	正海磁材	34,600	489,590.00	0.11
175	688326	经纬恒润-W	5,400	481,896.00	0.11
176	603609	禾丰股份	58,000	479,080.00	0.11
177	600710	苏美达	49,500	475,695.00	0.11
178	002020	京新药业	35,700	465,885.00	0.11
179	600850	电科数字	19,000	459,610.00	0.11
180	000686	东北证券	60,100	458,563.00	0.11
181	601311	骆驼股份	50,600	456,918.00	0.10
182	002698	博实股份	28,800	447,552.00	0.10
183	300083	创世纪	52,100	428,262.00	0.10
184	300134	大富科技	34,800	425,604.00	0.10
185	600623	华谊集团	55,600	420,892.00	0.10
186	002204	大连重工	70,400	420,288.00	0.10
187	688536	思瑞浦	3,000	416,160.00	0.10
188	000681	视觉中国	19,900	400,786.00	0.09
189	600320	振华重工	90,300	394,611.00	0.09
190	600750	江中药业	17,200	375,476.00	0.09
191	688123	聚辰股份	4,600	372,554.00	0.09
192	603328	依顿电子	36,800	361,008.00	0.08
193	300446	航天智造	20,800	360,256.00	0.08
194	000682	东方电子	34,100	349,184.00	0.08
195	603171	税友股份	8,100	347,571.00	0.08
196	605111	新洁能	10,700	328,918.00	0.08
197	603063	禾望电气	9,600	325,056.00	0.07
198	603005	晶方科技	11,000	312,290.00	0.07
199	002516	旷达科技	60,600	312,090.00	0.07
200	002925	盈趣科技	17,200	309,256.00	0.07
201	600480	凌云股份	24,960	303,763.20	0.07
202	688266	泽璟制药-U	2,800	301,028.00	0.07

203	301090	华润材料	38,800	292,164.00	0.07
204	301297	富乐德	7,000	289,310.00	0.07
205	600577	精达股份	38,400	285,696.00	0.07
206	601208	东材科技	30,000	284,400.00	0.07
207	688146	中船特气	9,600	277,536.00	0.06
208	601963	重庆银行	25,200	273,672.00	0.06
209	300926	博俊科技	10,000	264,700.00	0.06
210	688206	概伦电子	8,800	255,904.00	0.06
211	002611	东方精工	20,600	248,436.00	0.06
212	000049	德赛电池	10,600	241,256.00	0.06
213	600266	城建发展	51,800	235,172.00	0.05
214	688498	源杰科技	1,200	234,000.00	0.05
215	002326	永太科技	17,900	230,373.00	0.05
216	002239	奥特佳	72,700	210,830.00	0.05
217	301268	铭利达	11,100	205,905.00	0.05
218	300401	花园生物	12,600	191,646.00	0.04
219	688322	奥比中光-UW	3,100	182,931.00	0.04
220	000690	宝新能源	39,600	180,180.00	0.04
221	000048	京基智农	10,800	171,720.00	0.04
222	300119	瑞普生物	8,800	170,896.00	0.04
223	000089	深圳机场	24,600	169,740.00	0.04
224	300762	上海瀚讯	7,400	167,462.00	0.04
225	300185	通裕重工	58,400	167,024.00	0.04
226	601801	皖新传媒	24,200	165,286.00	0.04
227	000628	高新发展	3,800	161,614.00	0.04
228	301061	匠心家居	2,040	158,181.60	0.04
229	300432	富临精工	11,900	155,533.00	0.04
230	002701	奥瑞金	25,100	149,345.00	0.03
231	300672	国科微	1,700	144,364.00	0.03
232	000913	钱江摩托	9,200	138,000.00	0.03
233	600641	万业企业	9,100	126,308.00	0.03
234	000657	中钨高新	10,400	123,344.00	0.03
235	605507	国邦医药	6,100	120,597.00	0.03
236	002091	江苏国泰	16,500	119,955.00	0.03
237	600201	生物股份	14,800	118,696.00	0.03
238	600557	康缘药业	7,200	106,416.00	0.02
239	600285	羚锐制药	4,500	102,015.00	0.02
240	300133	华策影视	13,300	99,883.00	0.02
241	300620	光库科技	2,100	98,931.00	0.02
242	300772	运达股份	7,649	98,519.12	0.02
243	300183	东软载波	5,800	97,498.00	0.02
244	301316	慧博云通	2,200	94,776.00	0.02
245	300685	艾德生物	4,300	92,579.00	0.02

246	603919	金徽酒	4,900	88,690.00	0.02
247	301526	国际复材	22,600	82,264.00	0.02
248	300470	中密控股	2,200	80,894.00	0.02
249	600595	中孚实业	16,400	71,832.00	0.02
250	002534	西子洁能	6,100	68,564.00	0.02
251	600986	浙文互联	8,300	67,811.00	0.02
252	300171	东富龙	4,800	63,792.00	0.01
253	300327	中颖电子	2,251	54,519.22	0.01
254	000761	本钢板材	14,800	53,280.00	0.01
255	603229	奥翔药业	6,000	52,320.00	0.01
256	300666	江丰电子	700	51,870.00	0.01
257	600780	通宝能源	8,400	49,812.00	0.01
258	688584	上海合晶	2,600	46,488.00	0.01
259	002276	万马股份	3,100	44,764.00	0.01
260	002258	利尔化学	3,800	41,952.00	0.01
261	601606	长城军工	1,400	40,670.00	0.01
262	600729	重庆百货	1,200	35,796.00	0.01
263	002237	恒邦股份	2,900	34,220.00	0.01
264	301511	德福科技	1,600	33,120.00	0.01
265	300776	帝尔激光	600	31,926.00	0.01
266	688005	容百科技	994	22,186.08	0.01
267	002268	电科网安	1,200	21,948.00	0.01
268	688262	国芯科技	800	21,336.00	0.00
269	300579	数字认证	500	17,255.00	0.00
270	301458	钧崴电子	473	16,134.03	0.00
271	300660	江苏雷利	360	15,926.40	0.00
272	301602	超研股份	574	14,235.20	0.00
273	688629	华丰科技	200	11,440.00	0.00
274	688097	博众精工	400	11,164.00	0.00
275	002690	美亚光电	600	10,122.00	0.00
276	300166	东方国信	800	8,720.00	0.00
277	300077	国民技术	300	7,680.00	0.00
278	603072	天和磁材	119	6,479.55	0.00
279	001356	富岭股份	411	5,934.84	0.00
280	603194	中力股份	129	5,855.31	0.00
281	300455	航天智装	100	1,440.00	0.00
282	600682	南京新百	200	1,344.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300869	康泰医学	207,500	2,975,550.00	0.68
2	002624	完美世界	135,300	2,052,501.00	0.47



3	600268	国电南自	255,800	2,000,356.00	0.46
4	688388	嘉元科技	92,700	1,861,416.00	0.43
5	000553	安道麦 A	207,600	1,498,872.00	0.34
6	002983	芯瑞达	66,900	1,417,611.00	0.33
7	688315	诺禾致源	97,900	1,382,348.00	0.32
8	300207	欣旺达	64,600	1,295,876.00	0.30
9	300973	立高食品	25,300	1,233,881.00	0.28
10	688668	鼎通科技	19,100	1,192,986.00	0.27
11	601003	柳钢股份	331,300	1,166,176.00	0.27
12	002637	赞宇科技	112,200	1,119,756.00	0.26
13	688220	翱捷科技-U	13,200	1,033,560.00	0.24
14	603989	艾华集团	62,961	969,599.40	0.22
15	000959	首钢股份	280,000	952,000.00	0.22
16	300662	科锐国际	31,100	923,981.00	0.21
17	300573	兴齐眼药	17,400	901,146.00	0.21
18	688162	巨一科技	30,600	833,544.00	0.19
19	600143	金发科技	70,800	729,948.00	0.17
20	600704	物产中大	138,300	728,841.00	0.17
21	603515	欧普照明	39,200	705,208.00	0.16
22	002893	京能热力	63,500	678,815.00	0.16
23	300604	长川科技	15,000	673,650.00	0.15
24	688261	东微半导	15,400	635,250.00	0.15
25	300496	中科创达	10,700	612,254.00	0.14
26	688313	仕佳光子	14,600	555,530.00	0.13
27	002169	智光电气	81,600	527,952.00	0.12
28	300369	绿盟科技	63,200	491,064.00	0.11
29	688181	八亿时空	14,800	460,576.00	0.11
30	000586	汇源通信	40,600	451,472.00	0.10
31	002080	中材科技	23,000	448,500.00	0.10
32	688244	永信至诚	17,000	447,440.00	0.10
33	603380	易德龙	16,800	446,880.00	0.10
34	300549	优德精密	24,000	438,960.00	0.10
35	301338	凯格精机	8,900	424,619.00	0.10
36	002107	沃华医药	73,000	417,560.00	0.10
37	300454	深信服	4,400	414,392.00	0.10
38	689009	九号公司-WD	7,000	414,190.00	0.10
39	600099	林海股份	37,800	409,752.00	0.09
40	000757	浩物股份	86,200	390,486.00	0.09
41	002585	双星新材	69,200	377,832.00	0.09
42	300562	乐心医疗	24,800	365,800.00	0.08
43	002377	国创高新	121,700	361,449.00	0.08
44	600067	冠城新材	113,400	337,932.00	0.08
45	000893	亚钾国际	11,200	337,568.00	0.08

46	301080	百普赛斯	4,700	336,191.00	0.08
47	300412	迦南科技	64,510	327,710.80	0.08
48	603968	醋化股份	27,600	313,812.00	0.07
49	000404	长虹华意	42,800	303,880.00	0.07
50	300030	阳普医疗	43,300	297,471.00	0.07
51	300866	安克创新	2,500	284,000.00	0.07
52	300807	天迈科技	6,600	267,168.00	0.06
53	002084	海鸥住工	70,300	249,565.00	0.06
54	002999	天禾股份	35,400	247,092.00	0.06
55	002803	吉宏股份	16,800	239,568.00	0.06
56	002209	达意隆	18,700	234,685.00	0.05
57	301270	汉仪股份	4,800	228,768.00	0.05
58	600501	航天晨光	10,600	217,194.00	0.05
59	300018	中元股份	27,100	215,445.00	0.05
60	300246	宝莱特	26,600	212,534.00	0.05
61	002206	海利得	40,600	207,466.00	0.05
62	301185	鸥玛软件	10,100	197,657.00	0.05
63	002337	赛象科技	33,100	193,304.00	0.04
64	688311	盟升电子	4,200	180,810.00	0.04
65	001228	永泰运	7,100	176,719.00	0.04
66	688066	航天宏图	8,400	164,472.00	0.04
67	688365	光云科技	10,800	164,376.00	0.04
68	300365	恒华科技	24,400	160,796.00	0.04
69	605080	浙江自然	5,500	152,900.00	0.04
70	300206	理邦仪器	12,600	151,452.00	0.03
71	688328	深科达	6,600	149,490.00	0.03
72	688371	菲沃泰	8,900	147,384.00	0.03
73	601991	大唐发电	43,600	138,212.00	0.03
74	600578	京能电力	30,000	134,700.00	0.03
75	000729	燕京啤酒	10,400	134,472.00	0.03
76	688373	盟科药业-U	20,400	127,908.00	0.03
77	300500	启迪设计	9,600	116,640.00	0.03
78	600579	中化装备	14,500	115,855.00	0.03
79	603187	海容冷链	9,200	108,192.00	0.02
80	300623	捷捷微电	3,600	107,280.00	0.02
81	688377	迪威尔	4,400	105,028.00	0.02
82	301367	瑞迈特	1,200	100,920.00	0.02
83	603486	科沃斯	1,700	98,991.00	0.02
84	688030	山石网科	5,000	79,950.00	0.02
85	002976	瑞玛精密	3,000	78,000.00	0.02
86	600237	铜峰电子	10,400	75,400.00	0.02
87	000803	山高环能	10,400	64,064.00	0.01
88	688800	瑞可达	1,260	61,992.00	0.01

89	688025	杰普特	800	57,200.00	0.01
90	688526	科前生物	3,600	56,088.00	0.01
91	002523	天桥起重	11,100	40,515.00	0.01
92	002795	永和智控	7,800	40,482.00	0.01
93	688039	当虹科技	1,200	39,384.00	0.01
94	300627	华测导航	1,080	37,800.00	0.01
95	688775	影石创新	273	33,895.68	0.01
96	688411	海博思创	387	32,310.63	0.01
97	300644	南京聚隆	1,200	32,052.00	0.01
98	001269	欧晶科技	1,200	30,720.00	0.01
99	001696	宗申动力	1,200	26,940.00	0.01
100	300605	恒锋信息	1,800	26,856.00	0.01
101	301221	光庭信息	500	25,985.00	0.01
102	300400	劲拓股份	1,300	21,892.00	0.01
103	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
104	301119	正强股份	500	17,680.00	0.00
105	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
106	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
107	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
108	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
109	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
110	688545	兴福电子	464	12,504.80	0.00
111	301479	弘景光电	158	12,303.46	0.00
112	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
113	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
114	301275	汉朔科技	185	10,395.15	0.00
115	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
116	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
117	301585	蓝宇股份	273	9,363.90	0.00
118	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
119	001391	国货航	1,304	8,775.92	0.00
120	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
121	301501	恒鑫生活	173	7,823.06	0.00
122	603799	华友钴业	200	7,404.00	0.00
123	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
124	301173	毓恬冠佳	141	6,342.18	0.00
125	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
126	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
127	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
128	001322	箭牌家居	600	5,070.00	0.00
129	603014	威高血净	150	4,902.00	0.00
130	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
131	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00

132	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
133	603202	天有为	39	3,535.74	0.00
134	603271	永杰新材	91	3,192.28	0.00
135	601886	江河集团	500	3,075.00	0.00
136	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
137	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
138	603409	汇通控股	74	2,465.68	0.00
139	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
140	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
141	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002174	游族网络	5,533,788.00	2.45
2	002405	四维图新	5,378,658.81	2.38
3	300363	博腾股份	5,293,385.00	2.34
4	688001	华兴源创	5,127,478.74	2.27
5	300768	迪普科技	4,706,021.00	2.08
6	603236	移远通信	4,596,246.00	2.03
7	603444	吉比特	4,520,846.00	2.00
8	300113	顺网科技	4,497,046.00	1.99
9	688608	恒玄科技	4,318,025.09	1.91
10	600063	皖维高新	4,251,349.97	1.88
11	300232	洲明科技	4,212,838.00	1.86
12	600866	星湖科技	4,016,377.00	1.78
13	300827	上能电气	3,933,119.14	1.74
14	600782	新钢股份	3,629,331.00	1.60
15	688183	生益电子	3,608,006.55	1.59
16	300973	立高食品	3,551,453.00	1.57
17	002597	金禾实业	3,549,161.00	1.57
18	300682	朗新集团	3,548,669.00	1.57
19	600267	海正药业	3,532,974.00	1.56
20	300184	力源信息	3,501,213.60	1.55

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	688183	生益电子	6,027,646.44	2.66
2	300031	宝通科技	5,350,824.00	2.37

3	688023	安恒信息	4,447,735.94	1.97
4	688608	恒玄科技	4,232,365.15	1.87
5	300827	上能电气	4,064,315.00	1.80
6	301339	通行宝	4,022,020.20	1.78
7	300682	朗新集团	3,979,919.00	1.76
8	688321	微芯生物	3,979,202.42	1.76
9	002906	华阳集团	3,887,687.00	1.72
10	300674	宇信科技	3,752,082.00	1.66
11	300772	运达股份	3,689,827.00	1.63
12	300035	中科电气	3,605,740.00	1.59
13	688232	新点软件	3,556,052.07	1.57
14	002204	大连重工	3,522,269.00	1.56
15	002534	西子洁能	3,517,978.10	1.56
16	688798	艾为电子	3,485,285.71	1.54
17	688141	杰华特	3,449,345.81	1.52
18	688326	经纬恒润-W	3,343,456.86	1.48
19	300181	佐力药业	3,338,514.01	1.48
20	301205	联特科技	3,319,257.66	1.47

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	648,870,930.34
卖出股票收入（成交）总额	536,413,249.44

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

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

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

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

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

无。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合

约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

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。

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	4,075,531.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,764,503.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,840,034.42

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	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 (%)
鹏华中证 1000 指数 增强 A	8,124	18,441.54	21,839,655.24	14.58	127,979,396.29	85.42
鹏华中证 1000 指数 增强 C	11,832	16,625.82	47,445,214.76	24.12	149,271,456.98	75.88
鹏华中证 1000 指数 增强 I	40	488.29	0.00	0.00	19,531.77	100.00
合计	19,996	17,331.23	69,284,870.00	19.99	277,270,385.04	80.01

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 （%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	鹏华中证 1000 指数增强 A	320,416.88	0.2139
	鹏华中证 1000 指数增强 C	34,541.99	0.0176
	鹏华中证 1000 指数增强 I	191.15	0.9787
	合计	355,150.02	0.1025

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人 员、基金投资和研 究部门负责人持有本开 放式基金	鹏华中证 1000 指数增强 A	0~10
	鹏华中证 1000 指数增强 C	-
	鹏华中证 1000 指数增强 I	-

	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	鹏华中证 1000 指数增强 A	0~10
	鹏华中证 1000 指数增强 C	—
	鹏华中证 1000 指数增强 I	—
	合计	0~10

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投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华中证 1000 指数增强 A	鹏华中证 1000 指数增强 C	鹏华中证 1000 指数增强 I
基金合同生效 日（2022 年 12 月 26 日） 基金份额总额	167,000,706.79	41,458,941.72	—
本报告期期初 基金份额总额	100,364,309.14	108,139,862.11	10.00
本报告期基金 总申购份额	140,944,816.35	340,551,155.02	65,640.11
减：本报告期 基金总赎回份 额	91,490,073.96	251,974,345.39	46,118.34
本报告期基金 拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末 基金份额总额	149,819,051.53	196,716,671.74	19,531.77

§ 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：  
  
无。  
  
基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：  
  
本报告期内，基金托管人无重大人事变动。



10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
国信证券	2	1,183,854,993.31	100.00	231,960.58	100.00	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称《规定》），基金管理人制定了相应的管理制度规范交易单元选择的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券公司，选择标准包括：财务状况良好，经营行为规范；有完备的合规管理流程和制度，风险控制能力较强；研究、交易等服务能力较强，交易设施能够为投资组合提供有效的交易执行；中国证监会或有权机关规定的其他条件等。

2. 选择程序如下：

- （1）基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；
- （2）基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；
- （3）基金管理人定期对证券公司进行评价，依据评价结果选择交易单元。

3. 根据《规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金

费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率；其他类型基金股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

4. 国泰海通会商并获得上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统、中国结算、各签约存管银行及基金管理公司等相关单位的协同支持，拟定于 2025 年 9 月 12 日的日终清算后，于上述单位实施法人切换、客户及业务迁移合并，将原海通证券的客户及业务迁移合并入国泰海通。截止本报告期末，原租用海通证券、国泰君安的交易单元未完成迁移合并，故本表列示的海通证券、国泰君安数据包含本基金在本报告期内通过原交易单元交易的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

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 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（2025 年第 1 号）	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 02 日
2	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金（A 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 02 日
3	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金（C 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 02 日
4	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金（I 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 02 日
5	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	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 04 日
6	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	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 15 日
7	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 21 日

		站	
8	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	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 08 日
9	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 28 日
10	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	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 12 日
11	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 21 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与招商证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 30 日

§ 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）《鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 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:4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日