

鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告

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：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	11
3.3 其他指标	15
3.4 过去三年基金的利润分配情况	15
§ 4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
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	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	21
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	22
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	22
§ 5 托管人报告	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	22
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	22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	22
§ 6 审计报告	22
6.1 审计报告基本信息	22
6.2 审计报告的基本内容	22
§ 7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表	24
7.2 利润表	26
7.3 净资产变动表	27
7.4 报表附注	29
§ 8 投资组合报告	62

8.1 期末基金资产组合情况	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	94
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	94
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	94
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	94
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	94
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	94
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	95
8.12 投资组合报告附注	95
§ 9 基金份额持有人信息	96
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	96
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	96
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	96
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	97
§ 10 开放式基金份额变动	97
§ 11 重大事件揭示	97
11.1 基金份额持有人大会决议	97
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	97
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	98
11.4 基金投资策略的改变	98
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	98
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	98
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	98
11.8 其他重大事件	99
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	102
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	102
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	102
§ 13 备查文件目录	103
13.1 备查文件目录	103
13.2 存放地点	103
13.3 查阅方式	103

§ 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	1,667,849,720.99 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	815,882,604.25 份	851,235,922.07 份	731,194.67 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。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	4006788533	400-61-95555	
传真	0755-82021126	0755-83195201	
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
邮政编码	518048	518040	
法定代表人	张纳沙	缪建民	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2024 年 12 月 11 日	2023 年
			(基金合同生效日)	
			-	

						2024年12月31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	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	鹏华中证 1000 指数增强 A	鹏华中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	149,809,276.23	173,115,711.94	33,119.91	5,154,548.59	4,521,096.43	0.26	6,648,247.11	-2,780,144.90
本期利润	142,879,264.30	175,394,918.97	47,589.73	11,019,182.01	13,304,362.03	-0.08	2,496,028.25	-1,517,193.53
加权平均基金份额本期利润	0.3803	0.4223	0.4421	0.0833	0.0730	-0.0080	-0.0178	-0.0217
本期	26.10%	29.56%	32.61%	8.91%	7.87%	-0.7%	-1.74%	-2.14%

加权平均净值利润率						9%		
本期基金份额净值增长率	44.25%	43.68%	44.32%	10.59%	10.14%	-0.80%	-1.48%	-1.87%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末			2024 年末			2023 年末	
期末可供分配利润	464,070,786.84	468,985,149.22	276,848.53	8,983,183.53	8,723,874.16	-0.08	-2,511,499.83	-3,659,582.69
期末可供分配基	0.5688	0.5509	0.3786	0.0895	0.0807	-0.0080	-0.0148	-0.0188

金 份 额 利 润								
期 末 基 金 资 产 净 值	1,282,214,856.90	1,321,692,163.50	1,046,839.55	109,347,492.67	116,863,736.27	9.92	167,298,143.51	190,685,861.34
期 末 基 金 份 额 净 值	1.5716	1.5527	1.4317	1.0895	1.0807	0.9920	0.9852	0.9812
3.1.3 累计期末指标	2025 年末			2024 年末			2023 年末	
基 金 份 额 累 计 净 值 增 长 率	57.16%	55.27%	43.17%	8.95%	8.07%	-0.80%	-1.48%	-1.88%

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

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

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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
过去三个月	1.02%	1.03%	0.28%	1.07%	0.74%	-0.04%
过去六个月	24.35%	1.01%	18.49%	1.06%	5.86%	-0.05%
过去一年	44.25%	1.31%	26.12%	1.32%	18.13%	-0.01%
过去三年	57.16%	1.43%	20.34%	1.48%	36.82%	-0.05%
自基金合同生效起至今	57.16%	1.43%	22.59%	1.48%	34.57%	-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
过去三个月	0.92%	1.03%	0.28%	1.07%	0.64%	-0.04%
过去六个月	24.10%	1.01%	18.49%	1.06%	5.61%	-0.05%
过去一年	43.68%	1.31%	26.12%	1.32%	17.56%	-0.01%
过去三年	55.29%	1.43%	20.34%	1.48%	34.95%	-0.05%
自基金合同生效起至今	55.27%	1.43%	22.59%	1.48%	32.68%	-0.05%

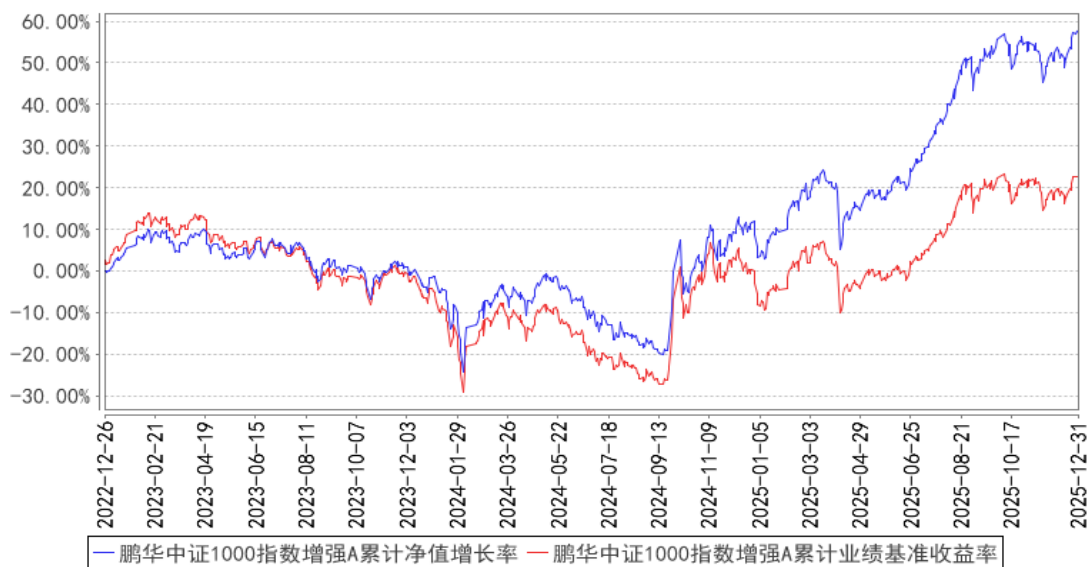
鹏华中证 1000 指数增强 I

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
过去三个月	0.99%	1.03%	0.28%	1.07%	0.71%	-0.04%
过去六个月	24.28%	1.01%	18.49%	1.06%	5.79%	-0.05%
过去一年	44.32%	1.31%	26.12%	1.32%	18.20%	-0.01%
自基金合同生效 起至今	43.17%	1.31%	21.51%	1.33%	21.66%	-0.02%

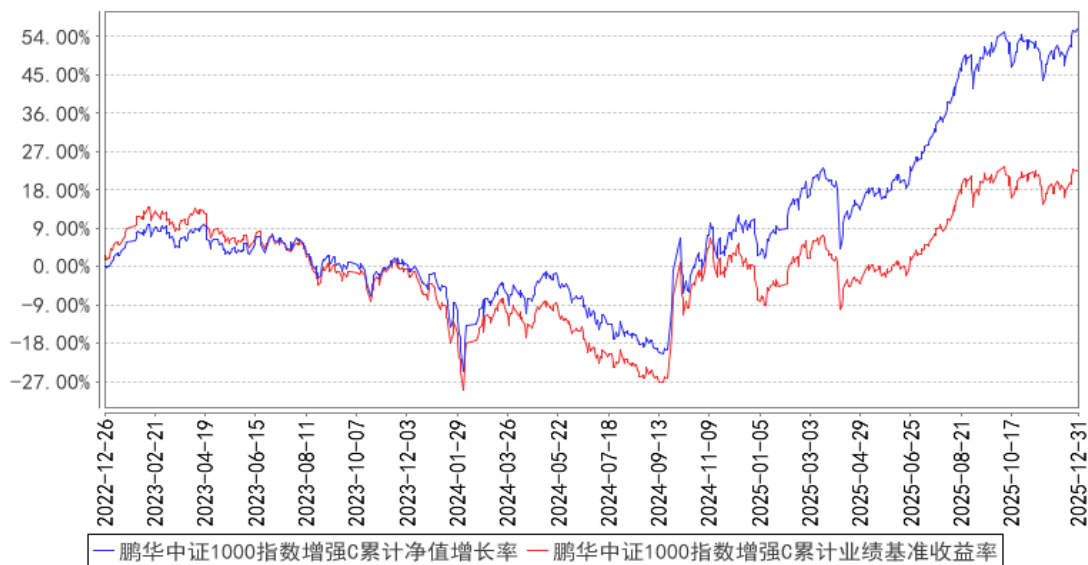
注：业绩比较基准=中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。鹏华中证 1000 指数增强 I 基金份额的首次确认日为 2024 年 12 月 19 日。

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

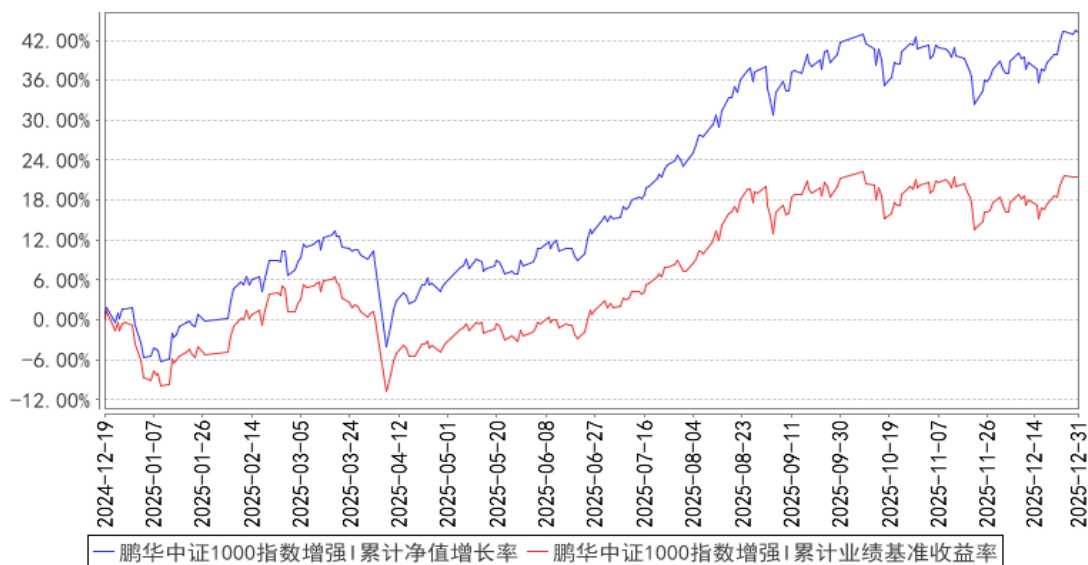
鹏华中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

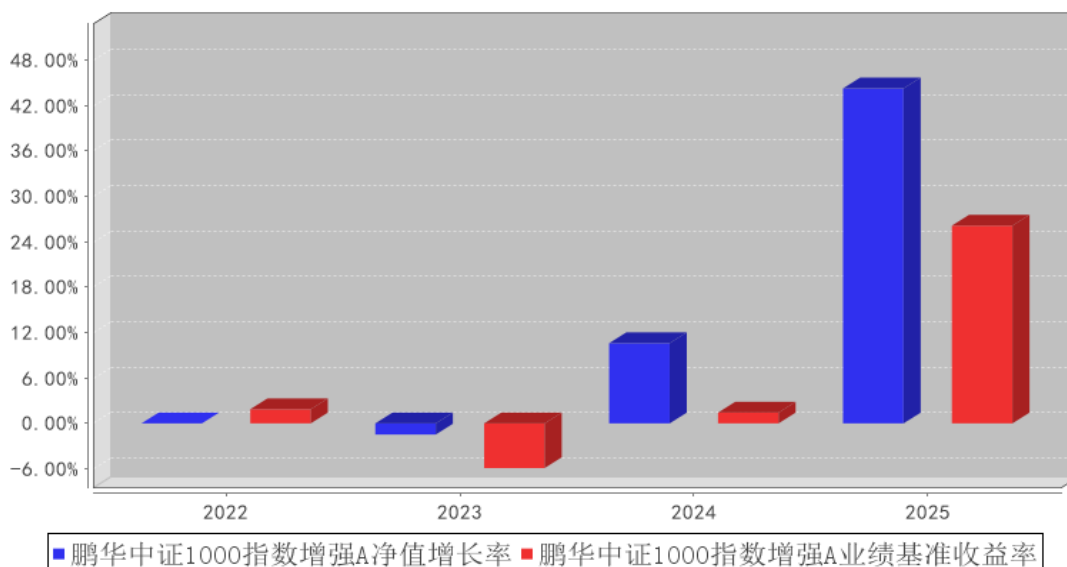


注：1、本基金基金合同于 2022 年 12 月 26 日生效。

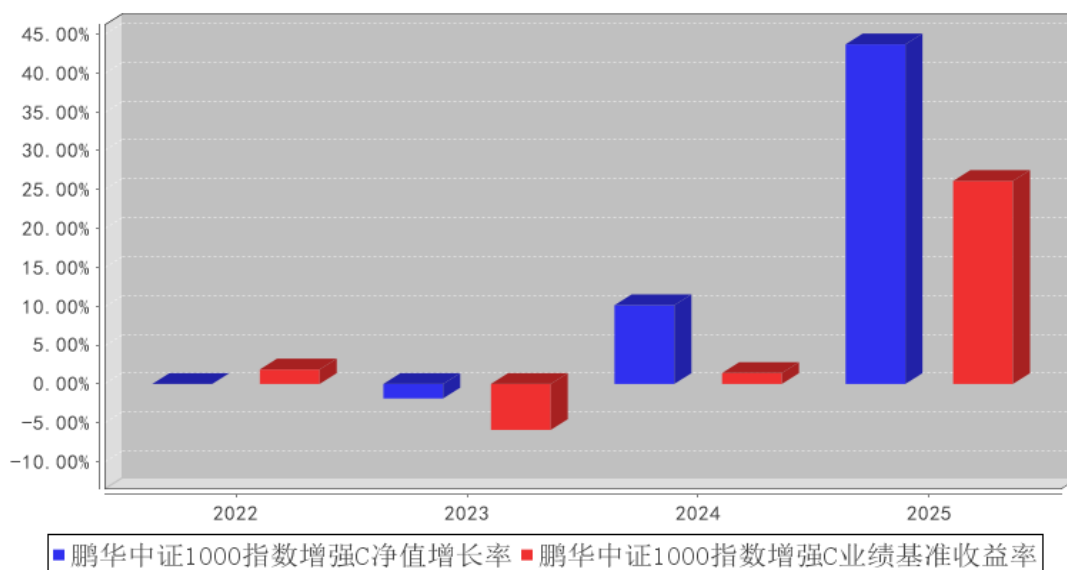
2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。鹏华中证 1000 指数增强 I 基金份额的首次确认日为 2024 年 12 月 19 日。

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

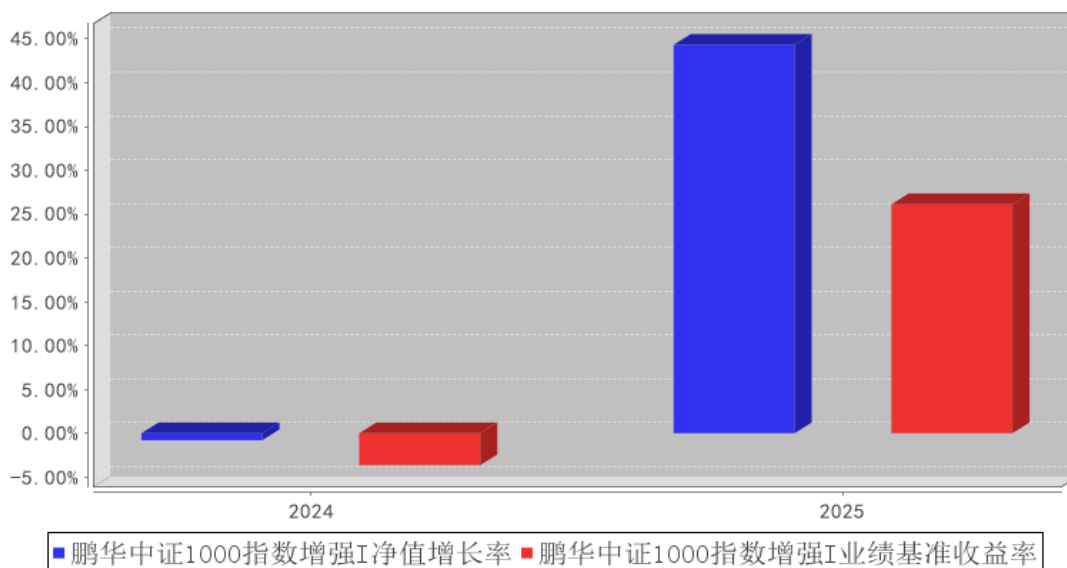
鹏华中证1000指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



鹏华中证1000指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



鹏华中证1000指数增强I基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模为 13,677 亿元，公司管理着 387 只公募基金，20 只社保基金、养老基金及划转资本组合。历经二十余年基金投资管理实践，公司在基金投资运作、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏俊	本基金的	2022-12-	-	13 年	苏俊杰先生, 国籍中国, 理学硕士, 13 年

杰	基金经理	26		<p>证券从业经验。曾任 MSCI INC. 分析师，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 2025 年 08 月担任鹏华中证 800</p>
---	------	----	--	--

					交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 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，2025 年 10 月至今担任鹏华上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 11 月至今担任鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，苏俊杰先生具备基金从业资格。
时赞超	本基金的基金经理	2024-12-28	-	7 年	时赞超先生，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。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，2025 年 07 月至今担任鹏华创兴增利债券型证券投资基金基金经理，2025 年 08 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 11 月至今担任鹏华中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 100 指数增强型证券投资基金基金经理，时赞超先生具备基金从业资格。

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理，不涉及基金经理薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

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 公平交易制度和控制方法

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

在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。

在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令

价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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。

近年来，市场结构化行情加剧，这对管理人的选股能力和超额回撤控制能力提出了更高要求。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 44.25%，同期业绩比较基准增长率为 26.12%；C 类份额净值增长率为 43.68%，同期业绩比较基准增长率为 26.12%；I 类份额净值增长率为 44.32%，同期业绩比较基准增长率为 26.12%。

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，市场呈现“一波三折”的结构性行情。年初市场受国产 AI 热潮影响，叠加地方“两会”密集召开，开年短暂调整后逐步走强；年中虽受关税短暂扰动，消费复苏相对乏力，但在政策红利与产业利好集中释放下快速上涨；年末市场转入高位震荡格局，两融余额创历史新高，并在年内实现了较为可观的涨幅。全年风格呈现“成长与价值交替”，创业板指与小盘成长领涨，政策驱动与产业趋势共同主导结构性分化，大盘及消费板块相对落后。

展望 2026 年，市场核心矛盾继续转向盈利驱动，政策加码与流动性充裕提供支撑。国内聚焦新质生产力落地，海外美联储降息预期趋向谨慎，科技制造与能源转型双线并行。资金层面中长期资金持续增配，推动风格从成长转向均衡，但需警惕地缘政治风险及政策效果滞后风险。短期关注受益于供需格局改善的部分周期板块，中期关注周期和科技板块。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

1、继续完善内部控制体系

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

2、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

报告期内，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《公开募集证

券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

3、开展以风险为导向的内部稽核

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，鹏华中证 1000 指数增强 A 期末可供分配利润为 464,070,786.84 元，期末基金份额净值 1.5716 元；鹏华中证 1000 指数增强 C 期末可供分配利润为 468,985,149.22 元，期末基金份额净值 1.5527 元；鹏华中证 1000 指数增强 I 期末可供分配利润为 276,848.53 元，期末基金份额净值 1.4317 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(26)第 P02441 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了鹏华中证 1000 指数

	增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

	<p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	江丽雅 林婷婷
会计师事务所的地址	中国上海市
审计报告日期	2026 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	318,711,690.80	27,459,193.61
结算备付金		17,853,818.90	-

存出保证金		17,666,472.00	-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,288,867,117.58	212,551,185.56
其中：股票投资		2,288,867,117.58	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		48,309,704.99	2,197,084.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		2,691,408,804.27	242,207,463.90
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2025年12月31日	2024年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		83,302,343.67	15,595,167.38
应付管理人报酬		1,796,367.27	164,651.05
应付托管费		336,818.87	30,872.06
应付销售服务费		417,661.94	45,534.55
应付投资顾问费		-	-
应交税费		431,750.22	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	170,002.35	160,000.00
负债合计		86,454,944.32	15,996,225.04
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	1,667,849,720.99	208,504,181.25
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	937,104,138.96	17,707,057.61

净资产合计		2,604,953,859.95	226,211,238.86
负债和净资产总计		2,691,408,804.27	242,207,463.90

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额为 1,667,849,720.99 份，其中鹏华中证 1000 指数增强 A 基金份额总额为 815,882,604.25 份，基金份额净值 1.5716 元；鹏华中证 1000 指数增强 C 基金份额总额为 851,235,922.07 份，基金份额净值 1.5527 元；鹏华中证 1000 指数增强 I 基金份额总额为 731,194.67 份，基金份额净值 1.4317 元。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		331,646,504.64	27,952,489.20
1. 利息收入		393,965.31	63,532.68
其中：存款利息收入	7.4.7.13	393,965.31	63,532.68
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）		332,713,887.97	13,075,952.85
其中：股票投资收益	7.4.7.14	309,883,715.22	7,920,913.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券 投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收 益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	13,817,072.88	-
股利收益	7.4.7.19	9,013,099.87	5,155,039.24
以摊余成本计 量的金融资产终止确 认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	7.4.7.20	-4,607,604.51	14,647,898.68

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	3,146,255.87	165,104.99
减：二、营业总支出		13,324,731.64	3,628,945.24
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	9,026,217.15	2,345,388.05
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,692,415.70	439,760.24
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,349,221.93	676,286.27
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		78,530.75	-
8. 其他费用	7.4.7.23	178,346.11	167,510.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		318,321,773.00	24,323,543.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		318,321,773.00	24,323,543.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		318,321,773.00	24,323,543.96

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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	1,459,345,539.	-	919,397,081.35	2,378,742,621.0

动额(减少以“-”号填列)	74			9
(一)、综合收益总额	-	-	318,321,773.00	318,321,773.00
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,459,345,539.74	-	601,075,308.35	2,060,420,848.09
其中：1. 基金申购款	4,381,407,097.04	-	1,921,229,200.24	6,302,636,297.28
2. 基金赎回款	2,922,061,557.30	-	1,320,153,891.89	4,242,215,449.19
(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	1,667,849,720.99	-	937,104,138.96	2,604,953,859.95
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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)	155,650,906.12	-	23,878,140.13	-131,772,765.99

(一)、综合收益总额	-	-	24,323,543.96	24,323,543.96
(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)	-	-	-445,403.83	-156,096,309.95
其中：1. 基金申购款	155,650,906.12			
2. 基金赎回款	481,493,944.16	-	-26,564,583.29	454,929,360.87
	-	-	26,119,179.46	-611,025,670.82
(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	208,504,181.25	-	17,707,057.61	226,211,238.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

聂连杰

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金

融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

- (1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税(和/或)股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利

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

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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》、财税[2025] 4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,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,对金融同业往来利息收入亦免征增值税;自2025年8月8日起,对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入,恢复征收增值税,对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、

金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	46,125,948.72	18,823,744.28
等于：本金	46,117,690.98	18,822,861.67
加：应计利息	8,257.74	882.61
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	272,585,742.08	8,635,449.33
等于：本金	272,570,805.78	8,634,992.01
加：应计利息	14,936.30	457.32
减：坏账准备	-	-
合计	318,711,690.80	27,459,193.61

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,294,503,713.03	-	2,288,867,117.58	-5,636,595.45
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	2,294,503,713.03	-	2,288,867,117.58	-5,636,595.45
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	205,599,462.54	-	212,551,185.56	6,951,723.02
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	205,599,462.54	-	212,551,185.56	6,951,723.02

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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	139,000,464.62	-	-	-
其中： 股指期货 投资	139,000,464.62	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	139,000,464.62	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IM2603	IM2603	36.00	53,560,800.00	3,289,735.38
IM2606	IM2606	65.00	93,659,800.00	4,930,400.00
合计				8,220,135.38
减：可抵销期货 暂收款				8,220,135.38
净额				0.00

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2.35	-

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	170,000.00	160,000.00
合计	170,002.35	160,000.00

7.4.7.10 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 12 月 31 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	1,664,234,283.65	1,664,234,283.65
本期赎回（以“-”号填列）	-948,715,988.54	-948,715,988.54
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	815,882,604.25	815,882,604.25

鹏华中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	2,716,038,445.37	2,716,038,445.37
本期赎回（以“-”号填列）	-1,972,942,385.41	-1,972,942,385.41
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	851,235,922.07	851,235,922.07

鹏华中证 1000 指数增强 I

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10.00	10.00
本期申购	1,134,368.02	1,134,368.02
本期赎回（以“-”号填列）	-403,183.35	-403,183.35
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	731,194.67	731,194.67

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

鹏华中证 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	149,809,276.23	-6,930,011.93	142,879,264.30
本期基金份额交易产生的变动数	296,122,372.63	18,347,432.19	314,469,804.82
其中：基金申购款	744,426,229.40	24,252,461.07	768,678,690.47
基金赎回款	-448,303,856.77	-5,905,028.88	-454,208,885.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	464,070,786.84	2,261,465.81	466,332,252.65

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	173,115,711.94	2,279,207.03	175,394,918.97
本期基金份额交易产生的变动数	277,273,143.91	9,064,304.39	286,337,448.30
其中：基金申购款	1,139,036,773.37	13,112,439.45	1,152,149,212.82
基金赎回款	-861,763,629.46	-4,048,135.06	-865,811,764.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	468,985,149.22	1,471,092.21	470,456,241.43

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	33,119.91	14,469.82	47,589.73
本期基金份额交易产生的变动数	243,728.36	24,326.87	268,055.23
其中：基金申购款	347,602.66	53,694.29	401,296.95
基金赎回款	-103,874.30	-29,367.42	-133,241.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	276,848.53	38,796.35	315,644.88

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	147,962.31	34,735.83
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	185,681.51	28,624.36
结算备付金利息收入	58,081.15	-
其他	2,240.34	172.49
合计	393,965.31	63,532.68

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。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	309,883,715.22	7,920,913.61
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	309,883,715.22	7,920,913.61

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	4,409,328,209.55	1,511,343,206.66
减：卖出股票成本总额	4,094,486,032.12	1,501,368,558.89
减：交易费用	4,958,462.21	2,053,734.16
买卖股票差价收入	309,883,715.22	7,920,913.61

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	13,817,072.88	-

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	9,013,099.87	5,155,039.24
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	9,013,099.87	5,155,039.24

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-12,588,318.47	14,647,898.68
股票投资	-12,588,318.47	14,647,898.68
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	8,220,135.38	-
权证投资	-	-
期货投资	8,220,135.38	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	239,421.42	-
合计	-4,607,604.51	14,647,898.68

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	3,111,738.65	165,028.15
基金转换费收入	34,517.22	76.84
合计	3,146,255.87	165,104.99

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	50,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	8,254.72	7,510.68
存托服务费	91.39	-
合计	178,346.11	167,510.68

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

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

注：1、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
国信证券	10,589,017,562.70	100.00	2,881,620,185.67	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
国信证券	2,074,883.58	100.00	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	1,113,132.84	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,026,217.15	2,345,388.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,582,826.20	880,802.65
应支付基金管理人的净管理费	5,443,390.95	1,464,585.40

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,692,415.70	439,760.24

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	-	354,646.69	-	354,646.69
鹏华基金公司	-	53,535.11	139.43	53,674.54
招商银行	-	263,047.02	-	263,047.02
合计	-	671,228.82	139.43	671,368.25
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 12 月 31 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	-	263,261.90	-	263,261.90
鹏华基金公司	-	142,025.22	-	142,025.22
招商银行	-	10,173.78	-	10,173.78
合计	-	415,460.90	-	415,460.90

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国信证券	272,585,742.08	185,681.51	8,635,449.33	28,624.36
招商银行	46,125,948.72	147,962.31	18,823,744.28	34,735.83

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025年1月1日至2025年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国信证券	688759	必贝特-U	网下申购	6,971	123,944.38
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国信证券	603207	小方制药	网下申购	1,848	23,044.56
国信证券	603325	博隆技术	网下申购	343	24,853.78
国信证券	301585	蓝宇股份	网下申购	2,092	50,103.40

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001221	悍高集团	2025年7月23日	6个月	新股流通受限	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
001386	马可波罗	2025年10月15日	6个月	新股流通受限	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股流通受限	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
301491	汉桑科技	2025年7月29日	6个月	新股流通受限	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301584	建发致新	2025年9月18日	6个月	新股流通受限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301609	山大电力	2025年7月16日	6个月	新股流通受限	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301656	联合动力	2025年9月17日	6个月	新股流通受限	12.48	25.46	7,395	92,289.60	188,276.70	-
301668	昊创瑞通	2025年9月15日	6个月	新股流通受限	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
600930	华	2025	6个月	新股	3.18	6.24	82,549	262,505.82	515,105.76	-

	电新能	年7月9日	月	流通受限						
601026	道生天合	2025年10月9日	6个月	新股流通受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德力佳	2025年10月30日	6个月	新股流通受限	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-
603175	超颖电子	2025年10月17日	6个月	新股流通受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603262	技源集团	2025年7月16日	6个月	新股流通受限	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603334	丰倍生物	2025年10月29日	6个月	新股流通受限	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603370	华新精科	2025年8月27日	6个月	新股流通受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025年10月28日	6个月	新股流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603406	天富龙	2025年7月30日	6个月	新股流通受限	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603418	友升股份	2025年9月16日	6个月	新股流通受限	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-
688729	屹唐股份	2025年7月1日	6个月	新股流通受限	8.45	24.28	1,697	14,339.65	41,203.16	-
688759	必	2025	6个	新股	17.78	25.11	2,789	49,588.42	70,031.79	-

	贝特-U	年 10 月 21 日	月	流通受限						
688783	西安奕材-U	2025 年 10 月 20 日	6 个月	新股流通受限	8.62	18.36	14,790	127,489.80	271,544.40	-
688795	摩尔线程-U	2025 年 11 月 26 日	6 个月	新股流通受限	114.28	416.18	1,856	212,103.68	772,430.08	-

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

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金。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之内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2024 年 12 月 31 日：未持有）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券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 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率

敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	318,711,690.80	-	-	-	318,711,690.80
结算备付金	17,853,818.90	-	-	-	17,853,818.90
存出保证金	17,666,472.00	-	-	-	17,666,472.00
交易性金融资产	-	-	-2,288,867,117.58	-	2,288,867,117.58
应收申购款	-	-	-	48,309,704.99	48,309,704.99
资产总计	354,231,981.70	-	-2,337,176,822.57	-	2,691,408,804.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	83,302,343.67	83,302,343.67
应付管理人报酬	-	-	-	1,796,367.27	1,796,367.27
应付托管费	-	-	-	336,818.87	336,818.87
应付销售服务费	-	-	-	417,661.94	417,661.94
应交税费	-	-	-	431,750.22	431,750.22
其他负债	-	-	-	170,002.35	170,002.35
负债总计	-	-	-	86,454,944.32	86,454,944.32
利率敏感度缺口	354,231,981.70	-	-2,250,721,878.25	-	2,604,953,859.95
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，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早

者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	2,288,867,117.58	87.87	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	2,288,867,117.58	87.87	212,551,185.56	93.96

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	120,817,760.02	10,129,739.28
比较基准下降 5% 资产净值变动	-120,817,760.02	-10,129,739.28	

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	2,286,869,931.66	212,056,153.92
第二层次	-	14,550.90
第三层次	1,997,185.92	480,480.74
合计	2,288,867,117.58	212,551,185.56

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	480,480.74	480,480.74
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	974,789.92	974,789.92
转出第三层次	-	1,006,039.84	1,006,039.84

当期利得或损失总额	-	1,547,955.10	1,547,955.10
其中：计入损益的利得或损失	-	1,547,955.10	1,547,955.10
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,997,185.92	1,997,185.92
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,165,525.66	1,165,525.66
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	535,864.48	535,864.48
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	308,936.69	308,936.69
转出第三层次	-	662,724.42	662,724.42
当期利得或损失总额	-	298,403.99	298,403.99
其中：计入损益的利得或损失	-	298,403.99	298,403.99
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	480,480.74	480,480.74
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	292,843.17	292,843.17

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	1,997,185.92	平均价格 亚式期权模型	预期年化波动率	0.00%- 303.23%	负相关
项目	上年度末公允	采用的估	不可观察输入值		

	价值	值技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	480,480.74	平均价格 亚式期权 模型	预期年化波动率	26.65%– 574.44%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,288,867,117.58	85.04
	其中：股票	2,288,867,117.58	85.04
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	336,565,509.70	12.51
8	其他各项资产	65,976,176.99	2.45
9	合计	2,691,408,804.27	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	3,106,996.80	0.12

B	采矿业	17,168,552.00	0.66
C	制造业	1,410,415,870.44	54.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,964,091.00	1.30
E	建筑业	6,210,618.00	0.24
F	批发和零售业	49,869,779.40	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	28,696,441.00	1.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	281,375,857.46	10.80
J	金融业	38,797,923.85	1.49
K	房地产业	29,053,410.00	1.12
L	租赁和商务服务业	19,117,005.80	0.73
M	科学研究和技术服务业	43,806,834.62	1.68
N	水利、环境和公共设施管理业	6,287,698.72	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,554,110.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	2,349,888.00	0.09
S	综合	4,853,324.00	0.19
	合计	1,982,628,401.09	76.11

8.2.2 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	2,594,924.00	0.10
C	制造业	231,024,634.04	8.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,365,694.76	0.09
E	建筑业	8,202,993.00	0.31
F	批发和零售业	12,567,373.54	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	3,509,382.00	0.13
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,042,024.65	0.73
J	金融业	148,980.00	0.01
K	房地产业	6,384,815.00	0.25
L	租赁和商务服务业	377,417.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	18,361,056.50	0.70
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	1,659,422.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	306,238,716.49	11.76

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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	688127	蓝特光学	723,900	27,862,911.00	1.07
2	600507	方大特钢	4,269,000	25,144,410.00	0.97
3	002913	奥士康	575,600	24,601,144.00	0.94
4	002373	千方科技	1,972,400	23,215,148.00	0.89
5	301095	广立微	288,700	20,702,677.00	0.79
6	300775	三角防务	652,500	19,836,000.00	0.76
7	603236	移远通信	205,787	19,634,137.67	0.75
8	300296	利亚德	3,061,200	19,346,784.00	0.74
9	002668	TCL 智家	1,805,876	18,744,992.88	0.72
10	301029	怡合达	675,700	17,919,564.00	0.69
11	000899	赣能股份	1,682,900	16,660,710.00	0.64
12	603915	国茂股份	889,400	16,373,854.00	0.63
13	688097	博众精工	433,666	16,370,891.50	0.63
14	300098	高新兴	2,602,260	15,873,786.00	0.61
15	300747	锐科激光	586,300	15,847,689.00	0.61

16	688063	派能科技	275,275	15,641,125.50	0.60
17	002690	美亚光电	743,200	15,287,624.00	0.59
18	301031	中熔电气	135,740	15,228,670.60	0.58
19	688153	唯捷创芯	401,400	15,108,696.00	0.58
20	600315	上海家化	670,100	15,090,652.00	0.58
21	301219	腾远钴业	219,400	14,980,632.00	0.58
22	605599	菜百股份	912,100	14,931,077.00	0.57
23	300409	道氏技术	659,100	14,823,159.00	0.57
24	688088	虹软科技	296,800	14,691,600.00	0.56
25	000555	神州信息	882,200	14,600,410.00	0.56
26	688062	迈威生物-U	378,453	14,559,086.91	0.56
27	688327	云从科技-UW	1,008,938	14,498,439.06	0.56
28	002946	新乳业	774,400	14,349,632.00	0.55
29	300319	麦捷科技	1,216,700	14,223,223.00	0.55
30	300438	鹏辉能源	266,600	14,188,452.00	0.54
31	300602	飞荣达	422,100	13,996,836.00	0.54
32	688515	裕太微-U	135,326	13,877,681.30	0.53
33	002511	中顺洁柔	1,571,647	13,453,298.32	0.52
34	600428	中远海特	1,868,500	13,266,350.00	0.51
35	300682	朗新集团	870,900	13,246,389.00	0.51
36	002993	奥海科技	300,700	13,143,597.00	0.50
37	688321	微芯生物	447,000	13,061,340.00	0.50
38	300772	运达股份	681,400	12,987,484.00	0.50
39	688686	奥普特	104,562	12,979,281.06	0.50
40	300415	伊之密	495,400	12,910,124.00	0.50
41	688372	伟测科技	117,222	12,787,747.98	0.49
42	002815	崇达技术	922,900	12,606,814.00	0.48
43	600933	爱柯迪	619,200	12,445,920.00	0.48
44	301215	中汽股份	1,807,000	12,377,950.00	0.48
45	000600	建投能源	1,450,900	12,376,177.00	0.48
46	688208	道通科技	333,975	12,290,280.00	0.47
47	001301	尚太科技	143,000	12,270,830.00	0.47
48	300428	立中集团	508,500	11,873,475.00	0.46
49	002063	远光软件	1,921,500	11,663,505.00	0.45
50	300363	博腾股份	496,300	11,534,012.00	0.44
51	600459	贵研铂业	617,100	11,484,231.00	0.44
52	601519	大智慧	870,400	11,202,048.00	0.43
53	002487	大金重工	215,100	11,170,143.00	0.43
54	300925	法本信息	522,300	11,093,652.00	0.43
55	688185	康希诺	175,332	11,019,616.20	0.42
56	002468	申通快递	817,400	10,969,508.00	0.42
57	301177	迪阿股份	378,600	10,930,182.00	0.42
58	300850	新强联	262,970	10,879,068.90	0.42

59	000059	华锦股份	2,021,200	10,813,420.00	0.42
60	002324	普利特	674,700	10,788,453.00	0.41
61	300357	我武生物	380,200	10,778,670.00	0.41
62	688131	皓元医药	148,083	10,673,822.64	0.41
63	688331	荣昌生物	136,557	10,622,769.03	0.41
64	301035	润丰股份	153,900	10,466,739.00	0.40
65	688029	南微医学	127,719	10,416,761.64	0.40
66	603043	广州酒家	580,800	10,239,504.00	0.39
67	600710	苏美达	936,800	10,126,808.00	0.39
68	600114	东睦股份	324,600	9,916,530.00	0.38
69	300779	惠城环保	75,800	9,862,338.00	0.38
70	600986	浙文互联	1,260,700	9,858,674.00	0.38
71	000589	贵州轮胎	1,862,300	9,646,714.00	0.37
72	600320	振华重工	1,870,600	9,633,590.00	0.37
73	301061	匠心家居	100,600	9,536,880.00	0.37
74	600686	金龙汽车	535,100	9,492,674.00	0.36
75	300861	美畅股份	633,000	9,450,690.00	0.36
76	002807	江阴银行	2,019,240	9,227,926.80	0.35
77	300079	数码视讯	1,706,200	9,196,418.00	0.35
78	688690	纳微科技	355,100	9,165,131.00	0.35
79	600782	新钢股份	2,352,200	9,126,536.00	0.35
80	688536	思瑞浦	56,600	9,049,208.00	0.35
81	300457	赢合科技	324,700	9,042,895.00	0.35
82	688639	华恒生物	277,200	9,031,176.00	0.35
83	002075	沙钢股份	1,561,100	8,976,325.00	0.34
84	300083	创世纪	970,000	8,933,700.00	0.34
85	002489	浙江永强	2,331,700	8,930,411.00	0.34
86	002897	意华股份	162,600	8,791,782.00	0.34
87	688209	英集芯	440,225	8,778,086.50	0.34
88	300232	洲明科技	1,231,400	8,730,626.00	0.34
89	600649	城投控股	1,934,000	8,606,300.00	0.33
90	600100	同方股份	961,700	8,578,364.00	0.33
91	601777	千里科技	805,500	8,562,465.00	0.33
92	002345	潮宏基	672,800	8,410,000.00	0.32
93	301339	通行宝	573,340	8,336,363.60	0.32
94	600389	江山股份	329,200	8,322,176.00	0.32
95	300257	开山股份	580,300	8,153,215.00	0.31
96	688484	南芯科技	196,900	8,005,954.00	0.31
97	600869	远东股份	987,100	7,946,155.00	0.31
98	000761	本钢板材	2,333,200	7,816,220.00	0.30
99	300685	艾德生物	380,700	7,789,122.00	0.30
100	000923	河钢资源	361,000	7,642,370.00	0.29
101	600662	外服控股	1,517,240	7,616,544.80	0.29

102	300244	迪安诊断	476,600	7,554,110.00	0.29
103	000990	诚志股份	952,100	7,540,632.00	0.29
104	600728	佳都科技	1,108,600	7,405,448.00	0.28
105	301487	盟固利	336,400	7,377,252.00	0.28
106	001914	招商积余	690,600	7,375,608.00	0.28
107	603118	共进股份	639,300	7,351,950.00	0.28
108	300674	宇信科技	299,600	7,268,296.00	0.28
109	605118	力鼎光电	240,400	7,238,444.00	0.28
110	002204	大连重工	940,800	7,197,120.00	0.28
111	688612	威迈斯	216,200	7,128,114.00	0.27
112	605020	永和股份	263,200	7,077,448.00	0.27
113	300323	华灿光电	878,100	7,007,238.00	0.27
114	002755	奥赛康	423,800	6,920,654.00	0.27
115	301316	慧博云通	154,500	6,903,060.00	0.26
116	688001	华兴源创	228,552	6,897,699.36	0.26
117	605099	共创草坪	193,100	6,891,739.00	0.26
118	301571	国科天成	118,600	6,840,848.00	0.26
119	002258	利尔化学	524,000	6,838,200.00	0.26
120	601369	陕鼓动力	680,600	6,812,806.00	0.26
121	600335	国机汽车	1,010,800	6,580,308.00	0.25
122	300008	天海防务	831,700	6,562,113.00	0.25
123	300776	帝尔激光	105,300	6,543,342.00	0.25
124	300443	金雷股份	230,700	6,489,591.00	0.25
125	300224	正海磁材	413,700	6,395,802.00	0.25
126	600266	城建发展	1,260,000	6,388,200.00	0.25
127	002484	江海股份	214,900	6,382,530.00	0.25
128	300723	一品红	189,400	6,354,370.00	0.24
129	002216	三全食品	554,700	6,262,563.00	0.24
130	688591	泰凌微	145,866	6,208,056.96	0.24
131	300953	震裕科技	36,828	6,187,840.56	0.24
132	000029	深深房 A	277,100	6,101,742.00	0.23
133	600478	科力远	883,800	6,089,382.00	0.23
134	002073	软控股份	737,600	6,011,440.00	0.23
135	600750	江中药业	259,400	6,010,298.00	0.23
136	300548	长芯博创	42,200	5,992,400.00	0.23
137	300034	钢研高纳	302,800	5,928,824.00	0.23
138	688091	上海谊众	124,000	5,828,000.00	0.22
139	002705	新宝股份	404,700	5,771,022.00	0.22
140	002839	张家港行	1,260,300	5,759,571.00	0.22
141	603588	高能环境	745,876	5,758,162.72	0.22
142	688123	聚辰股份	45,821	5,754,201.18	0.22
143	688343	云天励飞-U	73,700	5,607,096.00	0.22
144	002967	广电计量	250,800	5,520,108.00	0.21

145	601137	博威合金	256,900	5,489,953.00	0.21
146	300047	天源迪科	436,900	5,483,095.00	0.21
147	002649	博彦科技	414,994	5,473,770.86	0.21
148	000810	创维数字	458,600	5,402,308.00	0.21
149	301458	钧崑电子	165,500	5,310,895.00	0.20
150	002368	太极股份	213,300	5,223,717.00	0.20
151	002516	旷达科技	792,300	5,221,257.00	0.20
152	002079	苏州固锔	546,100	5,215,255.00	0.20
153	605507	国邦医药	209,300	5,190,640.00	0.20
154	601963	重庆银行	474,835	5,142,463.05	0.20
155	000049	德赛电池	190,100	5,109,888.00	0.20
156	688007	光峰科技	273,273	5,074,679.61	0.19
157	301000	肇民科技	128,200	5,047,234.00	0.19
158	002174	游族网络	411,500	5,036,760.00	0.19
159	002859	洁美科技	179,500	4,954,200.00	0.19
160	000058	深赛格	526,600	4,950,040.00	0.19
161	688141	杰华特	113,952	4,948,935.36	0.19
162	300624	万兴科技	69,400	4,903,110.00	0.19
163	002626	金达威	247,900	4,886,109.00	0.19
164	688433	华曙高科	73,653	4,873,619.01	0.19
165	600057	厦门象屿	571,600	4,870,032.00	0.19
166	000833	粤桂股份	249,400	4,853,324.00	0.19
167	300770	新媒股份	111,500	4,728,715.00	0.18
168	688003	天准科技	80,100	4,717,890.00	0.18
169	000603	盛达资源	152,200	4,712,112.00	0.18
170	600388	龙净环保	287,000	4,680,970.00	0.18
171	600866	星湖科技	653,600	4,542,520.00	0.17
172	003039	顺控发展	277,800	4,425,354.00	0.17
173	300113	顺网科技	218,000	4,412,320.00	0.17
174	603713	密尔克卫	78,700	4,389,099.00	0.17
175	001308	康冠科技	208,779	4,355,129.94	0.17
176	688177	百奥泰	187,400	4,336,436.00	0.17
177	002237	恒邦股份	322,300	4,325,266.00	0.17
178	600458	时代新材	322,500	4,279,575.00	0.16
179	002761	浙江建投	491,300	4,210,441.00	0.16
180	002706	良信股份	389,700	4,200,966.00	0.16
181	688116	天奈科技	88,198	4,158,535.70	0.16
182	002145	钛能化学	848,400	4,157,160.00	0.16
183	688006	杭可科技	141,400	4,141,606.00	0.16
184	301217	铜冠铜箔	119,900	4,110,172.00	0.16
185	300184	力源信息	405,460	4,050,545.40	0.16
186	601096	宏盛华源	975,000	4,046,250.00	0.16
187	688800	瑞可达	48,560	4,030,480.00	0.15

188	002020	京新药业	211,200	4,008,576.00	0.15
189	002036	联创电子	360,900	3,977,118.00	0.15
190	300702	天宇股份	168,000	3,964,800.00	0.15
191	688262	国芯科技	130,200	3,951,570.00	0.15
192	002006	精工科技	170,500	3,948,780.00	0.15
193	601609	金田股份	360,700	3,895,560.00	0.15
194	002434	万里扬	403,500	3,845,355.00	0.15
195	603119	浙江荣泰	33,000	3,817,110.00	0.15
196	002182	宝武镁业	240,900	3,685,770.00	0.14
197	600552	凯盛科技	292,600	3,628,240.00	0.14
198	600480	凌云股份	289,980	3,563,854.20	0.14
199	300341	麦克奥迪	215,000	3,513,100.00	0.13
200	000581	威孚高科	167,900	3,462,098.00	0.13
201	600621	华鑫股份	223,400	3,404,616.00	0.13
202	002698	博实股份	202,500	3,404,025.00	0.13
203	603599	广信股份	290,947	3,340,071.56	0.13
204	300693	盛弘股份	86,700	3,318,876.00	0.13
205	688182	灿勤科技	111,600	3,294,432.00	0.13
206	002243	力合科创	329,900	3,282,505.00	0.13
207	002777	久远银海	180,800	3,243,552.00	0.12
208	600366	宁波韵升	227,600	3,138,604.00	0.12
209	300087	荃银高科	266,010	3,106,996.80	0.12
210	003012	东鹏控股	463,800	3,037,890.00	0.12
211	603083	剑桥科技	22,300	2,996,674.00	0.12
212	002405	四维图新	323,400	2,913,834.00	0.11
213	600572	康恩贝	642,800	2,866,888.00	0.11
214	301268	铭利达	154,400	2,814,712.00	0.11
215	688798	艾为电子	36,600	2,785,626.00	0.11
216	002428	云南锗业	86,400	2,743,200.00	0.11
217	000758	中色股份	410,700	2,727,048.00	0.10
218	603308	应流股份	64,900	2,709,575.00	0.10
219	300573	兴齐眼药	38,500	2,706,165.00	0.10
220	002099	海翔药业	430,800	2,688,192.00	0.10
221	603027	千禾味业	269,700	2,651,151.00	0.10
222	688567	孚能科技	168,600	2,638,590.00	0.10
223	603267	鸿远电子	48,261	2,626,846.23	0.10
224	002222	福晶科技	45,900	2,586,006.00	0.10
225	002545	东方铁塔	138,900	2,562,705.00	0.10
226	300634	彩讯股份	101,400	2,558,322.00	0.10
227	601311	骆驼股份	276,900	2,539,173.00	0.10
228	000672	上峰水泥	191,700	2,490,183.00	0.10
229	000156	华数传媒	326,900	2,474,633.00	0.09
230	688206	概伦电子	70,900	2,469,447.00	0.09

231	300378	鼎捷数智	54,502	2,466,760.52	0.09
232	000880	潍柴重机	87,500	2,390,500.00	0.09
233	600305	恒顺醋业	297,400	2,355,408.00	0.09
234	300618	寒锐钴业	51,600	2,332,836.00	0.09
235	002110	三钢闽光	528,300	2,319,237.00	0.09
236	603638	艾迪精密	120,200	2,275,386.00	0.09
237	603663	三祥新材	64,000	2,262,400.00	0.09
238	002747	埃斯顿	93,400	2,213,580.00	0.08
239	600908	无锡银行	366,800	2,175,124.00	0.08
240	601020	华钰矿业	77,700	2,087,022.00	0.08
241	000012	南玻 A	454,200	2,012,106.00	0.08
242	002023	海特高新	147,000	1,990,380.00	0.08
243	000930	中粮科技	338,700	1,954,299.00	0.08
244	603323	苏农银行	373,500	1,886,175.00	0.07
245	301381	赛维时代	87,800	1,807,802.00	0.07
246	603328	依顿电子	161,900	1,774,424.00	0.07
247	300134	大富科技	141,600	1,770,000.00	0.07
248	000597	东北制药	332,844	1,737,445.68	0.07
249	600273	嘉化能源	191,000	1,669,340.00	0.06
250	000030	富奥股份	290,800	1,669,192.00	0.06
251	603317	天味食品	131,400	1,645,128.00	0.06
252	688200	华峰测控	8,649	1,645,039.80	0.06
253	688700	东威科技	45,800	1,615,824.00	0.06
254	603516	淳中科技	7,000	1,564,500.00	0.06
255	601068	中铝国际	295,500	1,563,195.00	0.06
256	603612	索通发展	66,000	1,551,000.00	0.06
257	603013	亚普股份	62,500	1,541,875.00	0.06
258	600361	创新新材	353,600	1,499,264.00	0.06
259	300068	南都电源	96,400	1,498,056.00	0.06
260	002268	电科网安	71,600	1,470,664.00	0.06
261	601003	柳钢股份	286,200	1,439,586.00	0.06
262	603005	晶方科技	51,900	1,435,554.00	0.06
263	002550	千红制药	178,200	1,400,652.00	0.05
264	002043	兔宝宝	90,300	1,301,223.00	0.05
265	600757	长江传媒	145,400	1,291,152.00	0.05
266	000801	四川九洲	74,500	1,263,520.00	0.05
267	300088	长信科技	200,500	1,215,030.00	0.05
268	002096	易普力	87,200	1,161,504.00	0.04
269	002518	科士达	23,800	1,154,776.00	0.04
270	002396	星网锐捷	37,400	1,133,220.00	0.04
271	688252	天德钰	52,528	1,112,017.76	0.04
272	300493	润欣科技	54,300	1,090,887.00	0.04
273	603876	鼎胜新材	70,400	1,056,704.00	0.04

274	300672	国科微	9,800	1,054,676.00	0.04
275	301511	德福科技	29,100	1,041,489.00	0.04
276	002011	盾安环境	80,200	1,016,936.00	0.04
277	600629	华建集团	46,800	1,015,560.00	0.04
278	603283	赛腾股份	22,600	979,032.00	0.04
279	600113	浙江东日	15,200	960,184.00	0.04
280	601801	皖新传媒	143,200	942,256.00	0.04
281	300725	药石科技	24,400	940,864.00	0.04
282	300199	翰宇药业	52,300	936,170.00	0.04
283	600267	海正药业	93,800	927,682.00	0.04
284	002960	青鸟消防	86,500	909,115.00	0.03
285	301071	力量钻石	24,300	870,912.00	0.03
286	300007	汉威科技	15,900	852,240.00	0.03
287	688519	南亚新材	10,400	840,944.00	0.03
288	600771	广誉远	44,100	792,918.00	0.03
289	600850	电科数字	25,300	749,892.00	0.03
290	688698	伟创电气	7,507	742,292.16	0.03
291	300303	聚飞光电	105,100	718,884.00	0.03
292	002588	史丹利	70,200	700,596.00	0.03
293	300226	上海钢联	26,800	673,216.00	0.03
294	002158	汉钟精机	26,400	660,792.00	0.03
295	301589	诺瓦星云	4,000	658,200.00	0.03
296	688776	国光电气	6,522	657,026.28	0.03
297	300035	中科电气	29,100	619,539.00	0.02
298	600064	南京高科	67,000	581,560.00	0.02
299	688313	仕佳光子	6,400	568,192.00	0.02
300	301327	华宝新能	9,800	565,166.00	0.02
301	301175	中科环保	89,600	529,536.00	0.02
302	603583	捷昌驱动	12,900	491,103.00	0.02
303	301508	中机认检	15,700	490,782.00	0.02
304	002675	东诚药业	34,700	476,778.00	0.02
305	000811	冰轮环境	23,800	440,776.00	0.02
306	000628	高新发展	9,800	436,982.00	0.02
307	688631	莱斯信息	6,200	422,096.00	0.02
308	002497	雅化集团	17,000	420,750.00	0.02
309	002091	江苏国泰	39,000	352,170.00	0.01
310	300598	诚迈科技	7,500	344,775.00	0.01
311	000543	皖能电力	42,600	338,670.00	0.01
312	002004	华邦健康	65,300	312,134.00	0.01
313	300620	光库科技	2,100	308,805.00	0.01
314	002245	蔚蓝锂芯	17,100	304,380.00	0.01
315	600640	国脉文化	14,600	183,376.00	0.01
316	300119	瑞普生物	8,900	167,053.00	0.01

317	002015	协鑫能科	16,400	163,180.00	0.01
318	002901	大博医疗	3,400	161,058.00	0.01
319	002701	奥瑞金	25,400	151,130.00	0.01
320	300633	开立医疗	5,700	150,594.00	0.01
321	002038	双鹭药业	18,800	138,556.00	0.01
322	688107	安路科技	5,000	135,900.00	0.01
323	300133	华策影视	14,000	116,480.00	0.00
324	603219	富佳股份	5,600	94,304.00	0.00
325	600125	铁龙物流	11,100	71,484.00	0.00
326	300170	汉得信息	2,900	54,868.00	0.00
327	002017	东信和平	2,200	49,060.00	0.00
328	600185	珠免集团	6,900	46,989.00	0.00
329	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00

8.3.2 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	600195	中牧股份	1,664,200	13,097,254.00	0.50
2	688556	高测股份	1,142,622	13,048,743.24	0.50
3	688322	奥比中光-UW	134,133	12,027,706.11	0.46
4	300162	雷曼光电	1,121,200	9,115,356.00	0.35
5	002587	奥拓电子	1,282,500	8,669,700.00	0.33
6	002137	实益达	923,900	7,927,062.00	0.30
7	603766	隆鑫通用	491,700	7,921,287.00	0.30
8	301080	百普赛斯	136,800	7,387,200.00	0.28
9	600808	马钢股份	1,711,500	7,222,530.00	0.28
10	688772	珠海冠宇	326,400	7,027,392.00	0.27
11	301555	惠柏新材	204,800	6,846,464.00	0.26
12	600549	厦门钨业	164,900	6,770,794.00	0.26
13	000708	中信特钢	390,500	6,392,485.00	0.25
14	002956	西麦食品	217,980	6,129,597.60	0.24
15	002314	南山控股	2,135,200	6,085,320.00	0.23
16	688166	博瑞医药	114,169	5,601,131.14	0.22
17	000915	华特达因	169,400	5,596,976.00	0.21
18	601117	中国化学	741,500	5,583,495.00	0.21
19	002555	三七互娱	236,400	5,579,040.00	0.21
20	002795	永和智控	865,056	5,449,852.80	0.21
21	300989	蕾奥规划	298,230	5,263,759.50	0.20
22	600128	苏豪弘业	458,600	5,040,014.00	0.19
23	002402	和而泰	117,500	4,596,600.00	0.18
24	688661	和林微纳	86,400	4,472,064.00	0.17
25	002414	高德红外	297,500	4,364,325.00	0.17
26	603111	康尼机电	618,800	4,238,780.00	0.16

27	300206	理邦仪器	328,500	4,201,515.00	0.16
28	002436	兴森科技	197,200	4,174,724.00	0.16
29	300073	当升科技	71,900	4,155,820.00	0.16
30	603048	浙江黎明	192,900	4,077,906.00	0.16
31	600967	内蒙一机	217,600	3,655,680.00	0.14
32	300596	利安隆	81,700	3,448,557.00	0.13
33	300496	中科创达	50,700	3,422,250.00	0.13
34	688095	福昕软件	37,895	3,382,886.65	0.13
35	300389	艾比森	204,200	3,314,166.00	0.13
36	002440	闰土股份	426,700	3,187,449.00	0.12
37	300739	明阳电路	170,600	3,135,628.00	0.12
38	300283	温州宏丰	414,800	3,123,444.00	0.12
39	300972	万辰集团	15,400	3,096,478.00	0.12
40	300464	星徽股份	481,000	3,049,540.00	0.12
41	300835	龙磁科技	44,600	2,924,868.00	0.11
42	300347	泰格医药	50,200	2,846,340.00	0.11
43	300605	恒锋信息	174,000	2,723,100.00	0.10
44	601872	招商轮船	302,300	2,714,654.00	0.10
45	301182	凯旺科技	63,500	2,706,370.00	0.10
46	688220	翱捷科技-U	29,864	2,467,065.04	0.09
47	688280	精进电动-UW	279,600	2,432,520.00	0.09
48	688512	慧智微-U	213,500	2,382,660.00	0.09
49	688347	华虹公司	19,579	2,111,986.73	0.08
50	301138	华研精机	53,700	2,083,560.00	0.08
51	300032	金龙机电	387,800	2,082,486.00	0.08
52	002866	传艺科技	113,800	2,049,538.00	0.08
53	600970	中材国际	194,600	2,021,894.00	0.08
54	688428	诺诚健华-U	90,800	1,863,216.00	0.07
55	002155	湖南黄金	87,800	1,851,702.00	0.07
56	600027	华电国际	362,900	1,799,984.00	0.07
57	002335	科华数据	31,600	1,754,748.00	0.07
58	300006	莱美药业	318,100	1,635,034.00	0.06
59	002824	和胜股份	79,700	1,546,180.00	0.06
60	300365	恒华科技	242,800	1,534,496.00	0.06
61	301052	果麦文化	38,900	1,485,591.00	0.06
62	002625	光启技术	29,900	1,457,924.00	0.06
63	600801	华新建材	57,800	1,418,412.00	0.05
64	002975	博杰股份	18,100	1,393,700.00	0.05
65	300976	达瑞电子	22,000	1,321,540.00	0.05
66	603126	中材节能	160,400	1,077,888.00	0.04
67	301027	华蓝集团	52,200	961,002.00	0.04
68	301558	三态股份	111,100	905,465.00	0.03
69	002838	道恩股份	34,800	837,984.00	0.03

70	603331	百达精工	57,600	820,800.00	0.03
71	002558	巨人网络	18,500	800,865.00	0.03
72	600233	圆通速递	48,400	794,728.00	0.03
73	688795	摩尔线程-U	1,856	772,430.08	0.03
74	300790	宇瞳光学	25,800	771,678.00	0.03
75	600569	安阳钢铁	341,900	769,275.00	0.03
76	002811	郑中设计	49,600	736,064.00	0.03
77	300328	宜安科技	40,900	698,163.00	0.03
78	300787	海能实业	57,800	679,150.00	0.03
79	600496	精工钢构	160,200	664,830.00	0.03
80	002246	北化股份	36,500	657,730.00	0.03
81	301216	万凯新材	39,000	657,540.00	0.03
82	600581	八一钢铁	195,600	653,304.00	0.03
83	300642	透景生命	34,400	632,616.00	0.02
84	600039	四川路桥	59,300	590,035.00	0.02
85	002241	歌尔股份	19,600	563,108.00	0.02
86	002293	罗莱生活	50,600	519,662.00	0.02
87	600930	华电新能	82,549	515,105.76	0.02
88	603979	金诚信	6,200	472,130.00	0.02
89	002410	广联达	34,500	434,010.00	0.02
90	002367	康力电梯	51,100	411,866.00	0.02
91	002486	嘉麟杰	127,500	396,525.00	0.02
92	300074	华平股份	81,900	377,559.00	0.01
93	300662	科锐国际	14,900	377,417.00	0.01
94	002624	完美世界	22,400	367,136.00	0.01
95	605016	百龙创园	16,200	349,920.00	0.01
96	600313	农发种业	52,400	337,456.00	0.01
97	300138	晨光生物	26,600	330,106.00	0.01
98	688002	睿创微纳	3,154	317,923.20	0.01
99	688577	浙海德曼	3,271	316,829.06	0.01
100	600183	生益科技	4,200	299,922.00	0.01
101	000006	深振业 A	30,100	299,495.00	0.01
102	688783	西安奕材-U	14,790	271,544.40	0.01
103	601958	金钼股份	17,400	271,092.00	0.01
104	300454	深信服	2,300	264,868.00	0.01
105	300644	南京聚隆	7,100	262,061.00	0.01
106	300003	乐普医疗	14,300	226,083.00	0.01
107	600282	南钢股份	40,600	213,556.00	0.01
108	301656	联合动力	7,395	188,276.70	0.01
109	300176	鸿特科技	28,200	188,094.00	0.01
110	605577	龙版传媒	13,300	173,831.00	0.01
111	300942	易瑞生物	16,300	153,383.00	0.01
112	601901	方正证券	19,100	148,980.00	0.01

113	600386	北巴传媒	28,800	126,432.00	0.00
114	301159	三维天地	3,000	110,310.00	0.00
115	300219	鸿利智汇	14,800	106,708.00	0.00
116	603486	科沃斯	1,300	104,884.00	0.00
117	300824	北鼎股份	9,200	104,052.00	0.00
118	000717	中南股份	37,300	96,607.00	0.00
119	301228	实朴检测	2,300	88,803.00	0.00
120	688759	必贝特-U	2,789	70,031.79	0.00
121	601515	衢州东峰	15,300	65,790.00	0.00
122	601991	大唐发电	14,500	50,605.00	0.00
123	300025	华星创业	7,900	45,504.00	0.00
124	688729	屹唐股份	1,697	41,203.16	0.00
125	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
126	000100	TCL 科技	5,700	25,878.00	0.00
127	002377	国创高新	8,300	23,738.00	0.00
128	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
129	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
130	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
131	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
132	000050	深天马 A	1,000	9,030.00	0.00
133	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
134	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
135	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
136	300621	维业股份	900	7,569.00	0.00
137	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
138	000932	华菱钢铁	1,300	7,306.00	0.00
139	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
140	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
141	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
142	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
143	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
144	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002913	奥士康	39,752,819.00	17.57
2	002518	科士达	37,589,819.00	16.62
3	688097	博众精工	35,172,211.21	15.55
4	301095	广立微	34,676,943.92	15.33
5	688088	虹软科技	34,511,032.15	15.26
6	002204	大连重工	33,044,131.00	14.61
7	300775	三角防务	32,206,589.00	14.24

8	688063	派能科技	31,698,887.69	14.01
9	688331	荣昌生物	30,861,522.38	13.64
10	000600	建投能源	30,431,917.00	13.45
11	688321	微芯生物	30,290,025.48	13.39
12	002396	星网锐捷	29,793,697.00	13.17
13	300682	朗新集团	29,135,700.00	12.88
14	688141	杰华特	27,174,704.68	12.01
15	301215	中汽股份	26,920,939.00	11.90
16	603236	移远通信	26,618,600.63	11.77
17	300319	麦捷科技	26,616,064.00	11.77
18	300548	长芯博创	26,531,555.48	11.73
19	600507	方大特钢	25,860,767.00	11.43
20	601068	中铝国际	24,956,328.00	11.03
21	688686	奥普特	24,143,767.37	10.67
22	688127	蓝特光学	23,759,175.84	10.50
23	600728	佳都科技	22,981,004.00	10.16
24	002373	千方科技	22,583,731.36	9.98
25	603915	国茂股份	22,506,551.00	9.95
26	300953	震裕科技	22,260,065.20	9.84
27	300393	中来股份	22,218,376.00	9.82
28	300170	汉得信息	21,967,200.00	9.71
29	301031	中熔电气	21,871,068.20	9.67
30	300850	新强联	21,684,623.62	9.59
31	301177	迪阿股份	21,650,867.00	9.57
32	300428	立中集团	21,494,324.00	9.50
33	688372	伟测科技	21,491,511.92	9.50
34	000555	神州信息	21,412,250.00	9.47
35	688343	云天励飞-U	21,257,941.38	9.40
36	300446	航天智造	20,829,774.70	9.21
37	300296	利亚德	20,800,470.12	9.20
38	002245	蔚蓝锂芯	20,399,887.00	9.02
39	300036	超图软件	20,111,135.00	8.89
40	301029	怡合达	19,873,969.00	8.79
41	601519	大智慧	19,785,133.00	8.75
42	002315	焦点科技	19,710,593.00	8.71
43	688123	聚辰股份	19,537,858.12	8.64
44	301035	润丰股份	19,341,843.00	8.55
45	002668	TCL 智家	19,286,578.00	8.53
46	300357	我武生物	18,974,217.00	8.39
47	002484	江海股份	18,957,522.00	8.38
48	601777	千里科技	18,867,820.00	8.34
49	300409	道氏技术	18,642,631.00	8.24
50	000058	深赛格	18,588,450.00	8.22

51	300438	鹏辉能源	18,545,141.00	8.20
52	002487	大金重工	18,470,974.00	8.17
53	603119	浙江荣泰	18,426,019.00	8.15
54	688131	皓元医药	18,387,602.63	8.13
55	300443	金雷股份	18,365,163.30	8.12
56	688536	思瑞浦	18,332,441.19	8.10
57	605168	三人行	18,222,327.55	8.06
58	688185	康希诺	18,184,693.88	8.04
59	688062	迈威生物-U	18,097,794.26	8.00
60	688322	奥比中光-UW	17,964,264.75	7.94
61	600933	爱柯迪	17,927,226.00	7.92
62	301219	腾远钴业	17,926,645.00	7.92
63	600315	上海家化	17,877,111.00	7.90
64	300747	锐科激光	17,867,764.00	7.90
65	002815	崇达技术	17,707,355.00	7.83
66	688403	汇成股份	17,657,034.37	7.81
67	300972	万辰集团	17,317,150.49	7.66
68	300257	开山股份	17,139,726.00	7.58
69	603486	科沃斯	17,043,619.00	7.53
70	300925	法本信息	16,951,209.83	7.49
71	000899	赣能股份	16,814,135.00	7.43
72	002690	美亚光电	16,791,961.00	7.42
73	688400	凌云光	16,787,683.54	7.42
74	600623	华谊集团	16,660,301.00	7.36
75	002335	科华数据	16,518,527.00	7.30
76	300363	博腾股份	16,492,996.00	7.29
77	002946	新乳业	16,470,750.00	7.28
78	688001	华兴源创	16,419,544.81	7.26
79	300415	伊之密	16,412,745.00	7.26
80	002967	广电计量	16,336,167.00	7.22
81	300232	洲明科技	16,310,320.00	7.21
82	688327	云从科技-UW	16,305,779.63	7.21
83	300593	新雷能	16,282,311.78	7.20
84	600266	城建发展	16,008,893.00	7.08
85	002807	江阴银行	15,584,631.80	6.89
86	300098	高新兴	15,578,546.60	6.89
87	002755	奥赛康	15,494,641.00	6.85
88	688433	华曙高科	15,437,253.72	6.82
89	301061	匠心家居	15,374,925.20	6.80
90	600195	中牧股份	15,347,496.00	6.78
91	002006	精工科技	15,338,326.52	6.78
92	605599	菜百股份	15,269,000.00	6.75
93	600389	江山股份	15,197,628.00	6.72

94	688153	唯捷创芯	15,130,055.57	6.69
95	603766	隆鑫通用	15,072,625.00	6.66
96	002048	宁波华翔	15,053,864.00	6.65
97	001301	尚太科技	14,823,199.00	6.55
98	002993	奥海科技	14,784,009.00	6.54
99	301316	慧博云通	14,768,311.00	6.53
100	000923	河钢资源	14,650,292.00	6.48
101	688029	南微医学	14,626,063.91	6.47
102	300596	利安隆	14,591,125.00	6.45
103	688166	博瑞医药	14,567,679.28	6.44
104	300454	深信服	14,556,946.00	6.44
105	300772	运达股份	14,526,125.62	6.42
106	300035	中科电气	14,484,767.00	6.40
107	688048	长光华芯	14,477,387.96	6.40
108	688515	裕太微-U	14,441,120.51	6.38
109	301268	铭利达	14,383,043.00	6.36
110	002468	申通快递	14,328,427.00	6.33
111	688209	英集芯	14,328,090.35	6.33
112	002516	旷达科技	14,294,256.00	6.32
113	003012	东鹏控股	14,117,447.00	6.24
114	301571	国科天成	14,071,854.00	6.22
115	300693	盛弘股份	14,068,331.88	6.22
116	603456	九洲药业	14,030,750.92	6.20
117	300034	钢研高纳	13,876,174.00	6.13
118	300323	华灿光电	13,824,237.00	6.11
119	000059	华锦股份	13,797,620.00	6.10
120	300206	理邦仪器	13,673,440.00	6.04
121	002597	金禾实业	13,646,771.00	6.03
122	688556	高测股份	13,588,934.11	6.01
123	603043	广州酒家	13,479,332.00	5.96
124	603028	赛福天	13,445,218.00	5.94
125	300634	彩讯股份	13,307,168.00	5.88
126	001308	康冠科技	13,276,283.63	5.87
127	688208	道通科技	13,272,213.55	5.87
128	300602	飞荣达	13,093,051.00	5.79
129	002511	中顺洁柔	12,974,336.17	5.74
130	600428	中远海特	12,926,421.00	5.71
131	603444	吉比特	12,911,621.00	5.71
132	688690	纳微科技	12,710,390.55	5.62
133	688206	概伦电子	12,684,034.13	5.61
134	603063	禾望电气	12,596,517.74	5.57
135	688612	威迈斯	12,586,017.06	5.56
136	600761	安徽合力	12,548,404.58	5.55

137	002434	万里扬	12,518,717.00	5.53
138	002643	万润股份	12,449,533.00	5.50
139	002137	实益达	12,427,755.00	5.49
140	300079	数码视讯	12,309,067.00	5.44
141	600986	浙文互联	12,303,730.00	5.44
142	002063	远光软件	12,170,659.00	5.38
143	603876	鼎胜新材	12,139,350.76	5.37
144	688018	乐鑫科技	11,982,572.24	5.30
145	300113	顺网科技	11,961,002.00	5.29
146	300080	易成新能	11,946,374.00	5.28
147	301526	国际复材	11,922,557.00	5.27
148	600490	鹏欣资源	11,889,515.00	5.26
149	301339	通行宝	11,853,923.20	5.24
150	002410	广联达	11,740,671.95	5.19
151	600782	新钢股份	11,714,323.00	5.18
152	002242	九阳股份	11,682,739.00	5.16
153	002222	福晶科技	11,656,935.60	5.15
154	600869	远东股份	11,642,270.00	5.15
155	688347	华虹公司	11,533,616.15	5.10
156	301039	中集车辆	11,490,584.00	5.08
157	603118	共进股份	11,489,330.00	5.08
158	688698	伟创电气	11,427,746.64	5.05
159	002544	普天科技	11,395,546.00	5.04
160	600649	城投控股	11,197,698.87	4.95
161	002008	大族激光	11,189,979.00	4.95
162	002212	天融信	11,113,164.00	4.91
163	002649	博彦科技	11,023,214.52	4.87
164	000672	上峰水泥	11,023,077.00	4.87
165	600459	贵研铂业	11,011,633.40	4.87
166	300570	太辰光	10,966,720.00	4.85
167	600556	天下秀	10,958,473.00	4.84
168	000761	本钢板材	10,900,013.00	4.82
169	688326	经纬恒润-W	10,899,135.67	4.82
170	300779	惠城环保	10,840,601.00	4.79
171	600710	苏美达	10,790,350.00	4.77
172	600063	皖维高新	10,789,894.97	4.77
173	600732	爱旭股份	10,761,542.00	4.76
174	600549	厦门钨业	10,679,117.72	4.72
175	300468	四方精创	10,637,120.00	4.70
176	603267	鸿远电子	10,533,024.30	4.66
177	300101	振芯科技	10,477,858.00	4.63
178	600478	科力远	10,447,907.00	4.62
179	300083	创世纪	10,435,264.00	4.61

180	688709	成都华微	10,392,401.73	4.59
181	002892	科力尔	10,375,800.60	4.59
182	600480	凌云股份	10,370,832.00	4.58
183	300496	中科创达	10,368,606.27	4.58
184	688800	瑞可达	10,303,735.64	4.55
185	002626	金达威	10,267,732.00	4.54
186	002174	游族网络	10,248,889.00	4.53
187	600114	东睦股份	10,248,501.00	4.53
188	688503	聚和材料	10,147,281.81	4.49
189	301338	凯格精机	10,147,238.00	4.49
190	600100	同方股份	10,140,521.00	4.48
191	603599	广信股份	10,123,807.58	4.48
192	601126	四方股份	10,066,299.00	4.45
193	688262	国芯科技	10,046,497.76	4.44
194	000657	中钨高新	9,986,611.00	4.41
195	300777	中简科技	9,959,120.00	4.40
196	300739	明阳电路	9,945,654.00	4.40
197	688772	珠海冠宇	9,882,138.40	4.37
198	688639	华恒生物	9,867,808.18	4.36
199	688252	天德钰	9,867,733.61	4.36
200	002545	东方铁塔	9,844,467.00	4.35
201	002249	大洋电机	9,815,223.00	4.34
202	002560	通达股份	9,803,043.00	4.33
203	002158	汉钟精机	9,799,331.00	4.33
204	600201	生物股份	9,794,248.00	4.33
205	300685	艾德生物	9,792,206.90	4.33
206	603111	康尼机电	9,748,804.00	4.31
207	300624	万兴科技	9,707,037.00	4.29
208	688270	臻镭科技	9,679,365.10	4.28
209	000029	深深房 A	9,642,555.00	4.26
210	002075	沙钢股份	9,590,024.00	4.24
211	002239	奥特佳	9,587,138.39	4.24
212	002079	苏州固锝	9,583,190.00	4.24
213	600664	哈药股份	9,504,252.00	4.20
214	000589	贵州轮胎	9,484,439.00	4.19
215	300360	炬华科技	9,454,269.00	4.18
216	300861	美畅股份	9,429,502.43	4.17
217	600458	时代新材	9,412,596.00	4.16
218	600055	万东医疗	9,408,919.00	4.16
219	002345	潮宏基	9,394,675.00	4.15
220	002020	京新药业	9,381,965.00	4.15
221	002414	高德红外	9,336,703.00	4.13
222	603171	税友股份	9,307,931.00	4.11

223	002489	浙江永强	9,206,776.00	4.07
224	301230	泓博医药	9,185,186.00	4.06
225	300457	赢合科技	9,138,607.00	4.04
226	600320	振华重工	9,071,794.60	4.01
227	688484	南芯科技	9,059,895.75	4.01
228	688382	益方生物-U	9,050,250.96	4.00
229	300870	欧陆通	9,045,438.00	4.00
230	002081	金螳螂	9,035,776.00	3.99
231	300244	迪安诊断	9,029,941.00	3.99
232	300134	大富科技	8,988,399.00	3.97
233	300674	宇信科技	8,972,186.00	3.97
234	600686	金龙汽车	8,956,706.00	3.96
235	300703	创源股份	8,942,353.00	3.95
236	002324	普利特	8,910,025.00	3.94
237	600776	东方通信	8,909,556.00	3.94
238	605020	永和股份	8,898,077.00	3.93
239	300162	雷曼光电	8,882,379.00	3.93
240	603920	世运电路	8,809,790.00	3.89
241	300416	苏试试验	8,704,436.00	3.85
242	300102	乾照光电	8,677,961.00	3.84
243	600641	先导基电	8,573,957.00	3.79
244	600662	外服控股	8,569,932.80	3.79
245	688007	光峰科技	8,528,827.81	3.77
246	002960	青鸟消防	8,489,496.00	3.75
247	601096	宏盛华源	8,478,472.00	3.75
248	300917	特发服务	8,451,383.00	3.74
249	002587	奥拓电子	8,447,231.00	3.73
250	300398	飞凯材料	8,442,158.00	3.73
251	688798	艾为电子	8,431,262.67	3.73
252	002405	四维图新	8,425,299.81	3.72
253	000612	焦作万方	8,408,023.00	3.72
254	002534	西子洁能	8,403,224.64	3.71
255	300726	宏达电子	8,389,067.00	3.71
256	002436	兴森科技	8,320,766.00	3.68
257	688261	东微半导	8,309,613.98	3.67
258	688521	芯原股份	8,219,315.27	3.63
259	301050	雷电微力	8,177,086.00	3.61
260	300369	绿盟科技	8,143,022.00	3.60
261	600966	博汇纸业	8,101,467.00	3.58
262	601117	中国化学	8,094,416.00	3.58
263	301458	钧崴电子	8,075,908.20	3.57
264	002216	三全食品	8,047,808.00	3.56
265	301217	铜冠铜箔	7,999,385.99	3.54

266	300475	香农芯创	7,995,136.56	3.53
267	603013	亚普股份	7,960,471.00	3.52
268	300790	宇瞳光学	7,944,297.00	3.51
269	600176	中国巨石	7,927,549.09	3.50
270	601677	明泰铝业	7,905,486.00	3.49
271	002101	广东鸿图	7,830,450.00	3.46
272	301080	百普赛斯	7,817,196.00	3.46
273	002268	电科网安	7,799,105.00	3.45
274	688380	中微半导	7,795,360.35	3.45
275	300077	国民技术	7,791,981.00	3.44
276	002314	南山控股	7,780,685.00	3.44
277	688668	鼎通科技	7,766,733.57	3.43
278	300082	奥克股份	7,646,003.00	3.38
279	000990	诚志股份	7,587,921.00	3.35
280	600640	国脉文化	7,513,527.00	3.32
281	688183	生益电子	7,396,156.51	3.27
282	688661	和林微纳	7,364,231.36	3.26
283	002011	盾安环境	7,338,756.00	3.24
284	688091	上海谊众	7,334,722.38	3.24
285	688099	晶晨股份	7,321,448.17	3.24
286	301487	盟固利	7,314,241.00	3.23
287	601137	博威合金	7,312,205.00	3.23
288	000048	京基智农	7,309,556.00	3.23
289	300776	帝尔激光	7,276,563.20	3.22
290	688220	翱捷科技-U	7,275,637.84	3.22
291	002036	联创电子	7,243,195.00	3.20
292	688116	天奈科技	7,236,961.86	3.20
293	002859	洁美科技	7,223,823.10	3.19
294	600808	马钢股份	7,207,341.00	3.19
295	603083	剑桥科技	7,188,094.00	3.18
296	300663	科蓝软件	7,187,289.00	3.18
297	600577	精达股份	7,179,564.00	3.17
298	688629	华丰科技	7,178,390.49	3.17
299	002897	意华股份	7,174,438.00	3.17
300	605099	共创草坪	7,062,036.00	3.12
301	000795	英洛华	7,038,812.00	3.11
302	688003	天准科技	7,027,412.85	3.11
303	300129	泰胜风能	7,010,960.00	3.10
304	600366	宁波韵升	7,009,835.00	3.10
305	002378	章源钨业	6,985,981.00	3.09
306	002265	建设工业	6,984,663.00	3.09
307	605118	力鼎光电	6,951,806.00	3.07
308	002311	海大集团	6,950,060.00	3.07

309	000682	东方电子	6,898,266.00	3.05
310	002073	软控股份	6,864,696.00	3.03
311	002959	小熊电器	6,847,152.00	3.03
312	301555	惠柏新材	6,820,544.00	3.02
313	300926	博俊科技	6,780,721.95	3.00
314	002171	楚江新材	6,772,924.00	2.99
315	300224	正海磁材	6,761,637.00	2.99
316	600420	国药现代	6,742,039.00	2.98
317	000915	华特达因	6,714,297.51	2.97
318	002402	和而泰	6,681,283.00	2.95
319	002705	新宝股份	6,675,537.00	2.95
320	688333	铂力特	6,673,920.37	2.95
321	000708	中信特钢	6,670,306.70	2.95
322	300464	星徽股份	6,628,001.00	2.93
323	002258	利尔化学	6,620,137.00	2.93
324	300770	新媒股份	6,605,011.00	2.92
325	688365	光云科技	6,600,047.51	2.92
326	603699	纽威股份	6,581,438.00	2.91
327	002985	北摩高科	6,535,225.58	2.89
328	688146	中船特气	6,527,170.34	2.89
329	603039	泛微网络	6,526,601.00	2.89
330	300008	天海防务	6,513,667.00	2.88
331	300188	国投智能	6,481,953.00	2.87
332	300866	安克创新	6,472,762.00	2.86
333	688295	中复神鹰	6,472,748.53	2.86
334	002019	亿帆医药	6,454,602.00	2.85
335	600335	国机汽车	6,445,575.00	2.85
336	601208	东材科技	6,421,568.20	2.84
337	600185	珠免集团	6,418,294.00	2.84
338	001914	招商积余	6,400,079.00	2.83
339	688591	泰凌微	6,391,250.79	2.83
340	601963	重庆银行	6,368,077.60	2.82
341	603713	密尔克卫	6,365,140.00	2.81
342	300723	一品红	6,352,350.00	2.81
343	300469	信息发展	6,349,346.00	2.81
344	002446	盛路通信	6,338,289.00	2.80
345	600552	凯盛科技	6,328,267.00	2.80
346	002326	永太科技	6,321,029.00	2.79
347	688139	海尔生物	6,267,088.85	2.77
348	600812	华北制药	6,212,757.00	2.75
349	300303	聚飞光电	6,182,876.00	2.73
350	300672	国科微	6,153,097.00	2.72
351	601020	华钰矿业	6,131,814.00	2.71

352	002938	鹏鼎控股	6,131,171.00	2.71
353	300470	中密控股	6,109,664.00	2.70
354	002733	雄韬股份	6,103,612.00	2.70
355	301221	光庭信息	6,098,431.00	2.70
356	002539	云图控股	6,095,527.00	2.69
357	000801	四川九洲	6,089,693.18	2.69
358	601369	陕鼓动力	6,063,722.00	2.68
359	000811	冰轮环境	6,062,566.00	2.68
360	002400	省广集团	6,039,711.00	2.67
361	603027	千禾味业	6,039,036.00	2.67
362	002151	北斗星通	6,021,344.17	2.66
363	600267	海正药业	6,018,490.00	2.66
364	301069	凯盛新材	6,010,244.00	2.66
365	600866	星湖科技	6,006,604.00	2.66
366	688711	宏微科技	6,003,913.20	2.65
367	601609	金田股份	5,999,869.00	2.65
368	600629	华建集团	5,993,591.00	2.65
369	300493	润欣科技	5,970,811.36	2.64
370	688006	杭可科技	5,874,789.64	2.60
371	002320	海峡股份	5,864,190.00	2.59
372	002706	良信股份	5,863,042.00	2.59
373	002488	金固股份	5,859,201.98	2.59
374	300401	花园生物	5,823,625.00	2.57
375	002368	太极股份	5,820,716.85	2.57
376	300085	银之杰	5,803,900.80	2.57
377	300857	协创数据	5,789,048.00	2.56
378	002795	永和智控	5,788,915.24	2.56
379	300337	银邦股份	5,787,216.00	2.56
380	603386	骏亚科技	5,771,751.00	2.55
381	600750	江中药业	5,771,578.00	2.55
382	002839	张家港行	5,769,934.00	2.55
383	002246	北化股份	5,768,152.78	2.55
384	001314	亿道信息	5,760,459.00	2.55
385	688147	微导纳米	5,756,410.79	2.54
386	600282	南钢股份	5,716,511.00	2.53
387	605577	龙版传媒	5,709,010.00	2.52
388	603009	北特科技	5,701,078.00	2.52
389	300709	精研科技	5,680,352.00	2.51
390	000810	创维数字	5,643,736.00	2.49
391	000603	盛达资源	5,622,349.00	2.49
392	688787	海天瑞声	5,558,162.91	2.46
393	688200	华峰测控	5,547,638.70	2.45
394	002297	博云新材	5,546,477.00	2.45

395	600179	安通控股	5,539,915.00	2.45
396	688630	芯碁微装	5,496,337.20	2.43
397	688177	百奥泰	5,483,133.57	2.42
398	603588	高能环境	5,482,783.20	2.42
399	300771	智莱科技	5,476,116.00	2.42
400	002126	银轮股份	5,458,770.00	2.41
401	603893	瑞芯微	5,443,249.00	2.41
402	002080	中材科技	5,410,772.00	2.39
403	300989	蕾奥规划	5,384,646.20	2.38
404	301363	美好医疗	5,384,486.00	2.38
405	300148	天舟文化	5,340,261.00	2.36
406	605507	国邦医药	5,318,572.00	2.35
407	300647	超频三	5,317,589.00	2.35
408	002555	三七互娱	5,315,044.00	2.35
409	300047	天源迪科	5,311,137.00	2.35
410	689009	九号公司-WD	5,309,826.06	2.35
411	000049	德赛电池	5,295,510.00	2.34
412	002956	西麦食品	5,286,759.40	2.34
413	300166	东方国信	5,256,386.00	2.32
414	002947	恒铭达	5,243,489.00	2.32
415	300604	长川科技	5,229,666.00	2.31
416	300007	汉威科技	5,182,851.00	2.29
417	603508	思维列控	5,100,773.00	2.25
418	300638	广和通	5,095,578.00	2.25
419	002292	奥飞娱乐	5,065,710.00	2.24
420	002276	万马股份	5,063,995.00	2.24
421	300412	迦南科技	5,035,011.30	2.23
422	600128	苏豪弘业	5,033,153.00	2.22
423	002145	钛能化学	5,031,612.05	2.22
424	002099	海翔药业	4,981,133.00	2.20
425	300678	中科信息	4,960,862.00	2.19
426	300618	寒锐钴业	4,940,764.00	2.18
427	300562	乐心医疗	4,938,981.00	2.18
428	300341	麦克奥迪	4,931,598.00	2.18
429	300261	雅本化学	4,906,173.00	2.17
430	000928	中钢国际	4,900,531.00	2.17
431	300988	津荣天宇	4,887,282.00	2.16
432	002397	梦洁股份	4,865,583.00	2.15
433	688660	电气风电	4,854,481.14	2.15
434	600635	大众公用	4,853,806.00	2.15
435	688128	中国电研	4,849,143.15	2.14
436	601886	江河集团	4,848,347.00	2.14
437	002237	恒邦股份	4,832,208.00	2.14

438	688362	甬矽电子	4,824,382.99	2.13
439	300184	力源信息	4,822,680.60	2.13
440	002761	浙江建投	4,813,233.00	2.13
441	300236	上海新阳	4,811,575.00	2.13
442	300738	奥飞数据	4,772,293.00	2.11
443	002583	海能达	4,752,644.00	2.10
444	688739	成大生物	4,749,391.51	2.10
445	300768	迪普科技	4,746,756.00	2.10
446	300088	长信科技	4,735,963.00	2.09
447	002243	力合科创	4,728,993.24	2.09
448	002056	横店东磁	4,723,959.00	2.09
449	301000	肇民科技	4,718,243.60	2.09
450	002046	国机精工	4,699,309.00	2.08
451	600929	雪天盐业	4,688,954.00	2.07
452	688019	安集科技	4,683,747.62	2.07
453	300702	天宇股份	4,676,691.00	2.07
454	301600	慧翰股份	4,659,957.53	2.06
455	000833	粤桂股份	4,639,342.00	2.05
456	603698	航天工程	4,622,192.00	2.04
457	301327	华宝新能	4,609,281.00	2.04
458	301511	德福科技	4,593,112.00	2.03
459	000957	中通客车	4,588,235.00	2.03
460	002906	华阳集团	4,573,922.00	2.02
461	603995	甬金股份	4,573,421.00	2.02
462	000791	甘肃能源	4,560,598.00	2.02
463	600388	龙净环保	4,557,556.00	2.01
464	300400	劲拓股份	4,552,217.00	2.01
465	002091	江苏国泰	4,537,642.00	2.01
466	688313	仕佳光子	4,529,432.30	2.00

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002518	科士达	42,417,120.00	18.75
2	002396	星网锐捷	33,904,130.94	14.99
3	002204	大连重工	30,870,401.00	13.65
4	300393	中来股份	26,425,719.00	11.68
5	601068	中铝国际	26,218,761.00	11.59
6	002245	蔚蓝锂芯	25,016,138.00	11.06
7	688141	杰华特	23,629,808.52	10.45
8	688088	虹软科技	23,090,996.35	10.21
9	300548	长芯博创	22,252,932.29	9.84
10	688331	荣昌生物	22,178,626.11	9.80

11	688403	汇成股份	21,669,568.38	9.58
12	300446	航天智造	21,537,282.00	9.52
13	300036	超图软件	21,217,487.00	9.38
14	300035	中科电气	20,891,243.00	9.24
15	600728	佳都科技	20,860,637.00	9.22
16	300170	汉得信息	20,381,754.00	9.01
17	688097	博众精工	20,290,462.24	8.97
18	688123	聚辰股份	19,900,584.88	8.80
19	002315	焦点科技	19,793,262.50	8.75
20	688048	长光华芯	19,180,077.71	8.48
21	688400	凌云光	19,055,129.53	8.42
22	002913	奥士康	18,765,429.89	8.30
23	605168	三人行	18,502,971.00	8.18
24	688063	派能科技	18,463,821.70	8.16
25	688321	微芯生物	17,931,619.39	7.93
26	300593	新雷能	17,902,107.90	7.91
27	300972	万辰集团	17,110,456.66	7.56
28	002249	大洋电机	16,958,645.00	7.50
29	301095	广立微	16,708,294.29	7.39
30	300953	震裕科技	16,668,942.00	7.37
31	603444	吉比特	16,627,890.00	7.35
32	000600	建投能源	16,480,037.00	7.29
33	000058	深赛格	16,442,396.00	7.27
34	603456	九洲药业	16,257,046.19	7.19
35	301215	中汽股份	16,256,823.12	7.19
36	688018	乐鑫科技	16,088,969.24	7.11
37	300775	三角防务	15,946,061.00	7.05
38	603119	浙江荣泰	15,729,608.05	6.95
39	688372	伟测科技	15,591,768.38	6.89
40	603486	科沃斯	15,586,498.00	6.89
41	600623	华谊集团	15,463,511.00	6.84
42	300850	新强联	15,460,786.01	6.83
43	688343	云天励飞-U	15,413,368.25	6.81
44	300596	利安隆	15,225,882.00	6.73
45	002048	宁波华翔	15,018,903.00	6.64
46	002643	万润股份	14,511,744.00	6.42
47	300454	深信服	14,212,425.00	6.28
48	300080	易成新能	14,152,141.00	6.26
49	603028	赛福天	14,037,965.85	6.21
50	300443	金雷股份	13,837,352.00	6.12
51	600490	鹏欣资源	13,740,687.00	6.07
52	688347	华虹公司	13,721,617.83	6.07
53	600063	皖维高新	13,651,428.32	6.03

54	601777	千里科技	13,645,008.00	6.03
55	002335	科华数据	13,581,568.52	6.00
56	301039	中集车辆	13,575,808.00	6.00
57	688433	华曙高科	13,392,884.17	5.92
58	301526	国际复材	13,368,095.00	5.91
59	603876	鼎胜新材	13,353,110.40	5.90
60	002212	天融信	13,350,341.00	5.90
61	002006	精工科技	13,348,921.00	5.90
62	002967	广电计量	13,322,245.00	5.89
63	603766	隆鑫通用	13,259,898.36	5.86
64	002242	九阳股份	13,049,667.00	5.77
65	601126	四方股份	13,016,219.00	5.75
66	300570	太辰光	12,971,467.25	5.73
67	600761	安徽合力	12,917,922.80	5.71
68	002597	金禾实业	12,713,455.90	5.62
69	301338	凯格精机	12,426,530.24	5.49
70	002534	西子洁能	12,396,416.87	5.48
71	688698	伟创电气	12,210,346.15	5.40
72	002484	江海股份	12,137,686.00	5.37
73	301177	迪阿股份	12,105,156.00	5.35
74	000657	中钨高新	12,039,866.48	5.32
75	300475	香农芯创	12,037,943.20	5.32
76	688001	华兴源创	12,026,393.70	5.32
77	600732	爱旭股份	12,020,192.22	5.31
78	003012	东鹏控股	11,951,957.00	5.28
79	300693	盛弘股份	11,574,089.00	5.12
80	603063	禾望电气	11,553,130.00	5.11
81	300777	中简科技	11,550,890.00	5.11
82	688709	成都华微	11,520,211.99	5.09
83	300682	朗新集团	11,510,773.00	5.09
84	600556	天下秀	11,465,442.00	5.07
85	600201	生物股份	11,342,808.00	5.01
86	688270	臻镭科技	11,311,266.40	5.00
87	002434	万里扬	11,285,832.00	4.99
88	688326	经纬恒润-W	11,157,935.84	4.93
89	688131	皓元医药	11,008,153.25	4.87
90	002516	旷达科技	10,980,414.00	4.85
91	300257	开山股份	10,962,576.00	4.85
92	688206	概伦电子	10,863,686.28	4.80
93	000672	上峰水泥	10,837,753.40	4.79
94	688686	奥普特	10,799,022.44	4.77
95	688503	聚和材料	10,732,395.83	4.74
96	002560	通达股份	10,709,421.00	4.73

97	002410	广联达	10,704,846.00	4.73
98	300468	四方精创	10,699,063.00	4.73
99	002222	福晶科技	10,618,023.60	4.69
100	600664	哈药股份	10,616,011.00	4.69
101	300034	钢研高纳	10,581,403.00	4.68
102	000612	焦作万方	10,573,932.04	4.67
103	601677	明泰铝业	10,569,245.00	4.67
104	603236	移远通信	10,521,725.00	4.65
105	002239	奥特佳	10,449,109.64	4.62
106	300870	欧陆通	10,448,706.28	4.62
107	002008	大族激光	10,358,611.00	4.58
108	300101	振芯科技	10,351,320.00	4.58
109	600776	东方通信	10,172,108.00	4.50
110	300319	麦捷科技	10,140,536.00	4.48
111	688183	生益电子	10,106,075.94	4.47
112	300232	洲明科技	10,061,800.20	4.45
113	603171	税友股份	10,054,833.00	4.44
114	300726	宏达电子	10,037,789.00	4.44
115	601519	大智慧	10,002,397.00	4.42
116	002544	普天科技	9,976,160.00	4.41
117	002158	汉钟精机	9,934,544.00	4.39
118	600176	中国巨石	9,799,875.33	4.33
119	301268	铭利达	9,775,646.00	4.32
120	300416	苏试试验	9,735,603.00	4.30
121	300369	绿盟科技	9,716,021.00	4.30
122	000923	河钢资源	9,686,489.00	4.28
123	600641	先导基电	9,653,655.00	4.27
124	300206	理邦仪器	9,647,425.00	4.26
125	300102	乾照光电	9,605,155.00	4.25
126	002545	东方铁塔	9,570,289.00	4.23
127	300428	立中集团	9,540,929.60	4.22
128	688380	中微半导	9,422,883.20	4.17
129	301571	国科天成	9,378,053.10	4.15
130	300634	彩讯股份	9,284,571.00	4.10
131	300113	顺网科技	9,282,996.00	4.10
132	300703	创源股份	9,193,020.00	4.06
133	002101	广东鸿图	9,027,427.00	3.99
134	600966	博汇纸业	9,005,638.00	3.98
135	300917	特发服务	8,984,356.00	3.97
136	603920	世运电路	8,963,647.00	3.96
137	600577	精达股份	8,866,983.00	3.92
138	600266	城建发展	8,815,259.84	3.90
139	002892	科力尔	8,806,289.86	3.89

140	300360	炬华科技	8,758,333.64	3.87
141	600458	时代新材	8,749,137.29	3.87
142	688798	艾为电子	8,747,055.20	3.87
143	688668	鼎通科技	8,740,756.47	3.86
144	300357	我武生物	8,714,948.00	3.85
145	300398	飞凯材料	8,681,686.00	3.84
146	688382	益方生物-U	8,578,510.84	3.79
147	688261	东微半导	8,562,861.82	3.79
148	688322	奥比中光-UW	8,523,879.15	3.77
149	002081	金螳螂	8,414,653.00	3.72
150	301316	慧博云通	8,414,487.00	3.72
151	600055	万东医疗	8,402,046.00	3.71
152	603013	亚普股份	8,395,501.00	3.71
153	301230	泓博医药	8,346,868.00	3.69
154	688521	芯原股份	8,328,978.75	3.68
155	002960	青鸟消防	8,326,359.30	3.68
156	688536	思瑞浦	8,250,293.97	3.65
157	301050	雷电微力	8,230,669.00	3.64
158	002487	大金重工	8,216,757.00	3.63
159	000682	东方电子	8,171,243.00	3.61
160	688146	中船特气	8,159,013.80	3.61
161	300082	奥克股份	8,071,540.00	3.57
162	600389	江山股份	8,020,281.75	3.55
163	600640	国脉文化	8,015,156.70	3.54
164	688147	微导纳米	7,945,102.55	3.51
165	688200	华峰测控	7,914,364.16	3.50
166	300790	宇瞳光学	7,906,201.00	3.50
167	002378	章源钨业	7,827,371.00	3.46
168	300926	博俊科技	7,723,306.05	3.41
169	300129	泰胜风能	7,715,035.00	3.41
170	688252	天德钰	7,704,628.29	3.41
171	001308	康冠科技	7,688,866.00	3.40
172	301069	凯盛新材	7,650,853.07	3.38
173	600179	安通控股	7,608,651.00	3.36
174	688099	晶晨股份	7,607,097.50	3.36
175	002011	盾安环境	7,603,820.00	3.36
176	688333	铂力特	7,529,820.39	3.33
177	002171	楚江新材	7,492,235.00	3.31
178	603699	纽威股份	7,412,045.00	3.28
179	300363	博腾股份	7,403,779.00	3.27
180	603039	泛微网络	7,400,930.00	3.27
181	300077	国民技术	7,399,446.62	3.27
182	301031	中熔电气	7,348,201.44	3.25

183	002320	海峡股份	7,293,000.00	3.22
184	000048	京基智农	7,279,055.00	3.22
185	300739	明阳电路	7,267,674.00	3.21
186	002268	电科网安	7,267,353.00	3.21
187	000555	神州信息	7,235,891.00	3.20
188	300134	大富科技	7,200,003.00	3.18
189	002265	建设工业	7,147,862.00	3.16
190	002906	华阳集团	7,133,437.00	3.15
191	688019	安集科技	7,114,220.83	3.14
192	600420	国药现代	7,096,224.00	3.14
193	300236	上海新阳	7,086,365.00	3.13
194	600185	珠免集团	7,080,019.00	3.13
195	300469	信息发展	7,069,504.00	3.13
196	300415	伊之密	7,049,806.00	3.12
197	301035	润丰股份	7,027,496.00	3.11
198	002020	京新药业	7,000,149.00	3.09
199	600933	爱柯迪	6,983,584.00	3.09
200	000811	冰轮环境	6,973,862.00	3.08
201	002400	省广集团	6,973,293.00	3.08
202	300323	华灿光电	6,969,372.00	3.08
203	603893	瑞芯微	6,898,408.00	3.05
204	601208	东材科技	6,887,435.00	3.04
205	688800	瑞可达	6,843,375.51	3.03
206	002539	云图控股	6,819,887.00	3.01
207	300604	长川科技	6,815,944.00	3.01
208	002446	盛路通信	6,812,811.00	3.01
209	600812	华北制药	6,796,674.00	3.00
210	002326	永太科技	6,758,478.00	2.99
211	002414	高德红外	6,737,704.00	2.98
212	603267	鸿远电子	6,719,400.00	2.97
213	002733	雄韬股份	6,697,884.00	2.96
214	300496	中科创达	6,671,009.00	2.95
215	300857	协创数据	6,664,157.40	2.95
216	002815	崇达技术	6,647,892.00	2.94
217	002311	海大集团	6,647,510.83	2.94
218	002151	北斗星通	6,632,175.84	2.93
219	603025	大豪科技	6,619,831.13	2.93
220	603009	北特科技	6,579,180.00	2.91
221	688629	华丰科技	6,538,444.17	2.89
222	300663	科蓝软件	6,536,716.83	2.89
223	600869	远东股份	6,530,741.00	2.89
224	300866	安克创新	6,417,214.80	2.84
225	688295	中复神鹰	6,417,000.53	2.84

226	603386	骏亚科技	6,410,691.00	2.83
227	002985	北摩高科	6,322,736.38	2.80
228	603915	国茂股份	6,291,365.00	2.78
229	300337	银邦股份	6,287,586.00	2.78
230	300188	国投智能	6,280,045.96	2.78
231	002091	江苏国泰	6,268,254.00	2.77
232	002626	金达威	6,239,599.00	2.76
233	301327	华宝新能	6,236,210.80	2.76
234	688787	海天瑞声	6,211,296.59	2.75
235	688711	宏微科技	6,210,436.49	2.75
236	688630	芯碁微装	6,203,809.49	2.74
237	002755	奥赛康	6,186,893.00	2.74
238	002080	中材科技	6,160,366.00	2.72
239	000795	英洛华	6,159,131.00	2.72
240	002174	游族网络	6,123,029.00	2.71
241	688262	国芯科技	6,088,735.18	2.69
242	600480	凌云股份	6,083,743.00	2.69
243	603599	广信股份	6,042,826.00	2.67
244	002297	博云新材	6,039,842.00	2.67
245	002938	鹏鼎控股	6,035,322.00	2.67
246	605577	龙版传媒	6,029,526.00	2.67
247	002959	小熊电器	6,024,376.00	2.66
248	300647	超频三	6,011,434.00	2.66
249	300771	智莱科技	5,989,333.60	2.65
250	002405	四维图新	5,981,317.00	2.64
251	688139	海尔生物	5,961,731.12	2.64
252	301221	光庭信息	5,938,320.87	2.63
253	688128	中国电研	5,936,666.33	2.62
254	600282	南钢股份	5,926,592.00	2.62
255	600158	中体产业	5,908,308.01	2.61
256	300085	银之杰	5,872,376.75	2.60
257	002947	恒铭达	5,855,756.00	2.59
258	688209	英集芯	5,807,620.39	2.57
259	301363	美好医疗	5,760,275.00	2.55
260	002046	国机精工	5,732,452.56	2.53
261	002019	亿帆医药	5,732,255.00	2.53
262	600478	科力远	5,716,504.00	2.53
263	002807	江阴银行	5,647,902.00	2.50
264	600267	海正药业	5,646,069.00	2.50
265	300470	中密控股	5,611,849.00	2.48
266	002056	横店东磁	5,600,575.00	2.48
267	600629	华建集团	5,583,798.00	2.47
268	002121	科陆电子	5,583,018.00	2.47

269	002397	梦洁股份	5,581,083.00	2.47
270	300709	精研科技	5,580,622.00	2.47
271	300261	雅本化学	5,565,648.00	2.46
272	301205	联特科技	5,540,059.66	2.45
273	689009	九号公司-WD	5,517,691.52	2.44
274	002246	北化股份	5,516,407.54	2.44
275	000928	中钢国际	5,489,088.00	2.43
276	300768	迪普科技	5,473,410.50	2.42
277	001314	亿道信息	5,441,126.00	2.41
278	301600	慧翰股份	5,438,936.80	2.40
279	300303	聚飞光电	5,432,317.50	2.40
280	688348	昱能科技	5,404,869.64	2.39
281	300400	劲拓股份	5,400,299.00	2.39
282	600635	大众公用	5,391,402.00	2.38
283	601886	江河集团	5,373,404.00	2.38
284	002468	申通快递	5,358,543.00	2.37
285	300031	宝通科技	5,350,824.00	2.37
286	002488	金固股份	5,340,603.24	2.36
287	300401	花园生物	5,335,064.00	2.36
288	688365	光云科技	5,329,755.08	2.36
289	688362	甬矽电子	5,319,485.71	2.35
290	300988	津荣天宇	5,265,615.00	2.33
291	301171	易点天下	5,252,740.00	2.32
292	300007	汉威科技	5,206,891.00	2.30
293	300624	万兴科技	5,186,650.06	2.29
294	603698	航天工程	5,154,815.00	2.28
295	688185	康希诺	5,146,779.13	2.28
296	603995	甬金股份	5,119,989.65	2.26
297	600929	雪天盐业	5,104,800.00	2.26
298	300412	迦南科技	5,093,902.00	2.25
299	002126	银轮股份	5,084,540.00	2.25
300	002276	万马股份	5,081,782.00	2.25
301	688660	电气风电	5,048,530.79	2.23
302	002891	中宠股份	5,047,608.00	2.23
303	300672	国科微	5,038,587.00	2.23
304	300638	广和通	4,998,604.00	2.21
305	688166	博瑞医药	4,998,438.42	2.21
306	000917	电广传媒	4,991,149.00	2.21
307	000957	中通客车	4,983,254.00	2.20
308	300464	星徽股份	4,975,800.00	2.20
309	601020	华钰矿业	4,914,283.03	2.17
310	300148	天舟文化	4,807,217.00	2.13
311	300166	东方国信	4,774,216.00	2.11

312	688586	江航装备	4,757,093.93	2.10
313	600489	中金黄金	4,727,148.00	2.09
314	301061	匠心家居	4,700,161.00	2.08
315	688313	仕佳光子	4,693,314.77	2.07
316	688220	翱捷科技-U	4,674,861.29	2.07
317	301219	腾远钴业	4,671,694.98	2.07
318	300456	赛微电子	4,646,637.00	2.05
319	603508	思维列控	4,646,624.00	2.05
320	600094	大名城	4,626,182.00	2.05
321	000801	四川九洲	4,620,456.00	2.04
322	603026	石大胜华	4,603,338.00	2.03
323	300562	乐心医疗	4,581,636.00	2.03
324	002292	奥飞娱乐	4,578,069.00	2.02
325	002583	海能达	4,531,655.00	2.00

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,183,390,282.61
卖出股票收入（成交）总额	4,409,328,209.55

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,666,472.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	48,309,704.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,976,176.99

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总份 额比 例 (%)
鹏华中证 1000 指 数增强 A	20,322	40,147.75	27,848,722.77	3.41	788,033,881.48	96.59
鹏华中证 1000 指 数增强 C	69,536	12,241.66	77,347,599.28	9.09	773,888,322.79	90.91
鹏华中证 1000 指 数增强 I	63	11,606.26	0.00	0.00	731,194.67	100.00
合计	89,921	18,547.94	105,196,322.05	6.31	1,562,653,398.94	93.69

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	鹏华中证 1000 指数增强 A	352,124.18	0.0432
	鹏华中证 1000 指数增强 C	42,640.37	0.0050
	鹏华中证 1000 指数增强 I	134,491.19	18.3933
	合计	529,255.74	0.0317

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人 员、基金投资和研 究部门负责人持有本开 放式基金	鹏华中证 1000 指数增强 A	10~50
	鹏华中证 1000 指数增强 C	-
	鹏华中证 1000 指数增强 I	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有	鹏华中证 1000 指数增强 A	0~10

本开放式基金	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。

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

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华中证 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	1,664,234,283.65	2,716,038,445.37	1,134,368.02
减：本报告期基金总赎回份额	948,715,988.54	1,972,942,385.41	403,183.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	815,882,604.25	851,235,922.07	731,194.67

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，经公司第六届董事会第三百次会议审议通过，聘任薛华先生担任公司财务负责人，任职日期自 2025 年 11 月 30 日起。

报告期内，公司副总经理高鹏先生不再兼任公司首席信息官。经公司第六届董事会第三百次会议审议通过，聘任聂连杰先生担任公司首席信息官，任职日期自 2025 年 11 月 30 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 3 年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券	2	10,589,017,562.70	100.00	2,074,883.58	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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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
2	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
3	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
4	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
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
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暂停客服电话服务的公告	《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 20 日
13	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
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与部分销售机构认购、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 07 月 07 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国投证券股份有限公司认购、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 07 月 14 日
16	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 2 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 07 月 18 日

17	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 08 月 01 日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国泰海通证券股份有限公司认购、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 08 月 12 日
19	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 08 月 23 日
20	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告	《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 08 月 28 日
21	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 09 月 03 日
22	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 09 月 05 日
23	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《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 09 月 22 日
24	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《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 09 月 29 日
25	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购必贝特首次公开发行 A 股的公告	《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 10 月 23 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国元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 10 月 23 日
27	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 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 10 月 27 日

28	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书	《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 11 月 07 日
29	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 11 月 07 日
30	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 11 月 07 日
31	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 11 月 07 日
32	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《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 11 月 19 日
33	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《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 12 月 02 日
34	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《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 12 月 02 日
35	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下公募基金风险等级评估方式与标准相关事项的公告	《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 12 月 18 日
36	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《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 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证 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 年年度报告》(原文)。

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2026 年 3 月 30 日