

鹏安中证红利指数量型证券投资基金

2025 年第 4 季度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:鹏安基金管理有限公司

基金托管人:恒丰银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 01 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年10月28日起至2025年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 鹏安中证红利指数 |
| 基金主代码 | 025570 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2025 年 10 月 28 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 309,878,225.34 份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成分股及备选成分股的资产比例不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。</p> <p>本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成分股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成分股进行调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> |

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成分股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成分股时，基金管理人可采取包括成分股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成分股流动性严重不足；（3）标的指数的成分股票长期停牌；（4）标的指数成分股进行配股、增发或被吸收合并；（5）标的指数成分股派发现金股息；（6）标的指数成分股定期或临时调整；（7）标的指数编制方法发生变化；（8）其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。

3、存托凭证投资策略

本基金将依照境内上市交易的股票，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选优质上市公司；并最大限度避免由于存托凭证在交易规则、上市公司治理结构等方面的差异而或有的负面影响。

4、债券投资策略

本基金结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

5、可转债和可交债投资策略

本基金将采用专业的分析和计算方法，综合考虑可转债的久期、票面利率、风险等债券因素以及期权价格，力求选择被市场低估的品种，获得超额收益，具体策略包括个券精选策略、条款价值发现策略、套利策略。

本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。

6、衍生品投资策略

（1）股指期货投资策略

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

（2）国债期货投资策略

基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，

| | | |
|-----------------|---|---|
| | <p>力求实现超额回报。</p> <p>7、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过考量宏观经济走势、支持资产所在行业景气情况、资产池结构、提前偿还率、违约率、市场利率等因素，预判资产池未来现金流变动；通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。</p> | |
| 业绩比较基准 | 中证红利指数收益率 \times 95% \times 银行活期存款利率（税后） \times 5% | |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 | |
| 基金管理人 | 鹏安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 恒丰银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 鹏安中证红利指数 A | 鹏安中证红利指数 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 025570 | 025571 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 198,240,752.29 份 | 111,637,473.05 份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 | 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2025 年 10 月 28 日（基金合同生效日）-2025 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|---|----------------|
| | 鹏安中证红利指数 A | 鹏安中证红利指数 C |
| 1. 本期已实现收益 | -3,253,916.88 | -1,913,857.24 |
| 2. 本期利润 | -7,599,475.36 | -4,461,091.27 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0370 | -0.0262 |
| 4. 期末基金资产净值 | 191,075,913.38 | 107,515,247.17 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9639 | 0.9631 |

注：1、本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或者交易基金的各项费用（例如基金申购、赎回、转换等费用），计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏安中证红利指数 A 净值表现

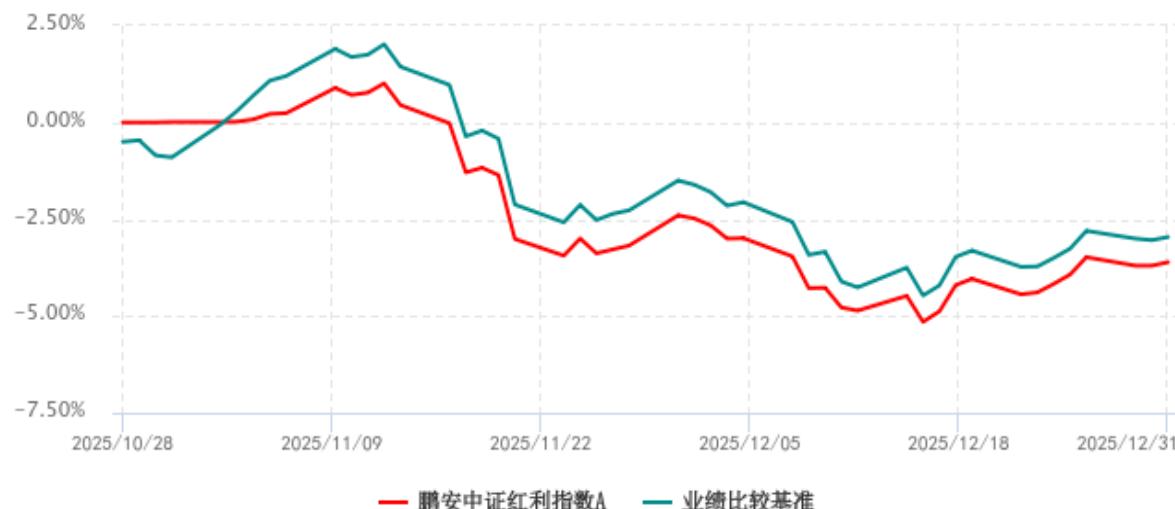
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 自基金合同 生效起至今 | -3.61% | 0.46% | -2.96% | 0.52% | -0.65% | -0.06% |

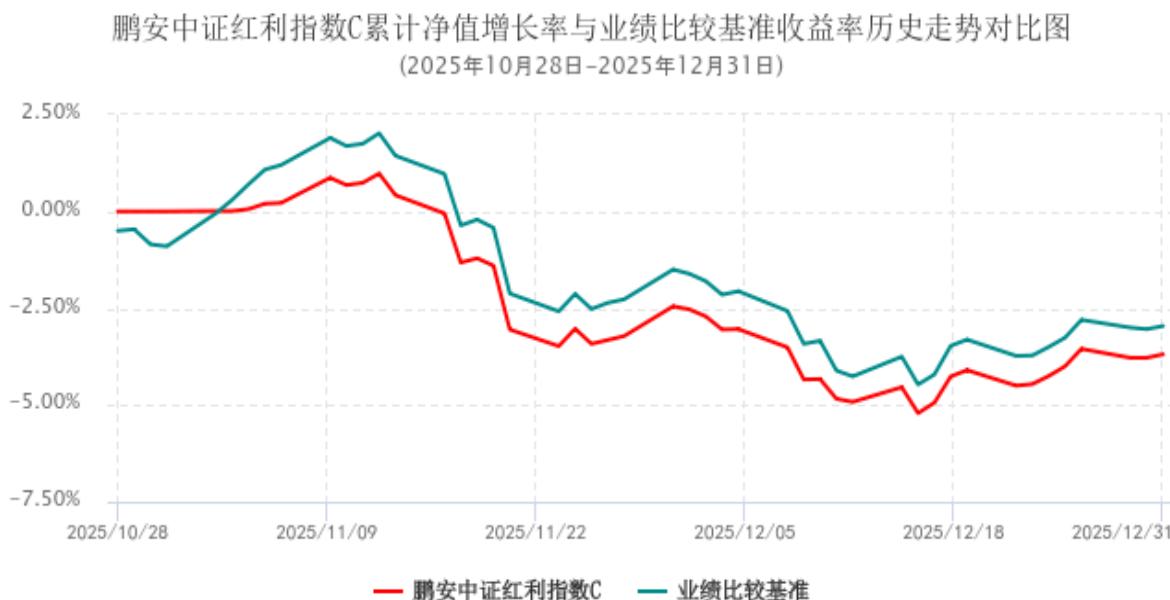
鹏安中证红利指数 C 净值表现

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 自基金合同 生效起至今 | -3.69% | 0.46% | -2.96% | 0.52% | -0.73% | -0.06% |

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

鹏安中证红利指数 A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年10月28日-2025年12月31日)





§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|----------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李云琪 | 本基金的基金经理 | 2025-10-28 | - | 15 年 | 李云琪先生，中国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任摩根士丹利信息技术（上海）有限公司固定收益部分析员、经理；中国国际金融有限公司证券投资部经理、高级经理；中金基金管理有限公司量化公募投资部副总经理；中金睿投投资管理有限公司 |

| | | | | | |
|-----|--------------|------------|---|-----|--|
| | | | | | 副总经理；华 兴证券有限公 司量化投资总 监；开源证券 股份有限公司 资产管理总部 量化投资部负 责人。2024 年 11 月加入 鹏安基金管 理有限公司，任 职于投资部。 自 2025 年 10 月 28 日至 今，担任鹏安 中证红利指数 型证券投资基 金基金经理。 |
| 郑小凡 | 本基金的基金 经理 | 2025-10-28 | - | 5 年 | 郑小凡女士， 中国籍，硕士 研究生，具有 基金从业资 格。曾任开源 证券股份有限 公司资产管理 总部权益研究 员、投资经 理。2024 年 6 月加入鹏安 基金管理有限 公司，任职于 投资部。自 2025 年 10 月 28 日至今， 担任鹏安中证 红利指数型证 券投资基金基 金经理。 |

- 注：1. “任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“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的相关规定。
3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及有关法规，建立公司内部的公平交易管理制度体系，从研究分析、投资决策、交易执行、事后稽核等环节进行严格规范，通过系统和人工相结合的方式在投资管理活动各环节贯彻和执行公平交易管理制度，以确保公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，防范不公平交易和利益输送行为。

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司公平交易管理的相关制度等的有关规定，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发生本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%的情形，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，市场在四季度呈现波动上行态势，风格趋于均衡，由单边成长切换为“价值、成长、顺周期”并行驱动的均衡结构。10 月中上旬市场短暂承压，下旬迅速修复，成长风格领涨；11 月风格再度平衡，红利与材料板块表现相对占优；12 月指数震荡回升，成交维持高位。2025 年年末上证综指收于 3968.84 点，全年累计上涨 18.41%，各主要指数年度均实现正收益。

从 2025 年第四季度宏观经济情况来看，通胀仍处于平缓上行阶段：政策保持适度宽松，CPI 温和回升，同比增速在 10 月由负转正至 0.2%、11 月升至 0.7%，核心 CPI 稳定在 1.2%；10-11 月 PPI 同比为-2.1% 和 -2.2%，降幅略有扩大，反映出反内卷治理与供给端优化仍需时间；展望 2026 年，经济环境有望进入“稳增长+低通胀温和回升”阶段：积极的财政政策、适度宽松的货币政策、价格回暖与盈利修复将共同推动 A 股从“估值驱动”转向“盈利驱动”，需重点关注全 A 净利润增速拐点及财政政策的发力节奏。

本基金为被动指数基金，投资目标是跟踪中证红利指数。根据基金合同约定，主要投资策略为复制中证红利指数的成分股权重和行业配置，并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。报告期内，本基金在不显著影响市场走势的前提下，较快完成了建仓，实现了对中证红利指数的有效跟踪。基金管理人将继续采用指数化投资策略，紧密跟踪基准指数，在严格控制日均跟踪偏离度和年化跟踪误差的前提下，获取业绩基准相似的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末鹏安中证红利指数 A 基金份额净值为 0.9639 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.61%，同期业绩比较基准收益率为-2.96%；截至报告期末鹏安中证红利指数 C 基金份额净值为 0.9631 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.69%，同期业绩比较基准收益率为-2.96%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 281,934,619.54 | 93.86 |
| | 其中：股票 | — | 93.86 |
| 2 | 基金投资 | — | — |
| 3 | 固定收益投资 | 11,153,337.67 | 3.71 |
| | 其中：债券 | 11,153,337.67 | 3.71 |
| | 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 | 7,276,428.49 | 2.42 |
| 8 | 其他资产 | 228.17 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 300,364,613.87 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 57,327,375.00 | 19.20 |

| | | | |
|---|------------------|----------------|-------|
| C | 制造业 | 75,677,198.59 | 25.34 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,141,492.00 | 1.72 |
| E | 建筑业 | 8,200,452.00 | 2.75 |
| F | 批发和零售业 | 10,577,447.00 | 3.54 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 29,666,668.00 | 9.94 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 70,084,824.00 | 23.47 |
| K | 房地产业 | 2,577,960.00 | 0.86 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,363,448.00 | 0.79 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,847,000.00 | 0.95 |
| 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 | 11,285,672.00 | 3.78 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 275,749,536.59 | 92.35 |

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 6,183,394.95 | 2.07 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 1,688.00 | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|--------------|------|
| M | 科学和技术服务业 | - | - |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 6,185,082.95 | 2.07 |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 601919 | 中远海控 | 552,400 | 8,385,432.00 | 2.81 |
| 2 | 600256 | 广汇能源 | 956,900 | 4,707,948.00 | 1.58 |
| 3 | 600546 | 山煤国际 | 406,900 | 4,105,621.00 | 1.37 |
| 4 | 601328 | 交通银行 | 561,400 | 4,070,150.00 | 1.36 |
| 5 | 601666 | 平煤股份 | 516,600 | 4,065,642.00 | 1.36 |
| 6 | 603565 | 中谷物流 | 404,500 | 4,061,180.00 | 1.36 |
| 7 | 600295 | 鄂尔多斯 | 322,100 | 3,981,156.00 | 1.33 |
| 8 | 601699 | 潞安环能 | 334,000 | 3,941,200.00 | 1.32 |
| 9 | 000983 | 山西焦煤 | 579,000 | 3,717,180.00 | 1.24 |
| 10 | 000408 | 藏格矿业 | 44,000 | 3,713,600.00 | 1.24 |

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

| 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 | 688472 | 阿特斯 | 52,296 | 779,733.36 | 0.26 |
| 2 | 688563 | 航材股份 | 12,574 | 734,950.30 | 0.25 |
| 3 | 688548 | 广钢气体 | 42,534 | 618,444.36 | 0.21 |
| 4 | 688550 | 瑞联新材 | 13,359 | 605,296.29 | 0.20 |
| 5 | 688819 | 天能股份 | 17,801 | 591,349.22 | 0.20 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 11,153,337.67 | 3.74 |

| | | | |
|----|-----------|---------------|------|
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 11,153,337.67 | 3.74 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 019785 | 25 国债 13 | 60,000 | 6,036,180.82 | 2.02 |
| 2 | 019792 | 25 国债 19 | 50,000 | 5,016,145.21 | 1.68 |
| 3 | 019773 | 25 国债 08 | 1,000 | 101,011.64 | 0.03 |

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好的跟踪标的指数。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 本期国债期货投资评价

基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

1. 交通银行（证券代码 601328.SH）

根据中国人民银行 2025 年 12 月 19 日相关行政处罚公示，该证券发行人因违反账户管理规定等多项违法行为受到中国人民银行的处罚。

2. 潞安环能（证券代码 601699.SH）

根据 2025 年 8 月 6 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被山西证监局出具警示函。

3. 中谷物流（证券代码 603565.SH）

根据 2025 年 5 月 22 日发布的相关公告，该证券发行人因涉嫌违反法律法规被浦东海事局处以罚款。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金的主要策略为复制中证红利指数的成分股权重和行业配置，上述主体所发行的证券为标的指数成分股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规和公司制度的规定。除上述证券，本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 228.17 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 228.17 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 鹏安中证红利指数 A | 鹏安中证红利指数 C |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2025 年 10 月 28 日）基金份额总额 | 211,410,265.70 | 489,114,349.28 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 35,620,340.25 | 10,591,656.93 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 48,789,853.66 | 388,068,533.16 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 198,240,752.29 | 111,637,473.05 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--------|----------------|---------------------------|--------------------|------|--------------------|------------|-------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20251028 — 20251103 | 207,006, 899.99 | 0 | 207,006, 899.99 | 0.00 | 0.00% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金在本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予鹏安中证红利指数型证券投资基金注册的文件;
2. 《鹏安中证红利指数型证券投资基金基金合同》;
3. 《鹏安中证红利指数型证券投资基金托管协议》;
4. 《鹏安中证红利指数型证券投资基金招募说明书》;
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照;
6. 中国证监会规定的其他文件。

9.2 存放地点

鹏安基金管理有限公司

地址：海南省海口市美兰区国兴大道 15A 号全球贸易之窗 16 楼。

9.3 查阅方式

上述文件可在鹏安基金管理有限公司互联网站上查询，或者在营业时间内到鹏安基金管理有限公司。

公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏安基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-814-2888

网址：www.penganfunds.com

鹏安基金管理有限公司

二〇二六年一月二十一日