

鹏华中证银行指数量型证券投资基金(LOF)

2025年第4季度报告

2025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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2026年1月21日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年01月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年10月01日起至2025年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 鹏华中证银行指数(LOF) |
| 场内简称 | 银行LOF基金 |
| 基金主代码 | 160631 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式(LOF) |
| 基金合同生效日 | 2015年4月17日 |
| 报告期末基金份额总额 | 315,910,151.00份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。 |
| 投资策略 | <p>本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>本基金力争基金份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> |

| | |
|--|--|
| | <p>1、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p> <p>本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>(2) 股票投资组合的调整</p> <p>本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，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，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。</p> <p>1) 定期调整</p> <p>根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；</p> <p>根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；</p> <p>根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金可以根据流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。</p> <p>3、衍生品投资策略</p> <p>本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整</p> |
|--|--|

| | |
|-------------|--|
| | 的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。 4、参与融资及转融通证券出借业务策略 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。 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。 |
| 业绩比较基准 | 中证银行指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 |
| 基金管理人 | 鹏华基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 下属分级基金的基金简称 | 鹏华中证银行指数(LOF) I 鹏华中证银行指数(LOF) A 鹏华中证银行指数(LOF) C |
| 下属分级基金的场内简称 | 银行LOF 银行A 银行C |
| 下属分级基金的交易代码 | 1601 025130 |

| | | |
|-----------------|--------------------------|------------|
| | 0620 3142 | |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 23805,447218,447764.256份 | 10,200.19份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 风险收益特征同上 | 风险收益特征同上 |

注：无。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2025年10月1日-2025年12月31日） | | |
|----------------|-----------------------------|---------------------|---------------------|
| | 鹏华中证银行指数 (LOF) A | 鹏华中证银行指数 (LOF) C | 鹏华中证银行指数 (LOF) I |
| 1.本期已实现收益 | 12,191,019.35 | 1,417,301.39 | 1,630.13 |
| 2.本期利润 | 22,424,536.24 | 3,669,215.22 | 569.49 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0757 | 0.0974 | 0.0109 |
| 4.期末基金资产净值 | 396,852,293.84 | 41,145,400.37 | 9,672.67 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.3904 | 1.3503 | 0.9483 |

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣

除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等未实现收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华中证银行指数(LOF)A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 5.57% | 0.79% | 5.04% | 0.79% | 0.53% | 0.00% |
| 过去六个月 | -3.41% | 0.83% | -5.18% | 0.84% | 1.77% | -0.01% |
| 过去一年 | 10.38% | 0.90% | 6.52% | 0.91% | 3.86% | -0.01% |
| 过去三年 | 49.67% | 0.98% | 31.81% | 0.98% | 17.86% | 0.00% |
| 过去五年 | 43.64% | 1.06% | 15.97% | 1.07% | 27.67% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 59.87% | 1.21% | 12.38% | 1.21% | 47.49% | 0.00% |

鹏华中证银行指数(LOF)C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 5.54% | 0.79% | 5.04% | 0.79% | 0.50% | 0.00% |
| 过去六个月 | -3.46% | 0.83% | -5.18% | 0.84% | 1.72% | -0.01% |
| 过去一年 | 10.28% | 0.90% | 6.52% | 0.91% | 3.76% | -0.01% |
| 过去三年 | 49.20% | 0.98% | 31.81% | 0.98% | 17.39% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 35.03% | 1.03% | 8.34% | 1.04% | 26.69% | -0.01% |

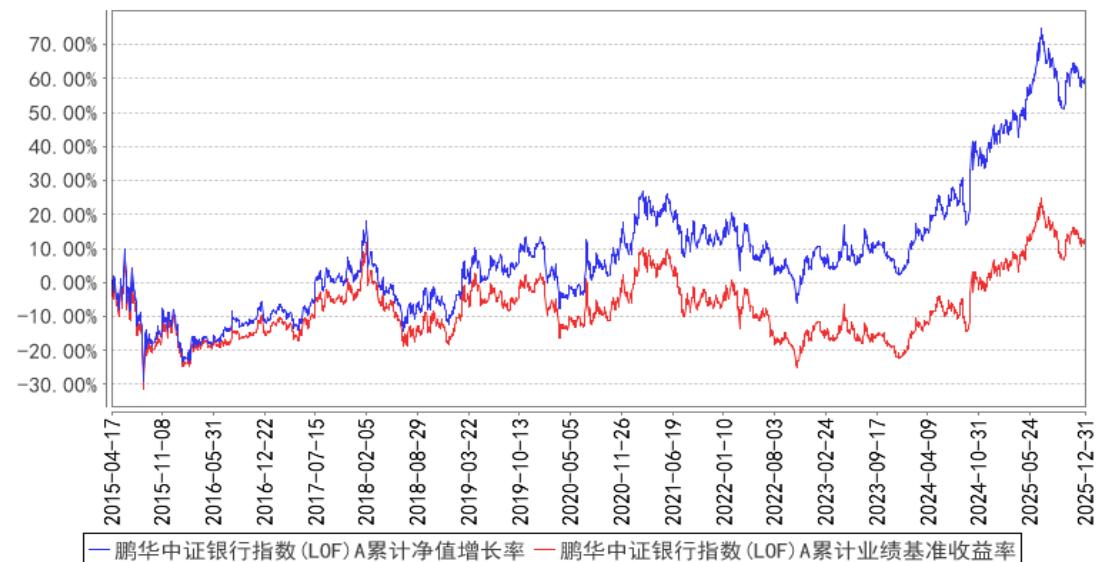
鹏华中证银行指数(LOF)I

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 5.57% | 0.79% | 5.04% | 0.79% | 0.53% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | -5.17% | 0.83% | -5.91% | 0.83% | 0.74% | 0.00% |

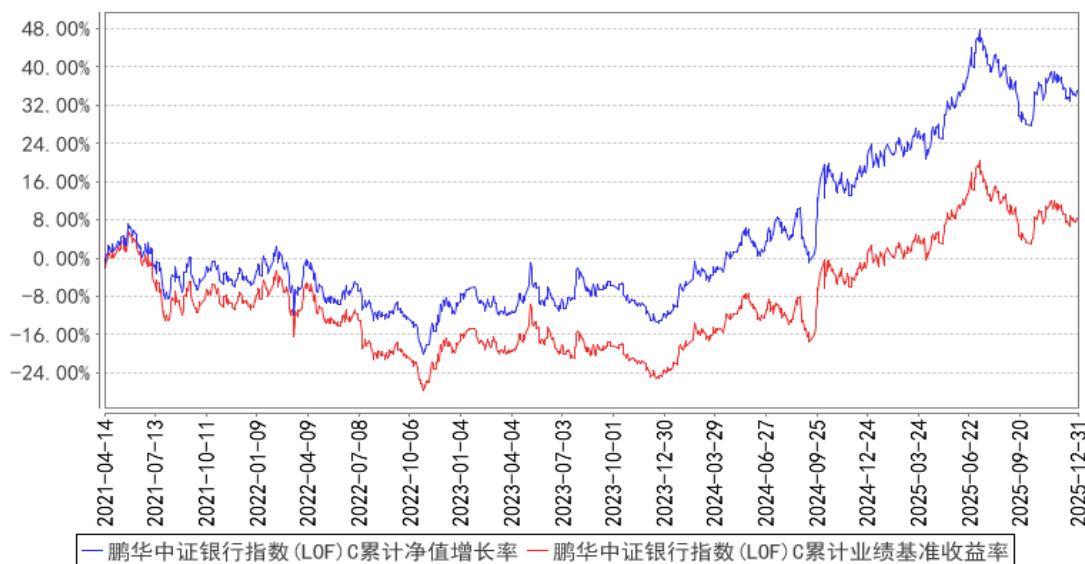
注：业绩比较基准=中证银行指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

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

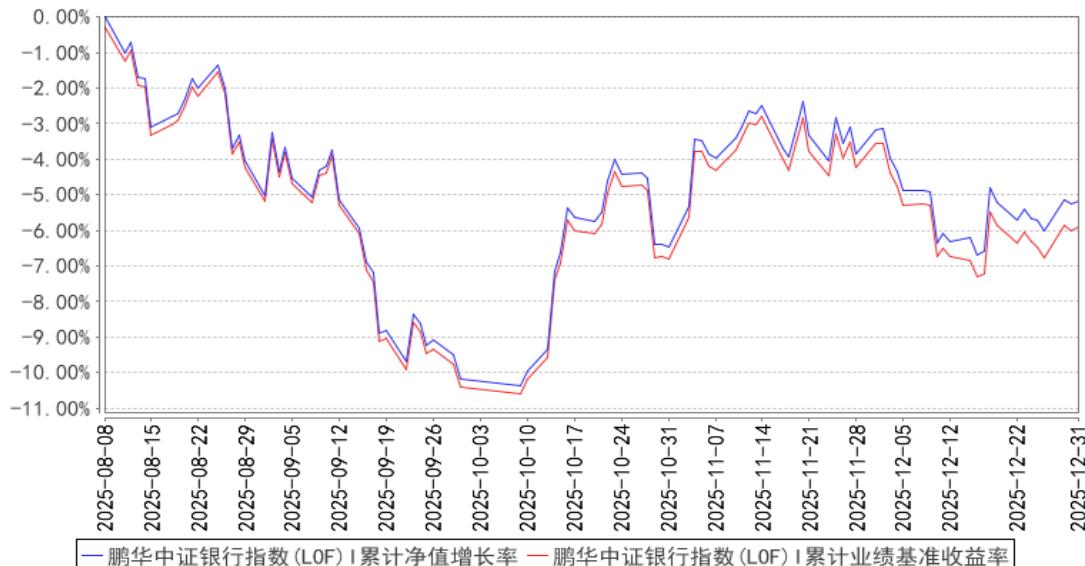
鹏华中证银行指数(LOF)A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华中证银行指数(LOF)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



鹏华中证银行指数(LOF)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 2015 年 04 月 17 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|------|--------|----|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|----------|------------|---|----|---|
| | | | | | 余展昌先生，国籍中国，金融硕士，8年证券从业经验。2017年7月加盟鹏华基金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部量化研究员、高级量化研究员，2020年8月至2022年10月担任量化及衍生品投资部投资经理，现担任指数与量化投资部总经理助理/基金经理。2022年10月至今担任鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金管理人，2022年10月至今担任鹏华中证800证券保险交易型开放式指数证券投资基金管理人，2022年10月至今担任鹏华中证800证券保险指数型证券投资基金(LOF)基金经理，2022年10月至今担任鹏华中证全指证券公司指数型证券投资基金(LOF)基金经理，2022年10月至今担任鹏华中证银行交易型开放式指数证券投资基金管理人，2022年10月至今担任鹏华中证银行指数型证券投资基金(LOF)基金经理，2023年08月至今担任鹏华创业板指数型证券投资基金(LOF)基金经理，2023年08月至今担任鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)基金经理，2024年04月至今担任鹏华恒生中国央企交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理，2024年11月至今担任鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金管理人，2024年12月至今担任鹏华上证180交易型开放式指数证券投资基金管理人，2024年12月至2025年01月担任鹏华中证A500指数证券投资基金基金经理，2025年01月至今担任鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025年01月至2025年03月担任鹏华上证180指数发起式证券投资基金基金经理，2025年01月至今担任鹏华恒生港股通高股息率指数发起式证券投资基金基金经理，2025年02月至今担任鹏华上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025年03月至今担任鹏华恒生中国央企交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2025年03月至今担任鹏华上证180交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2025年05月至 |
| 余展昌 | 本基金的基金经理 | 2022-10-15 | - | 8年 | |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | 今担任鹏华上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025年07月至今担任鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025年09月至今担任鹏华标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理，余展昌先生具备基金从业资格。 |
|--|--|--|--|---|

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

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

作为主题指数基金，本基金旨在为看好该主题的投资者提供投资工具。报告期内，本基金秉承指数基金的投资策略，力争跟踪指数的收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。跟踪误差的主要来源主要分为几个方面，包括成分股的调整、日常申赎的交易影响、股票的分红、风险

股票的处置、股票的打新等。为了进一步控制跟踪误差，鹏华基金建立了一套完备的指数跟踪机制，事前对成分股的异动进行密切跟踪，及时调整，在交易环节采用算法交易等方式进一步减少交易冲击成本和摩擦，在仓位控制上，基金经理在紧密跟踪指数的基础上，也会针对客户申赎的情况做优化调整。

中证银行指数在2025年四季度取得了正收益，在经过三季度风格因素导致的调整后，由于四季度市场风险偏好有所下行，具体表现为指数冲高回落、成交量有所萎缩，风格重新切向了红利板块。叠加12月底银行的分红预期，所以资金对红利板块增加了配置，行情有所修复。但银行板块内部分化严重，拨备高、不良低、经营稳定的个股表现占优，仍然走的是利率下行下资金追求确定性分红的逻辑。

展望后市，银行板块的上涨仍得靠资金的推动。保险公司2026年开门红业绩亮眼，新增保费仍会流入权益市场，其中部分资金或会继续配置高股息有性价比的银行标的。

4.5 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5.57%，同期业绩比较基准增长率为5.04%；C类份额净值增长率为5.54%，同期业绩比较基准增长率为5.04%；I类份额净值增长率为5.57%，同期业绩比较基准增长率为5.04%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 415,639,735.57 | 94.17 |
| | 其中：股票 | 415,639,735.57 | 94.17 |
| 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 | 25,172,057.29 | 5.70 |

| | | | |
|---|------|----------------|--------|
| 8 | 其他资产 | 568,918.93 | 0.13 |
| 9 | 合计 | 441,380,711.79 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | - | - |
| 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 | 415,601,323.00 | 94.88 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 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 | 415,601,323.00 | 94.88 |

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 | 38,412.57 | 0.01 |
| 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 | | |
| L | 租赁和商务服务业 | | |
| M | 科学、研究和技术服务业 | | |
| 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 | 38,412.57 | 0.01 |

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：无。

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 | 600036 | 招商银行 | 1,453,269 | 61,182,624.90 | 13.97 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 2,167,581 | 45,649,255.86 | 10.42 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 4,142,143 | 32,847,193.99 | 7.50 |
| 4 | 601288 | 农业银行 | 3,678,479 | 28,250,718.72 | 6.45 |
| 5 | 601328 | 交通银行 | 3,415,254 | 24,760,591.50 | 5.65 |
| 6 | 600000 | 浦发银行 | 1,705,682 | 21,218,684.08 | 4.84 |
| 7 | 600919 | 江苏银行 | 1,879,675 | 19,548,620.00 | 4.46 |
| 8 | 000001 | 平安银行 | 1,242,268 | 14,174,277.88 | 3.24 |
| 9 | 601229 | 上海银行 | 1,273,473 | 12,862,077.30 | 2.94 |
| 10 | 600016 | 民生银行 | 3,178,159 | 12,172,348.97 | 2.78 |

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

| 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 | 603175 | 超颖电子 | 169 | 8,206.64 | 0.00 |
| 2 | 603418 | 友升股份 | 111 | 6,555.66 | 0.00 |
| 3 | 601026 | 道生天合 | 451 | 6,440.28 | 0.00 |
| 4 | 603406 | 天富龙 | 153 | 6,144.48 | 0.00 |
| 5 | 603262 | 技源集团 | 155 | 4,355.50 | 0.00 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

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

注：无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

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

交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行的处罚。

平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局上海监管局的处罚。

上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局上海市分局的处罚。

兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局宁波监管局的处罚。

中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 34,860.88 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 534,058.05 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 568,918.93 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 603175 | 超颖电子 | 8,206.64 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 2 | 603418 | 友升股份 | 6,555.66 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 3 | 601026 | 道生天合 | 6,440.28 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 4 | 603406 | 天富龙 | 6,144.48 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 5 | 603262 | 技源集团 | 4,355.50 | 0.00 | 新股流通受限 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 鹏华中证银行指数(LOF)A | 鹏华中证银行指 数(LOF)C | 鹏华中证银行 指数(LOF)I |
|---------------------------|----------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 301,573,651.73 | 42,558,038.63 | 31,616.13 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 27,447,798.81 | 64,995,550.20 | 105,682.45 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 43,592,976.28 | 77,082,112.28 | 127,098.39 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 285,428,474.26 | 30,471,476.55 | 10,200.19 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华中证银行指数量型证券投资基金(LOF)基金合同》;
- (二) 《鹏华中证银行指数量型证券投资基金(LOF)托管协议》;
- (三) 《鹏华中证银行指数量型证券投资基金(LOF)2025年第4季度报告》(原文)。

9.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站 (<http://www.phfund.com.cn>) 查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司

2026年1月21日