

鹏华智投数字经济混合型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	56

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 盈利投资者数量占比	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.4 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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	60
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华智投数字经济混合	
基金主代码	020086	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 5 月 17 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	22,194,716.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	鹏华智投数字经济混合 A	鹏华智投数字经济混合 C
下属分级基金的交 易代码	020086	020087
报告期末下属分级 基金的份额总额	9,944,985.94 份	12,249,730.88 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以数量化投资方法为基础，在有效控制投资组合风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。 2、股票投资策略 （1）数字经济主题界定 数字经济是指“以使用数字化的知识和信息作为关键生产要素、以现代信息网络作为重要载体、以信息通信技术的有效使用作为效率提升和经济结构优化的重要推动力的一系列经济活动”，参照国家统计局发布的《数字经济及其核心产业统计分类（2021）》，本基金对数字经济的界定如下： 1）数字产品制造业，主要包括从事计算机制造、通讯及雷达设备制造、数字媒体设备制造、智能设备制造、电子元器件及设备制造的企业；主要涉及电子行业中的半导体、元器件、光学光电子、消费电子、电子化学品行业，计算机行业中计算机设备行业，机械制造和电力设备行业中的专用设备、通用设备、零部件。 2）数字产品服务业，主要包括从事涵盖计算机、软件及辅助设

	备、通讯设备、广播影视设备的数字产品批发、零售、租赁和维修的企业。 3) 数字技术应用业，主要指从事软件开发，电信、广播电视和卫星传输服务，互联网相关服务及信息技术服务相关领域的行业；主要涉及计算机行业中的软件开发、计算机应用行业，传媒行业中的游戏、广告营销、影视院线、数字媒体、社交、出版及电视广播行业。 4) 数字要素驱动业，主要指从事互联网平台、互联网批发零售、互联网金融、数字内容与媒体、信息基础设施建设、数字资源与产权交易相关领域的行业；主要涉及传媒行业中的互联网传媒行业，通信行业中的通信服务及通信设备行业。 5) 数字化效率提升业：主要指被数字技术深度改造升级带来的产出增加和效率提升的传统行业，主要指从事智能农业、智能制造、智能交通、智慧物流、数字金融、数字商贸、数字社会、数字政府相关领域的行业；主要涉及汽车、交通运输、电力设备、公用事业、环保、医药生物、农林牧渔、机械设备、轻工制造、家用电器、建筑装饰、金融和服务于电子、通信、计算机及汽车行业的基础化工、有色金属等行业。 如果未来由于技术进步、政策变化及商业模式发展等原因导致本基金数字经济主题相关行业的覆盖范围发生变动，基金管理人在履行适当程序后，可以根据实际情况对数字经济主题的界定进行调整。 (2) 量化选股策略 本基金将以数字经济主题相关的股票为股票池，并采用多因子选股策略构建股票投资组合。多因子选股策略的信息主要来自于基本面、预期数据、市场交易数据等，每一类信息代表一种选股逻辑。在不同的市场环境下，选股逻辑会有不同的侧重点。基于不同的选股逻辑，构建个股维度的多因子选股策略，包括价值、基本面、市场、成长、预期等，并对因子的有效性进行情景分析和动态监控，筛选出有效因子组合，构建股票资产组合。 本基金在股票投资组合构建完成后，将根据个股价格波动、风险收益变化的实际情况，定期或不定期调整个股权重，以确保整个股票组合的风险处于可控范围内。 (3) 港股通标的股票投资策略 本基金所投资港股通标的股票除适用上述个股投资策略外，还需关注： 1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司； 2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司； 3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。 3、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 4、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、
--	--

	息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。 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。 5、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果。 6、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 7、参与融资业务策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。
业绩比较基准	中证数字经济主题指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中债综合财富（总值）指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期收益及预期风险高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	任航
	联系电话	0755-81395402	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4006788533	95599
传真		0755-82021126	010-68121816
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031

法定代表人	张纳沙	谷澍
-------	-----	----

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	鹏华智投数字经济混合 A	鹏华智投数字经济混合 C
本期已实现收益	3,172,102.94	3,739,744.05
本期利润	2,984,501.19	2,349,539.67
加权平均基金份 额本期利润	0.2033	0.1309
本期加权平均净 值利润率	10.20%	6.63%
本期基金份额净 值增长率	9.71%	9.39%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	10,542,808.29	12,664,599.15
期末可供分配基 金份额利润	1.0601	1.0339
期末基金资产净 值	20,487,794.23	24,914,330.03
期末基金份额净 值	2.0601	2.0339
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

基金份额累计净值增长率	106.01%	103.39%
-------------	---------	---------

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华智投数字经济混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	11.47%	1.55%	43.49%	1.88%	-32.02%	-0.33%
过去六个月	9.71%	1.58%	34.29%	1.69%	-24.58%	-0.11%
过去一年	31.37%	1.34%	59.75%	1.56%	-28.38%	-0.22%
自基金合同生效起至今	106.01%	1.69%	111.76%	1.67%	-5.75%	0.02%

鹏华智投数字经济混合 C

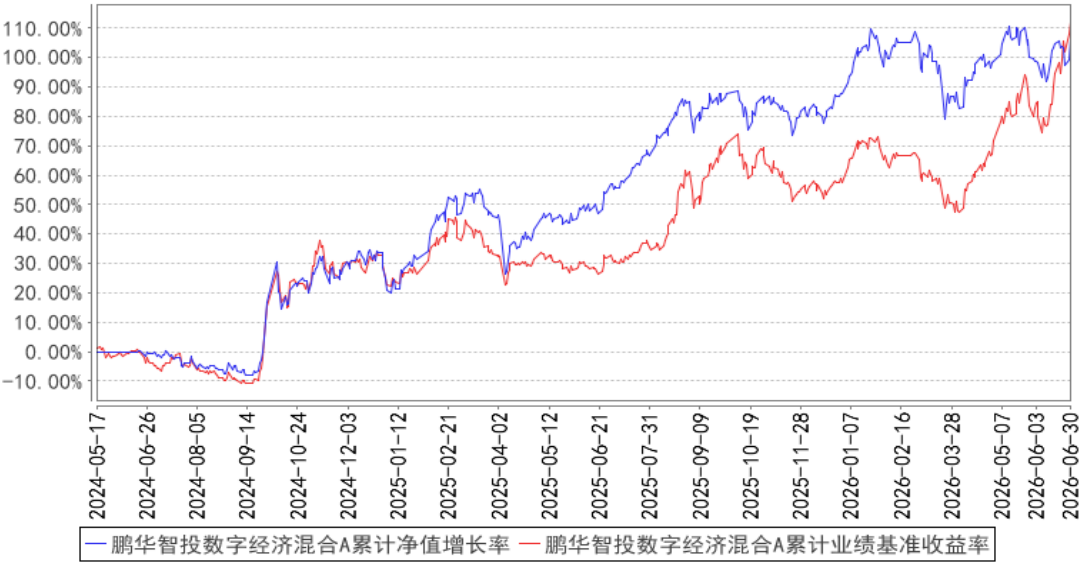
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	11.31%	1.55%	43.49%	1.88%	-32.18%	-0.33%
过去六个月	9.39%	1.58%	34.29%	1.69%	-24.90%	-0.11%

过去一年	30.58%	1.34%	59.75%	1.56%	- 29.17%	-0.22%
自基金合同生效 起至今	103.39%	1.69%	111.76%	1.67%	-8.37%	0.02%

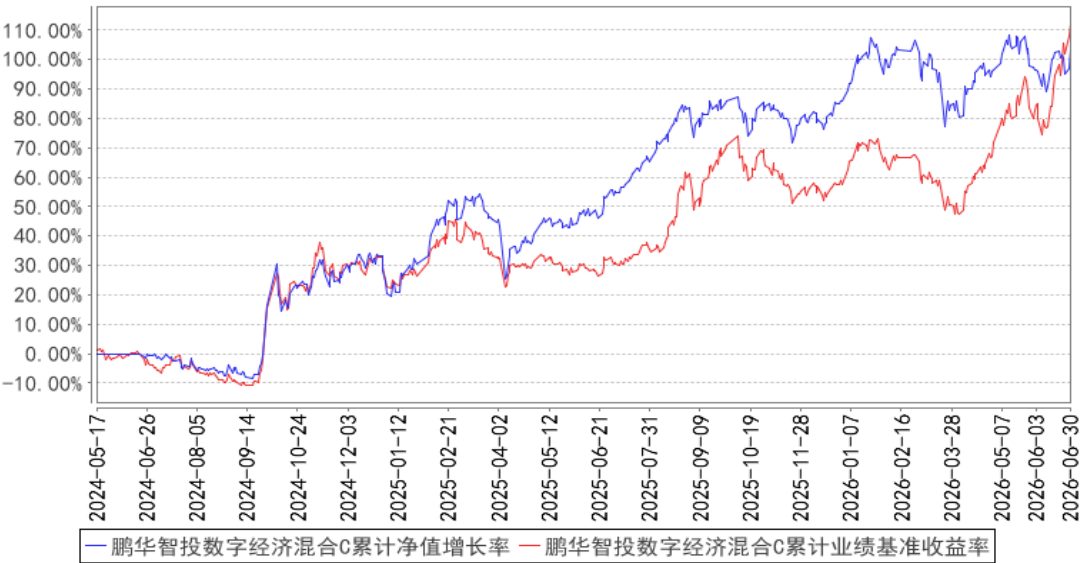
注：业绩比较基准=中证数字经济主题指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中债综合财富（总值）指数收益率×20%。

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

鹏华智投数字经济混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华智投数字经济混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2024 年 05 月 17 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比

例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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 15,047 亿元，公司管理着 410 只公募基金，23 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的经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏俊杰	本基金的基金经理	2024-05-17	-	14 年	苏俊杰先生, 国籍中国, 理学硕士, 14 年证券从业经验。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 2026 年 03 月担任鹏华沪深 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 2026 年 03 月担任鹏华沪深 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 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。
--	--	--	--	--	--

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

注：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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% 的交易共有 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

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

2026 年上半年 A 股呈现极强结构性分化行情，市场经历了春季上行、中期回调、二季度末科技加速上涨的过程，资金集中涌向高景气成长赛道，成长板块大幅领跑。从行业赛道来看，行情主要由 AI 产业浪潮、半导体国产替代驱动，电子、通信板块领涨全市场，算力、芯片、先进封装等赛道资金高度集聚，呈现出极致的动量和成长风格，赚钱效应主要集中在少数科技成长赛道以及少数的个股上。

投资运作上，我们通过量化模型综合基本面、量价、另类数据等 alpha 因子，聚焦数字经济产业链的相关标的进行优选，一季度整体超额收益保持了相对的稳定，但二季度市场行情的极致分化，导致了组合相对基准的超额收益出现一定的回撤，由于量化策略持仓天然比较分散，同时模型倾向超配基本面优秀的低波个股，组合在本季度科技主升浪的成长高波行情中处于劣势。展望下半年，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，尽管短期遇到挑战，我们对模型的长期有效性仍然有信心，随着科技赛道交易拥挤度的见顶回落，超额收益有望回归；此外我们也将持续挖掘新的 alpha 因子，力争在中长期实现相对基准的超额收益。

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9.71%,同期业绩比较基准增长率为34.29%;C类份额净值增长率为9.39%,同期业绩比较基准增长率为34.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济总体平淡,海外加息预期多有摇摆。国内经济依然呈现外需强、内需弱的态势,经济的积极变化在于消费补贴的透支效应正在消退,房价走低带来的资产负债表拖累也在缓解,宏观政策保持发力空间和一定的宽松概率,经济预期有望保持平稳甚至略有改善。在中东局势多有波折的背景下,通胀和就业数据有望反复拉扯美联储加息预期,加息预期的摇摆也是3季度最重要的海外宏观背景。虽然市场在交易美联储9月加息,但经济和就业数据难以支撑如此快速的加息。

A股波动加大,下半年有望走出震荡修复行情。A股因前期过度极致的交易和持仓结构而带来脆弱性和风险的提升,在海外出现宏观预期变化、产业扰动和情绪外溢时,叠加巨型IPO产生的流动性虹吸效应,国内科技成长方向出现大幅调整,并伴随着主被动去杠杆和流动性冲击。在宏观和产业趋势并未显著改变的背景下,风险的快速释放和流动性冲击也带来了良好的配置性机会,下半年市场有望走出“V”型震荡修复和高位震荡的行情。

科技不再一枝独秀,再平衡将带来更广泛的机会。经历了5-7月科技方向流动性虹吸和流动性释放的过程,科技在下半年可能难以重现一枝独秀的行情,科技依然是景气度最高的方向之一,但板块内部将因基本面和产业趋势而出现分化,科技和其他板块之间的差距也将有所收敛。投资者预期的再校准和资金的再平衡有望带来更广泛的投资机会。特别是前期经过持续调整和流动性虹吸冲击下的部分经济相关板块,有望迎来配置型资金流入和修复性行情。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，鹏华智投数字经济混合 A 期末可供分配利润为 10,542,808.29 元，期末基金份额净值 2.0601 元；鹏华智投数字经济混合 C 期末可供分配利润为 12,664,599.15 元，期末基金份额净值 2.0339 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2026 年 06 月 02 日至 2026 年 06 月 30 日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、

准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华智投数字经济混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,928,709.75	7,849,419.23
结算备付金		221,718.45	372,092.05
存出保证金		27,750.96	175,701.55
交易性金融资产	6.4.7.2	38,255,664.77	64,621,880.56
其中：股票投资		38,255,664.77	64,621,880.56
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		3,624,479.87	-
应收股利		-	-
应收申购款		25,122.95	24,717.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		46,083,446.75	73,043,810.58
负 债 和 净 资 产			
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		-	0.04
应付赎回款		475,840.07	902,265.48
应付管理人报酬		46,338.62	79,003.04
应付托管费		7,723.11	13,167.17
应付销售服务费		12,427.64	20,293.54
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	138,993.05	283,341.46
负债合计		681,322.49	1,298,070.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	22,194,716.82	38,398,018.63
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	23,207,407.44	33,347,721.22
净资产合计		45,402,124.26	71,745,739.85
负债和净资产总计		46,083,446.75	73,043,810.58

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额为 22,194,716.82 份，其中鹏华智投数字经济混合 A 基金份额总额为 9,944,985.94 份，基金份额净值 2.0601 元；鹏华智投数字经济混合 C 基金份额总额为 12,249,730.88 份，基金份额净值 2.0339 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华智投数字经济混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,949,373.60	8,068,997.79
1. 利息收入		13,096.50	12,371.44
其中：存款利息收入	6.4.7.13	13,096.50	12,371.44
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）		7,401,315.15	7,166,563.91
其中：股票投资收益	6.4.7.14	7,136,593.28	6,778,745.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-

资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	264,721.87	387,818.83
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,577,806.13	647,237.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	112,768.08	242,825.35
减：二、营业总支出		615,332.74	438,977.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	388,406.13	236,077.67
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	64,734.39	39,346.28
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	106,376.14	106,263.51
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	55,816.08	57,290.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,334,040.86	7,630,020.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,334,040.86	7,630,020.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,334,040.86	7,630,020.02

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华智投数字经济混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	38,398,018.63	-	33,347,721.22	71,745,739.85
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	38,398,018.63	-	33,347,721.22	71,745,739.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-16,203,301.81	-	-10,140,313.78	-26,343,615.59
(一)、综合收益总额	-	-	5,334,040.86	5,334,040.86
(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)	-16,203,301.81	-	-15,474,354.64	-31,677,656.45
其中：1. 基金申购款	20,698,954.82	-	20,712,541.24	41,411,496.06
2. 基金赎回款	-36,902,256.63	-	-36,186,895.88	-73,089,152.51
(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	22,194,716.82	-	23,207,407.44	45,402,124.26
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	14,388,682.50	-	4,055,445.08	18,444,127.58
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	14,388,682.50	-	4,055,445.08	18,444,127.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	713,480.33	-	4,400,176.38	5,113,656.71
(一)、综合收益总额	-	-	7,630,020.02	7,630,020.02
(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)	713,480.33	-	-3,229,843.64	-2,516,363.31
其中：1. 基金申购款	89,407,801.16	-	39,650,229.71	129,058,030.87
2. 基金赎回款	-88,694,320.83	-	-42,880,073.35	-131,574,394.18
(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	15,102,162.83	-	8,455,621.46	23,557,784.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>邓召明</u>	<u>聂连杰</u>	<u>郝文高</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华智投数字经济混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]2469 号《关于准予鹏华智投数字经济混合型证券投资基金注册的批复》准予，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华

智投数字经济混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，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 226,286,858.38 元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(24)第 00079 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金合同》于 2024 年 5 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 226,463,076.83 份基金份额，其中认购资金利息折合 176,218.45 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、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《公开募集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》和《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金合同》以及在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》和财政部、国家税务总局财税

[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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，截至 2027 年 12 月 31 日适用简易计税方法，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，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；对金融同业往来利息收入，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；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。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	3,928,709.75
等于：本金	3,928,321.98
加：应计利息	387.77
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,928,709.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		38,284,723.01	-	38,255,664.77	-29,058.24
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		38,284,723.01	-	38,255,664.77	-29,058.24

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	361.58
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	84,083.50
其中：交易所市场	84,083.50
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	54,547.97
合计	138,993.05

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华智投数字经济混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,104,236.63	19,104,236.63
本期申购	5,687,699.64	5,687,699.64
本期赎回（以“-”号填列）	-14,846,950.33	-14,846,950.33
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	9,944,985.94	9,944,985.94
-----	--------------	--------------

鹏华智投数字经济混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,293,782.00	19,293,782.00
本期申购	15,011,255.18	15,011,255.18
本期赎回（以“-”号填列）	-22,055,306.30	-22,055,306.30
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	12,249,730.88	12,249,730.88

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

鹏华智投数字经济混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,766,598.97	-6,998,583.48	16,768,015.49
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	23,766,598.97	-6,998,583.48	16,768,015.49
本期利润	3,172,102.94	-187,601.75	2,984,501.19
本期基金份额交易产生的变动数	-12,512,949.60	3,303,241.21	-9,209,708.39
其中：基金申购款	7,517,999.99	-1,737,485.07	5,780,514.92
基金赎回款	-20,030,949.59	5,040,726.28	-14,990,223.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,425,752.31	-3,882,944.02	10,542,808.29

鹏华智投数字经济混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,627,899.44	-7,048,193.71	16,579,705.73
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	23,627,899.44	-7,048,193.71	16,579,705.73
本期利润	3,739,744.05	-1,390,204.38	2,349,539.67
本期基金份额交易产	-9,936,385.66	3,671,739.41	-6,264,646.25

生的变动数			
其中：基金申购款	19,302,843.39	-4,370,817.07	14,932,026.32
基金赎回款	-29,239,229.05	8,042,556.48	-21,196,672.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,431,257.83	-4,766,658.68	12,664,599.15

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,364.65
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	483.92
其他	247.93
合计	13,096.50

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,136,593.28
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	7,136,593.28

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	223,203,949.68
减：卖出股票成本总额	215,742,444.91
减：交易费用	324,911.49
买卖股票差价收入	7,136,593.28

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	264,721.87
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	264,721.87

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,577,806.13
股票投资	-1,577,806.13
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,577,806.13

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	103,850.91
基金转换费收入	8,917.17
合计	112,768.08

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

审计费用	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,259.21
存托服务费	8.90
合计	55,816.08

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	388,406.13	236,077.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	176,936.75	110,638.42
应支付基金管理人的净管理费	211,469.38	125,439.25

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 1.20%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.20%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	64,734.39	39,346.28

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华智投数字经济混 合 A	鹏华智投数字经济混 合 C	合计
国信证券	—	50.94	50.94
鹏华基金公司	—	2,948.14	2,948.14
中国农业银行	—	36,549.46	36,549.46

合计	-	39,548.54	39,548.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华智投数字经济混合 A	鹏华智投数字经济混合 C	合计
国信证券	-	255.95	255.95
鹏华基金公司	-	1,487.39	1,487.39
中国农业银行	-	3,414.92	3,414.92
合计	-	5,158.26	5,158.26

注：鹏华智投数字经济混合 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华智投数字经济混合 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.6%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.6%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3,928,709.75	12,364.65	3,532,521.30	11,892.71

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	600	493,876.00	527,718.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业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 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2025 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到

期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,928,709.75	-	-	-	3,928,709.75
结算备付金	221,718.45	-	-	-	221,718.45
存出保证金	27,750.96	-	-	-	27,750.96
交易性金融资产	-	-	-	38,255,664.77	38,255,664.77
应收申购款	-	-	-	25,122.95	25,122.95
应收清算款	-	-	-	3,624,479.87	3,624,479.87
资产总计	4,178,179.16	-	-	41,905,267.59	46,083,446.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	475,840.07	475,840.07
应付管理人报酬	-	-	-	46,338.62	46,338.62
应付托管费	-	-	-	7,723.11	7,723.11
应付销售服务费	-	-	-	12,427.64	12,427.64
其他负债	-	-	-	138,993.05	138,993.05
负债总计	-	-	-	681,322.49	681,322.49
利率敏感度缺口	4,178,179.16	-	-	41,223,945.10	45,402,124.26
上年度末 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	7,849,419.23	-	-	-	7,849,419.23
结算备付金	372,092.05	-	-	-	372,092.05
存出保证金	175,701.55	-	-	-	175,701.55
交易性金融资产	-	-	-	64,621,880.56	64,621,880.56
应收申购款	-	-	-	24,717.19	24,717.19
资产总计	8,397,212.83	-	-	64,646,597.75	73,043,810.58

负债					
应付赎回款	-	-	-	902,265.48	902,265.48
应付管理人报酬	-	-	-	79,003.04	79,003.04
应付托管费	-	-	-	13,167.17	13,167.17
应付清算款	-	-	-	0.04	0.04
应付销售服务费	-	-	-	20,293.54	20,293.54
其他负债	-	-	-	283,341.46	283,341.46
负债总计	-	-	-	1,298,070.73	1,298,070.73
利率敏感度缺口	8,397,212.83	-	-	63,348,527.02	71,745,739.85

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 60%-95%（其中，投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%），投

资于本基金界定的数字经济主题相关股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	38,255,664.77	84.26	64,621,880.56	90.07
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	38,255,664.77	84.26	64,621,880.56	90.07

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	2,241,502.87	4,509,937.21

	比较基准下降 5% 资产净值变动	-2, 241, 502. 87	-4, 509, 937. 21
--	---------------------	------------------	------------------

注：无。

6. 4. 13. 4. 4 采用风险价值法管理风险

无。

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	37, 727, 946. 77
第二层次	527, 718. 00
第三层次	-
合计	38, 255, 664. 77

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	38,255,664.77	83.01
	其中：股票	38,255,664.77	83.01
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	4,150,428.20	9.01
8	其他各项资产	3,677,353.78	7.98
9	合计	46,083,446.75	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：38,150.00 元，占净值比 0.08%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,549,526.45	58.48

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	388,237.00	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	530,929.00	1.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,689,678.12	19.14
J	金融业	1,143,854.00	2.52
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	528,115.20	1.16
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	22,842.00	0.05
Q	卫生和社会工作	96,162.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	292,889.00	0.65
S	综合	13,432.00	0.03
	合计	38,255,664.77	84.26

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	688256	寒武纪	1,000	1,595,550.00	3.51
2	603986	兆易创新	1,800	1,467,000.00	3.23
3	688041	海光信息	2,400	888,720.00	1.96
4	002371	北方华创	1,000	884,560.00	1.95
5	688008	澜起科技	2,800	867,720.00	1.91
6	688981	中芯国际	4,800	762,336.00	1.68
7	688012	中微公司	1,600	749,600.00	1.65
8	300059	东方财富	28,300	576,754.00	1.27
9	002415	海康威视	16,500	564,300.00	1.24
10	688072	拓荆科技	600	527,718.00	1.16
11	300408	三环集团	3,100	517,390.00	1.14
12	300661	圣邦股份	2,700	387,396.00	0.85
13	688416	恒烁股份	2,720	380,800.00	0.84
14	688110	东芯股份	1,800	366,660.00	0.81
15	600460	士兰微	6,700	366,222.00	0.81
16	002049	紫光国微	4,100	363,875.00	0.80

17	688396	华润微	3,700	360,935.00	0.79
18	000938	紫光股份	12,300	354,978.00	0.78
19	688556	高测股份	19,700	261,616.00	0.58
20	301536	星辰科技	2,000	257,420.00	0.57
21	002558	巨人网络	9,100	250,796.00	0.55
22	002236	大华股份	14,900	245,701.00	0.54
23	002841	视源股份	6,800	234,804.00	0.52
24	688499	利元亨	4,455	234,110.25	0.52
25	300124	汇川技术	3,500	232,155.00	0.51
26	001314	亿道信息	3,700	228,660.00	0.50
27	300270	中威电子	17,400	226,374.00	0.50
28	688521	芯原股份	600	222,684.00	0.49
29	300033	同花顺	900	216,900.00	0.48
30	002468	申通快递	14,800	215,488.00	0.47
31	688559	海目星	2,500	209,800.00	0.46
32	688328	深科达	2,157	206,424.90	0.45
33	300911	亿田智能	9,200	195,500.00	0.43
34	301248	杰创智能	2,300	193,039.00	0.43
35	002587	奥拓电子	24,700	192,907.00	0.42
36	600570	恒生电子	9,100	192,829.00	0.42
37	000776	广发证券	8,000	187,200.00	0.41
38	002230	科大讯飞	4,500	183,780.00	0.40
39	600699	均胜电子	8,500	183,685.00	0.40
40	688682	霍莱沃	4,600	178,940.00	0.39
41	603296	华勤技术	2,400	178,248.00	0.39
42	300223	北京君正	700	174,230.00	0.38
43	300290	ST 荣科	25,900	172,235.00	0.38
44	688343	云天励飞-U	2,100	171,486.00	0.38
45	688031	星环科技-U	1,400	161,252.00	0.36
46	688702	盛科通信-U	400	155,996.00	0.34
47	300496	中科创达	2,500	154,475.00	0.34
48	002624	完美世界	12,400	154,008.00	0.34
49	600343	航天动力	5,400	151,308.00	0.33
50	002008	大族激光	1,000	150,110.00	0.33
51	000810	创维数字	11,300	149,725.00	0.33
52	301117	佳缘科技	6,400	149,440.00	0.33
53	688002	睿创微纳	956	147,883.64	0.33
54	600999	招商证券	7,000	147,700.00	0.33
55	688188	柏楚电子	1,340	142,978.00	0.31
56	603063	禾望电气	2,700	142,803.00	0.31
57	688095	福昕软件	2,400	142,632.00	0.31
58	605168	三人行	2,800	141,792.00	0.31
59	000338	潍柴动力	5,200	141,700.00	0.31

60	300766	每日互动	6,500	139,100.00	0.31
61	301489	思泉新材	840	138,247.20	0.30
62	300866	安克创新	1,300	135,850.00	0.30
63	300078	思创智联	45,200	134,244.00	0.30
64	300302	同有科技	2,600	133,042.00	0.29
65	000977	浪潮信息	1,900	133,000.00	0.29
66	002803	吉宏股份	5,100	131,784.00	0.29
67	300424	航新科技	8,300	130,642.00	0.29
68	600885	宏发股份	3,760	129,682.40	0.29
69	300571	平治信息	2,800	127,848.00	0.28
70	300369	绿盟科技	23,300	126,752.00	0.28
71	688173	希荻微	6,277	120,141.78	0.26
72	600233	圆通速递	7,600	119,700.00	0.26
73	300393	中来股份	16,400	119,556.00	0.26
74	688001	华兴源创	1,395	119,551.50	0.26
75	301095	广立微	1,000	118,050.00	0.26
76	300750	宁德时代	300	117,903.00	0.26
77	688777	中控技术	1,000	117,500.00	0.26
78	300585	奥联电子	7,100	115,943.00	0.26
79	300592	华凯易佰	6,500	115,050.00	0.25
80	300206	理邦仪器	9,400	114,962.00	0.25
81	001266	宏英智能	2,300	112,930.00	0.25
82	001339	智微智能	1,100	112,508.00	0.25
83	300467	迅游科技	3,000	111,540.00	0.25
84	600482	中国动力	3,400	111,520.00	0.25
85	600060	海信视像	4,000	111,480.00	0.25
86	300782	卓胜微	1,000	109,580.00	0.24
87	300843	胜蓝股份	700	109,375.00	0.24
88	688316	青云科技-U	2,000	108,000.00	0.24
89	002796	世嘉科技	2,600	106,028.00	0.23
90	301039	中集车辆	14,900	105,045.00	0.23
91	688609	九联科技	9,300	102,393.00	0.23
92	603803	瑞斯康达	8,700	102,138.00	0.22
93	301002	崧盛股份	2,600	100,360.00	0.22
94	300432	富临精工	4,980	100,048.20	0.22
95	002284	亚太股份	10,400	98,696.00	0.22
96	300413	芒果超媒	6,700	98,021.00	0.22
97	300846	首都在线	4,600	97,566.00	0.21
98	300454	深信服	1,000	96,200.00	0.21
99	605117	德业股份	900	95,562.00	0.21
100	002101	广东鸿图	10,000	95,400.00	0.21
101	300780	德恩精工	2,800	95,368.00	0.21
102	688420	美腾科技	4,500	94,815.00	0.21

103	688025	杰普特	200	94,000.00	0.21
104	603507	振江股份	2,800	92,092.00	0.20
105	301172	君逸数码	3,500	90,825.00	0.20
106	300479	神思电子	6,700	90,718.00	0.20
107	603042	华脉科技	6,120	88,128.00	0.19
108	688518	联赢激光	2,845	87,910.50	0.19
109	002367	康力电梯	12,700	87,757.00	0.19
110	300448	浩云科技	14,900	85,824.00	0.19
111	688620	安凯微	5,284	85,600.80	0.19
112	603501	豪威集团	900	85,365.00	0.19
113	688365	光云科技	5,400	85,158.00	0.19
114	688369	致远互联	3,991	83,850.91	0.18
115	600288	大恒科技	6,300	83,790.00	0.18
116	600271	航天信息	12,600	82,908.00	0.18
117	601126	四方股份	1,300	82,160.00	0.18
118	002876	三利谱	2,300	80,983.00	0.18
119	300830	金现代	10,000	79,400.00	0.17
120	300373	扬杰科技	500	78,615.00	0.17
121	002245	蔚蓝锂芯	4,164	77,908.44	0.17
122	301025	读客文化	10,000	77,600.00	0.17
123	300773	拉卡拉	5,000	76,500.00	0.17
124	688381	帝奥微	1,379	73,776.50	0.16
125	003029	吉大正元	4,600	73,692.00	0.16
126	002410	广联达	9,000	73,440.00	0.16
127	000050	深天马 A	7,400	73,334.00	0.16
128	300244	迪安诊断	3,900	73,086.00	0.16
129	002690	美亚光电	5,100	73,083.00	0.16
130	301302	华如科技	2,700	72,684.00	0.16
131	000555	神州信息	7,000	72,100.00	0.16
132	688391	钜泉科技	2,008	72,026.96	0.16
133	688220	翱捷科技-U	578	71,856.96	0.16
134	300364	中文在线	3,000	70,770.00	0.16
135	300252	金信诺	4,100	70,725.00	0.16
136	301169	零点有数	1,000	70,660.00	0.16
137	688595	芯海科技	1,600	70,176.00	0.15
138	002518	科士达	1,300	69,667.00	0.15
139	300358	楚天科技	8,700	69,600.00	0.15
140	688035	德邦科技	744	68,299.20	0.15
141	301360	荣旗科技	990	67,805.10	0.15
142	688191	智洋创新	1,880	67,116.00	0.15
143	300030	阳普医疗	11,500	66,815.00	0.15
144	300299	富春股份	13,600	66,640.00	0.15
145	603283	赛腾股份	820	66,403.60	0.15

146	300882	万胜智能	4,000	66,320.00	0.15
147	688023	安恒信息	1,800	66,096.00	0.15
148	688125	安达智能	400	65,400.00	0.14
149	002396	星网锐捷	3,410	65,369.70	0.14
150	002520	日发精机	9,400	64,954.00	0.14
151	688155	先惠技术	800	64,712.00	0.14
152	000581	威孚高科	3,800	64,676.00	0.14
153	603329	上海雅仕	7,200	64,656.00	0.14
154	300613	富瀚微	800	64,064.00	0.14
155	603713	密尔克卫	900	64,053.00	0.14
156	002990	盛视科技	800	63,200.00	0.14
157	002079	苏州固锔	4,200	63,126.00	0.14
158	300397	天和防务	4,100	62,074.00	0.14
159	603556	海兴电力	2,800	61,600.00	0.14
160	000404	长虹华意	7,800	61,308.00	0.14
161	301315	威士顿	1,600	61,088.00	0.13
162	002025	航天电器	800	60,976.00	0.13
163	688051	佳华科技	2,647	60,828.06	0.13
164	300884	狄耐克	6,000	59,520.00	0.13
165	002555	三七互娱	3,100	58,497.00	0.13
166	000550	江铃汽车	3,600	58,392.00	0.13
167	301337	亚华电子	2,100	58,380.00	0.13
168	601567	三星电气	3,900	58,266.00	0.13
169	300322	硕贝德	2,300	57,960.00	0.13
170	000636	风华高科	800	57,792.00	0.13
171	002376	新北洋	10,000	57,500.00	0.13
172	603679	华体科技	2,800	56,504.00	0.12
173	600501	航天晨光	3,500	55,055.00	0.12
174	300133	华策影视	7,700	54,516.00	0.12
175	002414	高德红外	4,100	54,366.00	0.12
176	601888	中国中免	1,000	53,710.00	0.12
177	002373	千方科技	7,400	53,132.00	0.12
178	300976	达瑞电子	660	52,569.00	0.12
179	300579	数字认证	2,500	51,750.00	0.11
180	601360	三六零	5,900	51,271.00	0.11
181	300602	飞荣达	1,000	51,200.00	0.11
182	002544	普天科技	2,800	51,016.00	0.11
183	002436	兴森科技	1,000	50,950.00	0.11
184	002849	威星智能	3,000	50,760.00	0.11
185	603486	科沃斯	1,000	50,750.00	0.11
186	300951	博硕科技	1,000	50,500.00	0.11
187	300324	旋极信息	13,500	50,220.00	0.11
188	002434	万里扬	8,300	50,215.00	0.11

189	300605	恒锋信息	5,400	49,896.00	0.11
190	300442	润泽科技	600	49,842.00	0.11
191	002733	雄韬股份	1,600	49,568.00	0.11
192	002858	力盛体育	4,500	49,095.00	0.11
193	002757	南兴股份	2,700	48,735.00	0.11
194	688653	康希通信	2,800	48,664.00	0.11
195	603611	诺力股份	3,000	48,570.00	0.11
196	300747	锐科激光	900	47,781.00	0.11
197	603203	快克智能	620	47,603.60	0.10
198	300771	智莱科技	4,600	47,472.00	0.10
199	688049	炬芯科技	1,000	46,910.00	0.10
200	605358	立昂微	600	46,560.00	0.10
201	688561	奇安信-U	1,900	45,562.00	0.10
202	688084	晶品特装	900	45,252.00	0.10
203	301313	凡拓数创	900	45,144.00	0.10
204	603035	常熟汽饰	4,200	44,604.00	0.10
205	002925	盈趣科技	1,800	44,388.00	0.10
206	301321	翰博高新	1,000	44,150.00	0.10
207	002023	海特高新	3,400	44,064.00	0.10
208	002937	兴瑞科技	1,000	43,930.00	0.10
209	300873	海晨股份	1,300	43,901.00	0.10
210	002138	顺络电子	600	43,860.00	0.10
211	688262	国芯科技	1,000	43,230.00	0.10
212	300706	阿石创	500	43,175.00	0.10
213	300048	合康新能	9,200	42,964.00	0.09
214	688111	金山办公	200	42,610.00	0.09
215	688579	地纬智能	5,597	42,481.23	0.09
216	000925	众合科技	4,500	42,030.00	0.09
217	002446	盛路通信	3,900	41,886.00	0.09
218	002960	青鸟智控	4,940	41,841.80	0.09
219	300415	伊之密	2,100	41,811.00	0.09
220	688458	美芯晟	1,000	41,760.00	0.09
221	688093	世华科技	1,119	41,291.10	0.09
222	300607	拓斯达	1,000	41,230.00	0.09
223	603135	中重科技	3,400	41,140.00	0.09
224	688015	交控科技	2,674	41,126.12	0.09
225	688475	萤石网络	1,500	41,025.00	0.09
226	300429	强力新材	2,300	40,756.00	0.09
227	002920	德赛西威	500	40,750.00	0.09
228	600388	龙净环保	2,800	40,740.00	0.09
229	688126	沪硅产业	1,000	39,890.00	0.09
230	002010	传化智联	8,800	39,336.00	0.09
231	600761	安徽合力	2,400	39,264.00	0.09

232	603901	永创智能	3,600	39,132.00	0.09
233	688626	翔宇医疗	875	38,727.50	0.09
234	688195	腾景科技	200	38,516.00	0.08
235	301328	维峰电子	540	38,448.00	0.08
236	603298	杭叉集团	1,600	38,176.00	0.08
237	689009	九号公司-WD	1,000	38,150.00	0.08
238	002090	金智科技	4,300	38,012.00	0.08
239	300811	铂科新材	400	37,956.00	0.08
240	688070	纵横股份	1,000	37,330.00	0.08
241	002747	埃斯顿	1,000	37,330.00	0.08
242	300681	英搏尔	1,300	37,206.00	0.08
243	603270	金帝股份	1,100	36,861.00	0.08
244	002579	中京电子	1,700	36,856.00	0.08
245	603068	博通集成	900	36,207.00	0.08
246	603380	易德龙	800	36,072.00	0.08
247	688772	珠海冠宇	1,824	35,805.12	0.08
248	002273	水晶光电	1,000	35,480.00	0.08
249	301031	中熔电气	296	35,357.20	0.08
250	300168	万达信息	7,700	35,343.00	0.08
251	603012	创力集团	4,300	35,260.00	0.08
252	301195	北路智控	1,300	35,230.00	0.08
253	002897	意华股份	400	35,192.00	0.08
254	301029	怡合达	1,300	35,113.00	0.08
255	688225	亚信安全	2,800	34,776.00	0.08
256	300248	新开普	4,500	34,695.00	0.08
257	300053	航宇微	2,100	34,545.00	0.08
258	600728	佳都科技	8,100	34,506.00	0.08
259	688589	力合微	1,500	34,470.00	0.08
260	300240	飞力达	6,900	34,431.00	0.08
261	603338	浙江鼎力	800	34,000.00	0.07
262	300790	宇瞳光学	1,300	33,943.00	0.07
263	301280	珠城科技	660	33,376.20	0.07
264	002161	远望谷	6,200	33,356.00	0.07
265	603569	长久物流	6,200	32,860.00	0.07
266	603118	共进股份	2,700	32,697.00	0.07
267	002902	铭普光磁	1,100	32,626.00	0.07
268	002401	中远海科	2,800	32,508.00	0.07
269	300246	宝莱特	2,300	32,361.00	0.07
270	601100	恒立液压	300	32,268.00	0.07
271	688153	唯捷创芯	1,000	32,120.00	0.07
272	300327	中颖电子	1,000	32,050.00	0.07
273	002913	奥士康	500	31,970.00	0.07
274	002151	北斗星通	1,000	31,750.00	0.07

275	002959	小熊电器	1,000	31,720.00	0.07
276	300036	超图软件	2,800	31,556.00	0.07
277	002484	江海股份	300	31,500.00	0.07
278	600372	中航机载	2,900	31,465.00	0.07
279	688259	创耀科技	801	31,335.12	0.07
280	002063	远光软件	6,100	31,110.00	0.07
281	301138	华研精机	1,000	31,000.00	0.07
282	600893	航发动力	800	30,672.00	0.07
283	300550	和仁科技	2,300	30,659.00	0.07
284	002706	良信股份	2,800	30,548.00	0.07
285	002419	天虹股份	7,200	30,456.00	0.07
286	300490	华自科技	2,300	30,429.00	0.07
287	600869	远东股份	900	30,123.00	0.07
288	603915	国茂股份	2,100	29,799.00	0.07
289	300552	万集科技	1,300	29,705.00	0.07
290	300018	中元股份	2,400	29,640.00	0.07
291	300654	世纪天鸿	3,000	29,160.00	0.06
292	002137	实益达	2,500	28,750.00	0.06
293	002993	奥海科技	400	28,644.00	0.06
294	002338	奥普光电	500	28,600.00	0.06
295	000157	中联重科	4,100	28,577.00	0.06
296	002935	天奥电子	1,300	28,522.00	0.06
297	688385	复旦微电	400	28,516.00	0.06
298	300331	苏大维格	400	28,444.00	0.06
299	000733	振华科技	500	28,320.00	0.06
300	002556	辉隆股份	6,300	28,224.00	0.06
301	605186	健麾信息	900	28,224.00	0.06
302	002602	世纪华通	2,000	28,200.00	0.06
303	300629	新劲刚	1,300	27,898.00	0.06
304	603305	旭升集团	2,300	27,876.00	0.06
305	300853	申昊科技	900	27,801.00	0.06
306	603890	春秋电子	1,000	27,620.00	0.06
307	002906	华阳集团	1,100	27,456.00	0.06
308	688358	祥生医疗	897	27,421.29	0.06
309	301101	明月镜片	1,000	27,240.00	0.06
310	002152	广电运通	2,900	27,202.00	0.06
311	300662	科锐国际	1,600	27,168.00	0.06
312	300688	创业黑马	1,000	27,100.00	0.06
313	301608	博实结	531	26,688.06	0.06
314	688159	有方科技	600	26,634.00	0.06
315	688100	威胜信息	870	26,613.30	0.06
316	600057	厦门象屿	4,900	26,558.00	0.06
317	002405	四维图新	4,100	26,527.00	0.06

318	300565	科信技术	2,600	26,468.00	0.06
319	688079	美迪凯	860	26,445.00	0.06
320	301221	光庭信息	880	25,968.80	0.06
321	300099	尤洛卡	4,100	25,912.00	0.06
322	600480	凌云股份	3,110	25,844.10	0.06
323	002402	和而泰	1,000	25,830.00	0.06
324	688562	航天软件	1,700	25,602.00	0.06
325	301510	固高科技	800	25,544.00	0.06
326	002334	英威腾	3,600	25,524.00	0.06
327	002576	通达动力	1,800	25,470.00	0.06
328	601038	一拖股份	2,400	25,416.00	0.06
329	300349	金卡智能	2,300	25,162.00	0.06
330	300978	东箭科技	3,100	25,141.00	0.06
331	301330	熵基科技	1,000	25,060.00	0.06
332	600990	四创电子	1,400	24,682.00	0.05
333	002819	东方中科	1,100	24,585.00	0.05
334	600843	上工申贝	2,800	24,080.00	0.05
335	688007	光峰科技	1,800	23,940.00	0.05
336	300458	全志科技	600	23,676.00	0.05
337	300279	和晶科技	3,900	23,595.00	0.05
338	002006	精工科技	1,600	23,536.00	0.05
339	300232	洲明科技	4,100	23,493.00	0.05
340	300515	三德科技	1,800	23,490.00	0.05
341	300440	运达科技	1,100	23,463.00	0.05
342	600212	绿能慧充	4,500	23,400.00	0.05
343	301311	昆船智能	1,800	23,382.00	0.05
344	600765	中航重机	1,800	23,256.00	0.05
345	300532	今天国际	3,730	23,237.90	0.05
346	002995	天地在线	1,300	22,984.00	0.05
347	300508	维宏股份	400	22,972.00	0.05
348	300445	康斯特	1,100	22,902.00	0.05
349	000526	学大教育	900	22,842.00	0.05
350	301456	盘古智能	1,000	22,580.00	0.05
351	301512	智信精密	500	22,500.00	0.05
352	605277	新亚电子	1,180	22,490.80	0.05
353	300964	本川智能	260	22,404.20	0.05
354	300533	冰川网络	1,360	22,304.00	0.05
355	300836	佰奥智能	300	22,197.00	0.05
356	600933	爱柯迪	1,500	22,170.00	0.05
357	301310	鑫宏业	400	22,096.00	0.05
358	603579	荣泰健康	1,300	22,061.00	0.05
359	002045	国光电器	2,800	21,980.00	0.05
360	603390	通达电气	2,100	21,924.00	0.05

361	002877	智能自控	3,100	21,824.00	0.05
362	688162	巨一科技	922	21,796.08	0.05
363	688208	道通科技	864	21,764.16	0.05
364	603596	伯特利	876	21,759.84	0.05
365	603766	隆鑫通用	1,800	21,474.00	0.05
366	300074	华平股份	6,300	21,420.00	0.05
367	301251	威尔高	400	21,312.00	0.05
368	603990	麦迪科技	1,000	21,290.00	0.05
369	300557	理工光科	615	21,174.45	0.05
370	300916	朗特智能	900	21,033.00	0.05
371	300987	川网传媒	1,700	20,910.00	0.05
372	002472	双环传动	500	20,755.00	0.05
373	600584	长电科技	200	20,710.00	0.05
374	002048	宁波华翔	900	20,700.00	0.05
375	603085	天成自控	1,900	20,653.00	0.05
376	002268	电科网安	1,600	20,640.00	0.05
377	603712	七一二	1,600	20,624.00	0.05
378	300371	汇中股份	2,100	20,538.00	0.05
379	603066	音飞储存	2,100	20,496.00	0.05
380	603786	科博达	500	20,455.00	0.05
381	688128	中国电研	836	19,846.64	0.04
382	002073	软控股份	3,800	19,532.00	0.04
383	300014	亿纬锂能	300	19,509.00	0.04
384	300693	盛弘股份	400	19,500.00	0.04
385	603666	亿嘉和	700	19,334.00	0.04
386	600100	同方股份	2,800	19,180.00	0.04
387	300457	赢合科技	900	18,972.00	0.04
388	300079	数码视讯	4,500	18,900.00	0.04
389	603373	安邦护卫	520	18,844.80	0.04
390	300400	劲拓股份	500	18,825.00	0.04
391	688557	兰剑智能	600	18,618.00	0.04
392	300446	航天智造	1,100	18,513.00	0.04
393	600826	兰生股份	2,100	18,459.00	0.04
394	688330	宏力达	541	18,302.03	0.04
395	603081	大丰实业	2,100	18,165.00	0.04
396	601799	星宇股份	200	18,124.00	0.04
397	688292	浩瀚深度	960	17,856.00	0.04
398	688232	新点软件	1,000	17,780.00	0.04
399	603025	大豪科技	1,300	17,732.00	0.04
400	002668	TCL 智家	1,600	17,728.00	0.04
401	002174	游族网络	1,400	17,654.00	0.04
402	603028	赛福天	2,700	17,469.00	0.04
403	300578	会畅科技	1,000	17,390.00	0.04

404	600031	三一重工	1,000	17,280.00	0.04
405	001283	豪鹏科技	350	17,157.00	0.04
406	002362	汉王科技	1,100	17,105.00	0.04
407	600776	东方通信	1,300	17,082.00	0.04
408	001316	润贝航科	500	16,490.00	0.04
409	688115	思林杰	200	16,450.00	0.04
410	003033	征和工业	300	16,353.00	0.04
411	002517	恺英网络	1,000	16,250.00	0.04
412	601231	环旭电子	500	16,200.00	0.04
413	600366	宁波韵升	1,100	16,148.00	0.04
414	002416	爱施德	1,800	16,128.00	0.04
415	300304	云意电气	900	16,065.00	0.04
416	002121	科陆电子	2,850	15,532.50	0.03
417	688251	井松智能	600	15,378.00	0.03
418	002463	沪电股份	100	15,280.00	0.03
419	002947	恒铭达	200	15,210.00	0.03
420	603788	宁波高发	1,100	15,180.00	0.03
421	300531	优博讯	1,000	15,150.00	0.03
422	300768	迪普科技	1,100	15,147.00	0.03
423	300001	特锐德	400	15,132.00	0.03
424	688360	德马科技	840	15,036.00	0.03
425	603660	苏州科达	1,200	14,700.00	0.03
426	300259	新天科技	2,200	14,586.00	0.03
427	600710	苏美达	1,500	14,340.00	0.03
428	300098	高新兴	3,100	14,229.00	0.03
429	002527	新时达	1,100	14,113.00	0.03
430	002044	美年健康	2,800	14,084.00	0.03
431	002475	立讯精密	200	14,080.00	0.03
432	301656	联合动力	814	14,025.22	0.03
433	603197	保隆科技	500	13,970.00	0.03
434	301199	迈赫股份	800	13,952.00	0.03
435	300897	山科智能	1,000	13,930.00	0.03
436	601717	中创智领	1,000	13,910.00	0.03
437	300222	科大智能	1,000	13,850.00	0.03
438	300203	聚光科技	1,000	13,830.00	0.03
439	002801	微光股份	500	13,800.00	0.03
440	301380	挖金客	500	13,795.00	0.03
441	002997	瑞鹄模具	500	13,780.00	0.03
442	002212	天融信	2,300	13,754.00	0.03
443	600673	东阳光	400	13,432.00	0.03
444	301185	鸥玛软件	900	13,374.00	0.03
445	601608	中信重工	2,800	13,356.00	0.03
446	603037	凯众股份	1,300	13,026.00	0.03

447	688083	中望软件	200	12,950.00	0.03
448	301320	豪江智能	1,000	12,900.00	0.03
449	300633	开立医疗	700	12,873.00	0.03
450	002337	赛象科技	2,900	12,847.00	0.03
451	002315	焦点科技	540	12,571.20	0.03
452	300145	南方泵业	2,300	12,535.00	0.03
453	688618	三旺通信	400	12,308.00	0.03
454	300083	创世纪	900	12,258.00	0.03
455	002184	海得控制	1,300	11,908.00	0.03
456	688036	传音控股	200	11,790.00	0.03
457	300360	炬华科技	1,000	11,750.00	0.03
458	603466	风语筑	1,200	11,748.00	0.03
459	002111	威海广泰	1,300	11,700.00	0.03
460	601615	明阳智能	1,000	11,570.00	0.03
461	300627	华测导航	400	11,360.00	0.03
462	300153	科泰电源	500	11,310.00	0.02
463	601555	东吴证券	1,400	11,088.00	0.02
464	300643	万通智控	600	10,734.00	0.02
465	002011	盾安环境	1,000	10,610.00	0.02
466	002664	信质集团	600	10,374.00	0.02
467	600835	上海机电	500	10,300.00	0.02
468	002279	久其软件	1,800	10,296.00	0.02
469	002380	科远智慧	300	10,254.00	0.02
470	300250	初灵信息	700	10,206.00	0.02
471	300296	利亚德	1,800	10,080.00	0.02
472	300150	世纪瑞尔	2,500	9,925.00	0.02
473	301110	青木科技	260	9,843.60	0.02
474	300207	欣旺达	500	9,495.00	0.02
475	300514	友讯达	1,000	9,350.00	0.02
476	603882	金域医学	400	8,992.00	0.02
477	601777	千里科技	1,100	8,976.00	0.02
478	688206	概伦电子	200	8,874.00	0.02
479	603656	泰禾智能	500	8,790.00	0.02
480	002829	星网宇达	500	8,780.00	0.02
481	002097	山河智能	1,200	8,676.00	0.02
482	603855	华荣股份	500	8,665.00	0.02
483	603648	畅联股份	1,000	8,580.00	0.02
484	688226	威腾电气	200	8,566.00	0.02
485	300494	盛天网络	1,000	8,430.00	0.02
486	002368	太极股份	600	8,394.00	0.02
487	300226	上海钢联	540	8,267.40	0.02
488	002845	同兴达	500	8,200.00	0.02
489	300043	星辉娱乐	1,800	7,830.00	0.02

490	001380	华纬科技	500	7,820.00	0.02
491	000829	天音控股	1,000	7,800.00	0.02
492	300249	依米康	500	7,700.00	0.02
493	601138	工业富联	100	7,215.00	0.02
494	001208	华菱线缆	500	7,095.00	0.02
495	300682	朗新科技	700	6,930.00	0.02
496	603583	捷昌驱动	300	6,840.00	0.02
497	600640	国脉文化	700	6,769.00	0.01
498	301153	中科江南	400	6,516.00	0.01
499	002649	博彦科技	800	6,512.00	0.01
500	600523	贵航股份	600	6,330.00	0.01
501	300770	新媒股份	200	6,298.00	0.01
502	301129	瑞纳智能	300	6,261.00	0.01
503	600522	中天科技	100	6,068.00	0.01
504	002335	科华数据	135	5,730.75	0.01
505	002065	东华软件	800	5,712.00	0.01
506	301011	华立科技	400	5,656.00	0.01
507	603383	顶点软件	200	5,312.00	0.01
508	300996	普联软件	484	5,270.76	0.01
509	300183	东软载波	500	5,225.00	0.01
510	600633	浙数文化	500	5,090.00	0.01
511	688038	中科通达	300	5,046.00	0.01
512	301339	通行宝	480	4,910.40	0.01
513	600718	东软集团	600	4,344.00	0.01
514	300590	移为通信	300	4,305.00	0.01
515	600517	国网英大	900	4,212.00	0.01
516	603106	恒银科技	600	4,170.00	0.01
517	000913	钱江摩托	400	4,100.00	0.01
518	300619	金银河	130	4,044.30	0.01
519	688207	格灵深瞳	200	4,020.00	0.01
520	002036	联创电子	500	3,785.00	0.01
521	603613	国联股份	200	3,684.00	0.01
522	603015	弘讯科技	300	3,645.00	0.01
523	300812	易天股份	120	3,517.20	0.01
524	002857	三晖电气	200	3,514.00	0.01
525	600850	电科数字	240	3,494.40	0.01
526	301078	孩子王	500	3,380.00	0.01
527	300101	振芯科技	200	3,234.00	0.01
528	603109	神驰机电	200	3,220.00	0.01
529	300510	金冠股份	1,000	3,120.00	0.01
530	603000	人民网	200	2,958.00	0.01
531	601012	隆基绿能	200	2,624.00	0.01
532	301270	汉仪股份	100	2,568.00	0.01

533	688327	云从科技-UW	200	2,492.00	0.01
534	300486	东杰智能	100	2,135.00	0.00
535	600219	南山铝业	500	1,995.00	0.00
536	002467	二六三	400	1,868.00	0.00
537	300126	锐奇股份	300	1,734.00	0.00
538	601677	明泰铝业	100	1,660.00	0.00
539	300507	苏奥传感	200	1,506.00	0.00
540	600986	浙文互联	200	1,396.00	0.00
541	002708	光洋股份	100	1,319.00	0.00
542	002539	云图控股	100	1,132.00	0.00
543	300543	朗科智能	100	721.00	0.00
544	000503	国新健康	100	615.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	1,808,216.00	2.52
2	603986	兆易创新	1,711,724.00	2.39
3	688095	福昕软件	1,588,247.69	2.21
4	688682	霍莱沃	1,479,180.76	2.06
5	300454	深信服	1,416,022.00	1.97
6	688559	海目星	1,357,684.84	1.89
7	688499	利元亨	1,268,710.43	1.77
8	002558	巨人网络	1,241,223.00	1.73
9	300244	迪安诊断	1,229,885.00	1.71
10	301095	广立微	1,209,627.00	1.69
11	300240	飞力达	1,175,255.00	1.64
12	300585	奥联电子	1,163,934.00	1.62
13	301248	杰创智能	1,162,683.00	1.62
14	002975	博杰股份	1,151,823.00	1.61
15	601126	四方股份	1,131,149.00	1.58
16	688031	星环科技-U	1,120,225.33	1.56
17	301110	青木科技	1,110,167.00	1.55
18	002008	大族激光	1,096,452.00	1.53
19	301489	思泉新材	1,083,423.00	1.51
20	688668	鼎通科技	1,047,233.15	1.46

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688095	福昕软件	1,716,261.07	2.39
2	002975	博杰股份	1,694,912.30	2.36

3	301095	广立微	1,694,043.00	2.36
4	300244	迪安诊断	1,582,923.00	2.21
5	002008	大族激光	1,580,718.00	2.20
6	301110	青木科技	1,481,860.80	2.07
7	300454	深信服	1,438,397.00	2.00
8	301313	凡拓数创	1,415,626.00	1.97
9	688559	海目星	1,388,408.24	1.94
10	688536	思瑞浦	1,353,458.19	1.89
11	688328	深科达	1,342,091.93	1.87
12	601126	四方股份	1,320,637.00	1.84
13	688084	晶品特装	1,310,116.46	1.83
14	688682	霍莱沃	1,298,259.54	1.81
15	605098	行动教育	1,292,567.00	1.80
16	301248	杰创智能	1,291,967.00	1.80
17	688288	鸿泉技术	1,252,177.60	1.75
18	002558	巨人网络	1,244,960.00	1.74
19	301338	凯格精机	1,223,437.00	1.71
20	688499	利元亨	1,177,124.03	1.64

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	190,954,035.25
卖出股票收入（成交）总额	223,203,949.68

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,750.96
2	应收清算款	3,624,479.87
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	25,122.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,677,353.78

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	527,718.00	1.16	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
鹏华智投数字经济混合 A	1,098	9,057.36	0.00	0.00	9,944,985.94	100.00
鹏华智投数字经济混合 C	1,793	6,831.97	215,146.30	1.76	12,034,584.58	98.24
合计	2,891	7,677.18	215,146.30	0.97	21,979,570.52	99.03

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	79.97

注：无。

8.3 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	鹏华智投数字经济混合 A	710,003.90	7.1393
	鹏华智投数字经济混合 C	24,211.99	0.1977
	合计	734,215.89	3.3081

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

8.4 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	鹏华智投数字经济混合 A	50~100
	鹏华智投数字经济混合 C	-
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏华智投数字经济混合 A	0~10
	鹏华智投数字经济混合 C	-
	合计	0~10

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华智投数字经济混合 A	鹏华智投数字经济混合 C
基金合同生效日 （2024 年 5 月 17 日）基金份额总额	50,027,235.78	176,435,841.05
本报告期期初基金份额总额	19,104,236.63	19,293,782.00
本报告期基金总申购份额	5,687,699.64	15,011,255.18
减：本报告期基金总赎回份额	14,846,950.33	22,055,306.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,944,985.94	12,249,730.88

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原副总经理李伟先生因个人原因辞职，经公司第六届董事会第三百三十八次会议审议通过，自 2026 年 4 月 3 日起，李伟先生不再担任公司副总经理。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
东方证券	1	184,101,368	44.45	83,015.35	44.45	-

		. 50				
长江证券	1	169, 925, 846 . 70	41. 03	76, 620. 38	41. 03	—
申万宏源 证券	3	52, 355, 522. 46	12. 64	23, 608. 28	12. 64	—
汇丰前海 证券	1	6, 017, 217. 2 7	1. 45	2, 713. 12	1. 45	—
中信证券	1	1, 758, 030. 0 0	0. 42	792. 70	0. 42	—
东吴证券	1	—	—	—	—	本 报 告 期 新 增
东兴证券	1	—	—	—	—	—
光大证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	1	—	—	—	—	—
国金证券	1	—	—	—	—	—
国泰海通 证券	1	—	—	—	—	—
国投证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
太平洋证 券	1	—	—	—	—	—
西南证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	1	—	—	—	—	—
银河证券	1	—	—	—	—	—
浙商证券	1	—	—	—	—	—
中金公司	1	—	—	—	—	—
中信建投 证券	1	—	—	—	—	—

注：交易单元选择的标准和程序：

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

2. 选择程序如下：

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

3. 根据《规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率；其他类型基金股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证	-	-	-	-	-	-

券						
银河证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华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	2026 年 01 月 17 日
2	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金 2025 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	2026 年 01 月 21 日
3	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	2026 年 01 月 24 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方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	2026 年 02 月 04 日
5	鹏华智投数字经济混合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	2026 年 03 月 04 日
6	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金（A 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《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	2026 年 03 月 04 日
7	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金（C 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《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	2026 年 03 月 04 日
8	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金 2025 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	2026 年 03 月 30 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下部	《中国证券报》、基金	2026 年 03 月 31 日

	分基金参与海南有知有行基金销售有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	
10	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	2026 年 04 月 04 日
11	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	2026 年 04 月 17 日
12	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金 2026 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	2026 年 04 月 21 日
13	鹏华基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《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	2026 年 05 月 30 日
14	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	2026 年 06 月 18 日
15	鹏华基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《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	2026 年 06 月 24 日

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）《鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华智投数字经济混合型证券投资基金托管协议》；

(三)《鹏华智投数字经济混合型证券投资基金 2026 年中期报告》(原文)。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日