

鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	11
§ 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	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	66

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	66
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	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	67
§ 8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	68
§ 9 开放式基金份额变动	69
§ 10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	70
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	70
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 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	1,721,998,778.17 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	970,843,373.72 份	749,255,389.99 份	1,900,014.46 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	1、股票投资策略 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。 （1）多因子量化选股模型 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。 （2）风险控制与调整 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

	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。 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%。 （3）投资组合优化模型 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。 2、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。 3、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。 4、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。 5、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。 6、参与融资及转融通证券出借业务策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。
业绩比较基准	中证 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)		
	鹏华中证 1000 指数增强 A	鹏华中证 1000 指数增强 C	鹏华中证 1000 指数增强 I
本期已实现收益	270,746,775.94	228,036,494.84	3,864,896.69
本期利润	201,003,026.45	166,642,207.19	3,421,598.52
加权平均基金份额本期利润	0.1846	0.1817	0.2178
本期加权平均净值利润	10.81%	10.79%	14.09%

率			
本期基金份额净值增长率	13.11%	12.89%	13.05%
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	754,939,587.39	564,016,102.04	1,167,515.54
期末可供分配基金份额利润	0.7776	0.7528	0.6145
期末基金资产净值	1,725,782,961.11	1,313,271,492.03	3,075,307.59
期末基金份额净值	1.7776	1.7528	1.6186
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	77.76%	75.28%	61.86%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华中证 1000 指数增强 A

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

过去三个月	10.11%	1.53%	14.83%	1.53%	-4.72%	0.00%
过去六个月	13.11%	1.53%	15.23%	1.54%	-2.12%	-0.01%
过去一年	40.64%	1.28%	36.53%	1.31%	4.11%	-0.03%
过去三年	66.22%	1.52%	32.22%	1.57%	34.00%	-0.05%
自基金合同生效 起至今	77.76%	1.44%	41.25%	1.49%	36.51%	-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	10.00%	1.53%	14.83%	1.53%	-4.83%	0.00%
过去六个月	12.89%	1.53%	15.23%	1.54%	-2.34%	-0.01%
过去一年	40.09%	1.28%	36.53%	1.31%	3.56%	-0.03%
过去三年	64.24%	1.52%	32.22%	1.57%	32.02%	-0.05%
自基金合同生效 起至今	75.28%	1.44%	41.25%	1.49%	34.03%	-0.05%

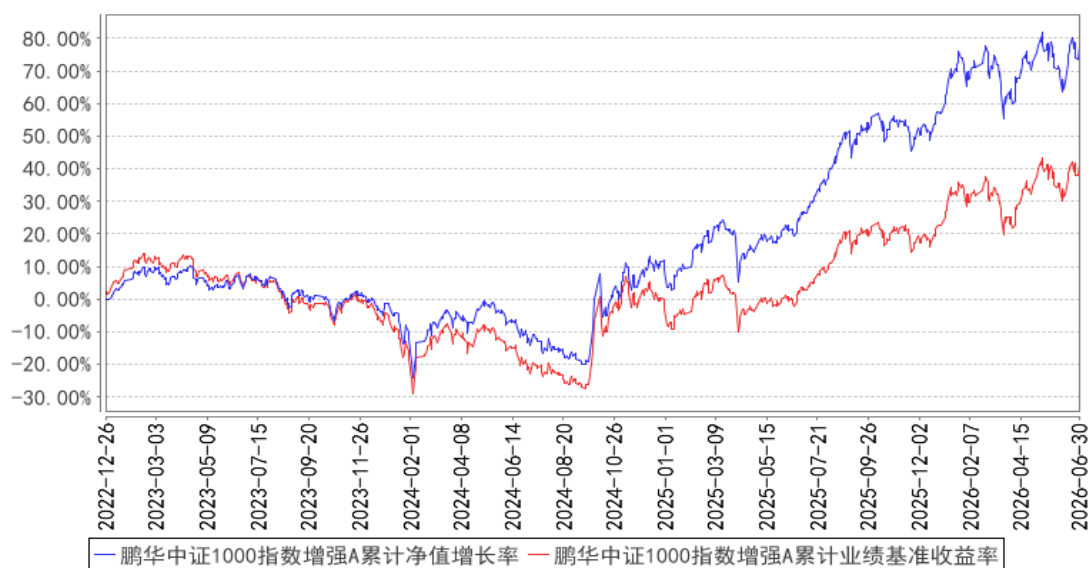
鹏华中证 1000 指数增强 I

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	10.09%	1.53%	14.83%	1.53%	-4.74%	0.00%
过去六个月	13.05%	1.53%	15.23%	1.54%	-2.18%	-0.01%
过去一年	40.50%	1.28%	36.53%	1.31%	3.97%	-0.03%
自基金合同生效 起至今	61.86%	1.38%	40.02%	1.40%	21.84%	-0.02%

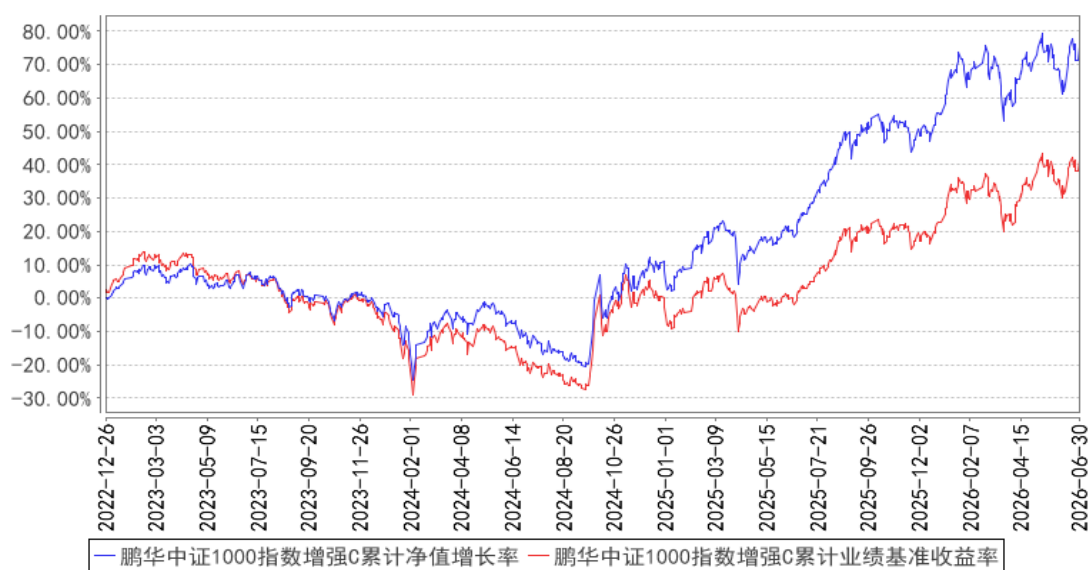
注：业绩比较基准=中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。鹏华中证 1000 指数增强 I 基金份额的首次确认日为 2024 年 12 月 19 日。

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

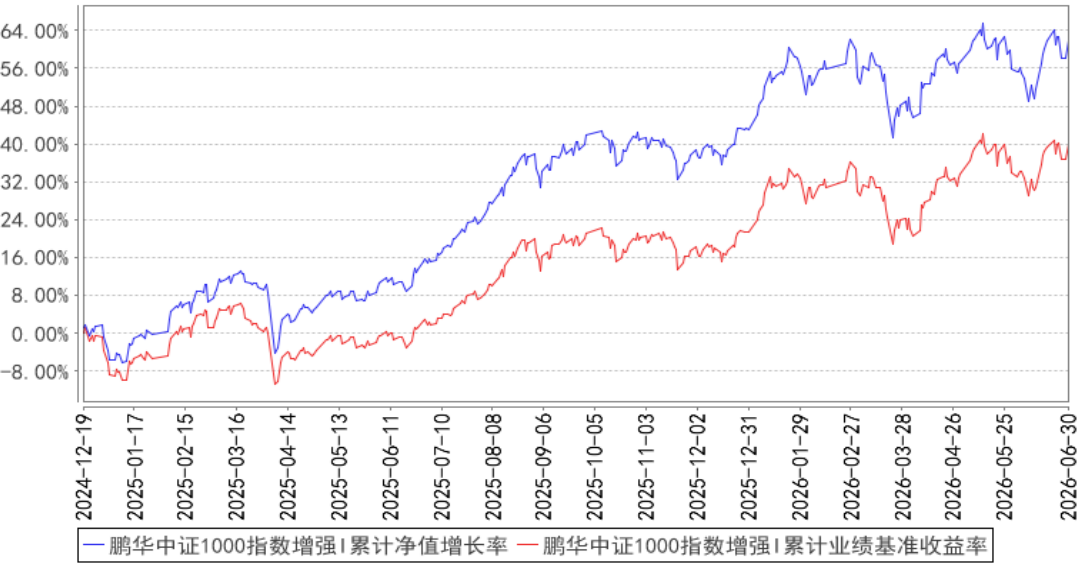
鹏华中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模为 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	本基金的	2022-12-	-	14 年	苏俊杰先生, 国籍中国, 理学硕士, 14 年

杰	基金经理	26			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。
时赞超	本基金的基金经理	2024-12-28	-	8 年	时赞超先生，国籍中国，工学硕士，8 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，2026 年 04 月至今担任鹏华上证科创板 200 指数增强型证券投资基金基金经理，2026 年 06 月至今担任鹏华创业板综合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。

4.2 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

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13.11%,同期业绩比较基准增长率为15.23%;C类份额净值增长率为12.89%,同期业绩比较基准增长率为15.23%;I类份额净值增长率为13.05%,同期业绩比较基准增长率为15.23%。

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，鹏华中证 1000 指数增强 A 期末可供分配利润为 754,939,587.39 元，期末基金份额净值 1.7776 元；鹏华中证 1000 指数增强 C 期末可供分配利润为 564,016,102.04 元，期末基金份额净值 1.7528 元；鹏华中证 1000 指数增强 I 期末可供分配利润为 1,167,515.54 元，期末基金份额净值 1.6186 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：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	411,464,353.58	318,711,690.80
结算备付金		43,913,262.80	17,853,818.90
存出保证金		29,240,793.60	17,666,472.00
交易性金融资产	6.4.7.2	2,594,635,330.31	2,288,867,117.58
其中：股票投资		2,594,635,330.31	2,288,867,117.58
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,720,096.69	48,309,704.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		3,089,973,836.98	2,691,408,804.27
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
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		-	-
应付赎回款		43,510,295.70	83,302,343.67

应付管理人报酬		2,104,817.66	1,796,367.27
应付托管费		394,653.30	336,818.87
应付销售服务费		452,748.69	417,661.94
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,281,711.48	431,750.22
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	99,849.42	170,002.35
负债合计		47,844,076.25	86,454,944.32
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,721,998,778.17	1,667,849,720.99
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,320,130,982.56	937,104,138.96
净资产合计		3,042,129,760.73	2,604,953,859.95
负债和净资产总计		3,089,973,836.98	2,691,408,804.27

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额为 1,721,998,778.17 份，其中鹏华中证 1000 指数增强 A 基金份额总额为 970,843,373.72 份，基金份额净值 1.7776 元；鹏华中证 1000 指数增强 C 基金份额总额为 749,255,389.99 份，基金份额净值 1.7528 元；鹏华中证 1000 指数增强 I 基金份额总额为 1,900,014.46 份，基金份额净值 1.6186 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：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		390,578,092.70	47,381,627.19
1. 利息收入		656,095.32	47,892.13
其中：存款利息收入	6.4.7.13	656,095.32	47,892.13
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）		518,810,611.03	36,840,295.59
其中：股票投资收益	6.4.7.14	466,645,326.73	32,655,268.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-

资产支持证券投资	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	31,173,042.07	768,930.76
股利收益	6.4.7.19	20,992,242.23	3,416,096.29
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-131,562,490.09	10,203,843.99
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	2,673,876.44	289,595.48
减：二、营业总支出		19,511,260.54	1,808,590.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,641,042.85	1,172,079.84
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,557,695.53	219,764.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,088,198.43	326,487.80
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		131,118.83	7,616.76
8. 其他费用	6.4.7.23	93,204.90	82,641.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		371,066,832.16	45,573,036.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		371,066,832.16	45,573,036.80
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		371,066,832.16	45,573,036.80

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：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	1,667,849,720.99	-	937,104,138.96	2,604,953,859.95
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,667,849,720.99	-	937,104,138.96	2,604,953,859.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	54,149,057.18	-	383,026,843.60	437,175,900.78
(一)、综合收益总额	-	-	371,066,832.16	371,066,832.16
(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)	54,149,057.18	-	11,960,011.44	66,109,068.62
其中：1. 基金申购款	2,839,647,591.99	-	1,971,960,330.39	4,811,607,922.38
2. 基金赎回款	-2,785,498,534.81	-	-1,960,000,318.95	-4,745,498,853.76
(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	1,721,998,778.17	-	1,320,130,982.56	3,042,129,760.73
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	208,504,181.25	-	17,707,057.61	226,211,238.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	208,504,181.25	-	17,707,057.61	226,211,238.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	138,051,073.79	-	71,257,734.81	209,308,808.60
(一)、综合收益总额	-	-	45,573,036.80	45,573,036.80
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	138,051,073.79	-	25,684,698.01	163,735,771.80
其中：1. 基金申购款	481,561,611.48	-	85,088,274.64	566,649,886.12
2. 基金赎回款	- 343,510,537.69	-	-59,403,576.63	-402,914,114.32
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	346,555,255.04	-	88,964,792.42	435,520,047.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证监会颁布的《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》、《鹏华中证 1000 指数增强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 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[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[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。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	33,074,714.64
等于：本金	33,068,724.94
加：应计利息	5,989.70
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	378,389,638.94
等于：本金	378,371,035.60
加：应计利息	18,603.34
减：坏账准备	-
合计	411,464,353.58

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

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

股票		2,737,069,197.04	-	2,594,635,330.31	-
					142,433,866.73
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		2,737,069,197.04	-	2,594,635,330.31	-
					142,433,866.73

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	230,061,320.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	230,061,320.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	230,061,320.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2609	IM2609	38.00	64,486,000.00	9,502,080.00
IM2612	IM2612	109.00	179,187,280.00	4,109,880.00
合计				13,611,960.00

减:可抵销期货 暂收款				13,611,960.00
净额				0.00

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	74.16
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	84,302.56
其他	15,472.70
合计	99,849.42

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华中证 1000 指数增强 A

项目	本期 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	815,882,604.25	815,882,604.25
本期申购	1,544,621,929.00	1,544,621,929.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,389,661,159.53	-1,389,661,159.53
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	970,843,373.72	970,843,373.72

鹏华中证 1000 指数增强 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	851,235,922.07	851,235,922.07
本期申购	1,268,068,852.38	1,268,068,852.38
本期赎回（以“-”号填列）	-1,370,049,384.46	-1,370,049,384.46
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	749,255,389.99	749,255,389.99

鹏华中证 1000 指数增强 I

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	731,194.67	731,194.67

本期申购	26,956,810.61	26,956,810.61
本期赎回（以“-”号填列）	-25,787,990.82	-25,787,990.82
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	1,900,014.46	1,900,014.46

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

鹏华中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	464,070,786.84	2,261,465.81	466,332,252.65
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	464,070,786.84	2,261,465.81	466,332,252.65
本期利润	270,746,775.94	-69,743,749.49	201,003,026.45
本期基金份额交易产生的变动数	69,637,339.09	17,966,969.20	87,604,308.29
其中：基金申购款	1,039,362,917.66	53,241,102.77	1,092,604,020.43
基金赎回款	-969,725,578.57	-35,274,133.57	-1,004,999,712.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	804,454,901.87	-49,515,314.48	754,939,587.39

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	468,985,149.22	1,471,092.21	470,456,241.43
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	468,985,149.22	1,471,092.21	470,456,241.43
本期利润	228,036,494.84	-61,394,287.65	166,642,207.19
本期基金份额交易产生的变动数	-94,560,718.87	21,478,372.29	-73,082,346.58
其中：基金申购款	833,815,183.99	32,517,086.45	866,332,270.44
基金赎回款	-928,375,902.86	-11,038,714.16	-939,414,617.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	602,460,925.19	-38,444,823.15	564,016,102.04

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	276,848.53	38,796.35	315,644.88
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	276,848.53	38,796.35	315,644.88
本期利润	3,864,896.69	-443,298.17	3,421,598.52
本期基金份额交易产生的变动数	-2,974,229.68	412,279.41	-2,561,950.27
其中：基金申购款	10,631,900.05	2,392,139.47	13,024,039.52
基金赎回款	-13,606,129.73	-1,979,860.06	-15,585,989.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,167,515.54	7,777.59	1,175,293.13

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	224,663.80
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	288,025.55
结算备付金利息收入	133,285.39
其他	10,120.58
合计	656,095.32

注：1、其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

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

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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	466,645,326.73
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	466,645,326.73

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	6,337,804,958.86
减：卖出股票成本总额	5,864,703,426.64
减：交易费用	6,456,205.49
买卖股票差价收入	466,645,326.73

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	31,173,042.07

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	20,992,242.23
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	20,992,242.23

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	-136,797,271.28
股票投资	-136,797,271.28
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	5,391,824.62
权证投资	—
期货投资	5,391,824.62
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	157,043.43
合计	-131,562,490.09

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	2,654,868.39
基金转换费收入	19,008.05
合计	2,673,876.44

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	8,902.34
合计	93,204.90

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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	12,641,935,555.85	100.00	1,183,854,993.31	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国信证券	2,476,685.12	100.00	-	-
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国信证券	231,960.58	100.00	-	-

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

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管

理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	13,641,042.85	1,172,079.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,543,036.23	450,949.96
应支付基金管理人的净管理费	8,098,006.62	721,129.88

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.80%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.80%÷当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	2,557,695.53	219,764.96

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

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	-	348,910.73	-

鹏华基金公司	-	151,907.36	12,236.13	164,143.49
招商银行	-	930,812.30	-	930,812.30
合计	-	1,431,630.39	12,236.13	1,443,866.52
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			
	鹏华中证 1000 指数增强 A	鹏华中证 1000 指数增强 C	鹏华中证 1000 指数增强 I	合计
国信证券	-	76,671.71	-	76,671.71
鹏华基金公司	-	16,894.11	10.51	16,904.62
招商银行	-	13,148.94	-	13,148.94
合计	-	106,714.76	10.51	106,725.27

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
国信证券	378,389,638.94	288,025.55	27,854,411.90	16,881.81
招商银行	33,074,714.64	224,663.80	36,215,804.26	24,966.79

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-

001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新股未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-

	团	日		通 受 限						
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微 - UW	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-

				限						
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股 流通 受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股 流通 受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-
688781	视涯科技 - UW	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	22.68	47.61	1,300	29,484.00	61,893.00	-
688797	臻	2026	6 个月	新	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-

	宝科技	年 6 月 16 日		股流通受限						
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研新材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股

上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的

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

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

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 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

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短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 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

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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	411,464,353.58	-	-	-	411,464,353.58
结算备付金	43,913,262.80	-	-	-	43,913,262.80
存出保证金	29,240,793.60	-	-	-	29,240,793.60

交易性金融资产	-	-	-	-2,594,635,330.31	2,594,635,330.31
应收申购款	-	-	-	10,720,096.69	10,720,096.69
资产总计	484,618,409.98	-	-	-2,605,355,427.00	3,089,973,836.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	43,510,295.70	43,510,295.70
应付管理人报酬	-	-	-	2,104,817.66	2,104,817.66
应付托管费	-	-	-	394,653.30	394,653.30
应付销售服务费	-	-	-	452,748.69	452,748.69
应交税费	-	-	-	1,281,711.48	1,281,711.48
其他负债	-	-	-	99,849.42	99,849.42
负债总计	-	-	-	47,844,076.25	47,844,076.25
利率敏感度缺口	484,618,409.98	-	-	-2,557,511,350.75	3,042,129,760.73
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	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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 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

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	2,594,635,330.31	85.29	2,288,867,117.58	87.87
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	2,594,635,330.31	85.29	2,288,867,117.58	87.87

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	139,207,857.85	120,817,760.02
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-139,207,857.85	-120,817,760.02

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	2,591,809,393.41
第二层次	850,291.44
第三层次	1,975,645.46
合计	2,594,635,330.31

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	2,594,635,330.31	83.97
	其中：股票	2,594,635,330.31	83.97
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	455,377,616.38	14.74
8	其他各项资产	39,960,890.29	1.29
9	合计	3,089,973,836.98	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	10,223,824.68	0.34
B	采矿业	53,666,846.76	1.76
C	制造业	1,601,037,754.98	52.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,486,492.00	0.80
E	建筑业	34,186,623.00	1.12
F	批发和零售业	34,620,398.00	1.14
G	交通运输、仓储和邮政业	34,966,952.00	1.15
H	住宿和餐饮业	126,672.00	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	301,112,449.90	9.90
J	金融业	21,655,060.80	0.71
K	房地产业	31,838,101.00	1.05
L	租赁和商务服务业	25,906,950.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	45,547,717.40	1.50
N	水利、环境和公共设施管理业	23,645,652.00	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,135,918.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	7,968,382.00	0.26
S	综合	798,622.00	0.03
	合计	2,255,924,416.52	74.16

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,101,384.80	0.10
B	采矿业	1,948,824.82	0.06
C	制造业	275,168,197.37	9.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,926,713.00	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,608,345.10	1.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	82,800.00	0.00
L	租赁和商务服务业	4,472,083.80	0.15
M	科学研究和技术服务业	4,640,385.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	5,557,370.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	352,935.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	338,710,913.79	11.13

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688110	东芯股份	163,729	33,351,597.30	1.10
2	688766	普冉股份	43,319	33,208,345.40	1.09

3	688536	思瑞浦	80,864	29,441,773.76	0.97
4	688559	海目星	335,459	28,151,719.28	0.93
5	688503	聚和材料	162,751	21,597,057.70	0.71
6	603588	高能环境	1,105,400	21,223,680.00	0.70
7	603083	剑桥科技	81,600	20,797,392.00	0.68
8	688388	嘉元科技	465,106	20,464,664.00	0.67
9	300773	拉卡拉	1,328,724	20,329,477.20	0.67
10	000603	盛达资源	872,100	20,145,510.00	0.66
11	688333	铂力特	188,795	19,332,608.00	0.64
12	300034	钢研高纳	1,125,300	19,287,642.00	0.63
13	300438	鹏辉能源	231,700	19,196,345.00	0.63
14	002396	星网锐捷	994,000	19,054,980.00	0.63
15	601677	明泰铝业	1,113,300	18,480,780.00	0.61
16	300861	美畅股份	715,600	18,025,964.00	0.59
17	002511	中顺洁柔	2,613,247	17,378,092.55	0.57
18	000636	风华高科	232,800	16,817,472.00	0.55
19	000555	神州信息	1,591,444	16,391,873.20	0.54
20	002338	奥普光电	285,400	16,324,880.00	0.54
21	688516	奥特维	277,579	15,930,258.81	0.52
22	300415	伊之密	798,600	15,900,126.00	0.52
23	301510	固高科技	497,393	15,881,758.49	0.52
24	002911	佛燃能源	1,620,900	15,382,341.00	0.51
25	600428	中远海特	1,934,200	15,106,102.00	0.50
26	300049	福瑞医科	385,300	14,980,464.00	0.49
27	300098	高新兴	3,218,660	14,773,649.40	0.49
28	000810	创维数字	1,113,200	14,749,900.00	0.48
29	300775	三角防务	664,600	14,647,784.00	0.48
30	688400	凌云光	220,100	14,570,620.00	0.48
31	001339	智微智能	140,270	14,346,815.60	0.47
32	300613	富瀚微	178,600	14,302,288.00	0.47
33	301029	怡合达	525,200	14,185,652.00	0.47
34	002497	雅化集团	694,600	14,149,002.00	0.47
35	002946	新乳业	1,004,700	14,146,176.00	0.47
36	600961	株冶集团	436,300	14,131,757.00	0.46
37	301219	腾远钴业	256,830	14,074,284.00	0.46
38	300568	星源材质	750,900	14,056,848.00	0.46
39	688068	热景生物	152,556	13,211,349.60	0.43
40	603093	南华期货	719,400	13,057,110.00	0.43
41	301215	中汽股份	2,434,500	12,635,055.00	0.42
42	600641	先导基电	316,000	12,595,760.00	0.41
43	002428	云南锗业	104,700	12,582,846.00	0.41
44	688048	长光华芯	24,873	12,486,246.00	0.41
45	000778	新兴铸管	3,361,900	12,472,649.00	0.41

46	600971	恒源煤电	1,792,000	12,364,800.00	0.41
47	002643	万润股份	585,100	12,257,845.00	0.40
48	688153	唯捷创芯	380,079	12,208,137.48	0.40
49	002378	章源钨业	363,400	12,166,632.00	0.40
50	301371	敷尔佳	464,700	12,082,200.00	0.40
51	600750	华润江中	542,600	11,975,182.00	0.39
52	002484	江海股份	113,700	11,938,500.00	0.39
53	000059	华锦股份	3,167,700	11,878,875.00	0.39
54	600273	嘉化能源	1,810,100	11,801,852.00	0.39
55	300624	万兴科技	227,100	11,779,677.00	0.39
56	603915	国茂股份	829,200	11,766,348.00	0.39
57	605599	菜百股份	855,800	11,724,460.00	0.39
58	300224	正海磁材	876,400	11,682,412.00	0.38
59	301153	中科江南	713,100	11,616,399.00	0.38
60	300428	立中集团	633,400	11,515,212.00	0.38
61	600037	歌华有线	1,835,600	11,509,212.00	0.38
62	002345	潮宏基	1,229,700	11,276,349.00	0.37
63	300398	飞凯材料	182,100	11,244,675.00	0.37
64	002258	利尔化学	880,000	11,184,800.00	0.37
65	688515	裕太微-U	44,914	11,172,806.64	0.37
66	002373	千方科技	1,554,400	11,160,592.00	0.37
67	688321	微芯生物	421,957	11,110,127.81	0.37
68	688390	固德威	101,393	11,002,154.43	0.36
69	002906	华阳集团	437,500	10,920,000.00	0.36
70	688146	中船特气	31,000	10,849,690.00	0.36
71	688195	腾景科技	56,100	10,803,738.00	0.36
72	688372	伟测科技	57,814	10,753,404.00	0.35
73	002320	海峡股份	1,709,900	10,721,073.00	0.35
74	688409	富创精密	34,900	10,688,125.00	0.35
75	002405	四维图新	1,643,800	10,635,386.00	0.35
76	600773	西藏城投	821,800	10,576,566.00	0.35
77	600869	远东股份	313,300	10,486,151.00	0.34
78	600502	安徽建工	2,396,100	10,423,035.00	0.34
79	688668	鼎通科技	27,643	10,319,131.90	0.34
80	688031	星环科技-U	89,138	10,266,914.84	0.34
81	300672	国科微	34,700	10,236,500.00	0.34
82	300102	乾照光电	390,100	10,158,204.00	0.33
83	688107	安路科技	212,713	9,699,712.80	0.32
84	688025	杰普特	20,632	9,697,040.00	0.32
85	688627	精智达	13,500	9,652,500.00	0.32
86	688167	炬光科技	27,015	9,568,983.15	0.31
87	300870	欧陆通	26,700	9,229,923.00	0.30
88	688717	艾罗能源	111,048	9,169,233.36	0.30

89	002237	恒邦股份	617,200	9,066,668.00	0.30
90	002222	福晶科技	98,000	9,043,440.00	0.30
91	002182	宝武镁业	579,200	9,018,144.00	0.30
92	002458	益生股份	1,151,960	8,950,729.20	0.29
93	002468	申通快递	608,700	8,862,672.00	0.29
94	600057	厦门象屿	1,628,800	8,828,096.00	0.29
95	301511	德福科技	61,300	8,818,005.00	0.29
96	301035	润丰股份	185,680	8,615,552.00	0.28
97	601208	东材科技	120,300	8,516,037.00	0.28
98	688519	南亚新材	22,400	8,512,896.00	0.28
99	301031	中熔电气	71,036	8,485,250.20	0.28
100	601126	四方股份	132,700	8,386,640.00	0.28
101	300416	苏试试验	410,300	8,361,914.00	0.27
102	603826	坤彩科技	325,213	8,312,444.28	0.27
103	300772	运达股份	674,400	8,295,120.00	0.27
104	601963	重庆银行	822,135	8,287,120.80	0.27
105	301217	铜冠铜箔	49,800	8,220,486.00	0.27
106	002993	奥海科技	113,800	8,149,218.00	0.27
107	002163	海南发展	957,700	7,987,218.00	0.26
108	301487	盟固利	416,100	7,968,315.00	0.26
109	600201	生物股份	674,500	7,857,925.00	0.26
110	002544	普天科技	428,100	7,799,982.00	0.26
111	301095	广立微	65,400	7,720,470.00	0.25
112	688141	杰华特	49,900	7,659,650.00	0.25
113	002518	科士达	142,400	7,631,216.00	0.25
114	300811	铂科新材	80,120	7,602,586.80	0.25
115	600330	天通股份	244,700	7,546,548.00	0.25
116	002315	焦点科技	323,847	7,539,158.16	0.25
117	688779	五矿新能	923,420	7,488,936.20	0.25
118	688063	派能科技	136,717	7,282,914.59	0.24
119	000682	东方电子	572,500	7,230,675.00	0.24
120	603638	艾迪精密	307,800	7,217,910.00	0.24
121	600933	爱柯迪	487,800	7,209,684.00	0.24
122	600686	金龙汽车	635,700	7,177,053.00	0.24
123	001287	中电港	227,600	7,089,740.00	0.23
124	300322	硕贝德	280,925	7,079,310.00	0.23
125	000049	德赛电池	301,490	7,045,821.30	0.23
126	603063	禾望电气	132,500	7,007,925.00	0.23
127	603127	昭衍新药	183,200	7,001,904.00	0.23
128	000923	河钢资源	559,600	6,944,636.00	0.23
129	600353	旭光电子	151,800	6,922,080.00	0.23
130	002690	美亚光电	479,800	6,875,534.00	0.23
131	002636	金安国纪	57,200	6,862,284.00	0.23

132	600320	振华重工	1,649,300	6,811,609.00	0.22
133	688326	经纬恒润-W	95,755	6,787,114.40	0.22
134	002204	大连重工	1,281,700	6,767,376.00	0.22
135	603516	淳中科技	49,800	6,703,578.00	0.22
136	000581	威孚高科	382,600	6,511,852.00	0.21
137	605507	国邦医药	439,900	6,510,520.00	0.21
138	300357	我武生物	278,700	6,499,284.00	0.21
139	600361	创新新材	1,797,800	6,472,080.00	0.21
140	301396	宏景科技	19,400	6,433,040.00	0.21
141	688208	道通科技	254,239	6,404,280.41	0.21
142	300036	超图软件	565,700	6,375,439.00	0.21
143	300236	上海新阳	48,007	6,312,920.50	0.21
144	605376	博迁新材	23,000	6,239,900.00	0.21
145	600728	佳都科技	1,435,000	6,113,100.00	0.20
146	601068	中铝国际	1,392,500	6,015,600.00	0.20
147	002176	江特电机	587,200	5,877,872.00	0.19
148	301087	可孚医疗	123,200	5,870,480.00	0.19
149	002747	埃斯顿	156,600	5,845,878.00	0.19
150	600623	华谊集团	719,600	5,807,172.00	0.19
151	002506	协鑫集成	1,824,200	5,800,956.00	0.19
152	300342	天银机电	123,200	5,790,400.00	0.19
153	688205	德科立	27,000	5,621,130.00	0.18
154	002668	TCL 智家	506,876	5,616,186.08	0.18
155	002929	润建股份	81,900	5,477,472.00	0.18
156	300409	道氏技术	274,678	5,474,332.54	0.18
157	000811	冰轮环境	95,300	5,357,766.00	0.18
158	688486	龙迅股份	84,228	5,355,216.24	0.18
159	300633	开立医疗	287,400	5,285,286.00	0.17
160	600577	精达股份	525,600	5,140,368.00	0.17
161	688531	日联科技	28,800	5,121,792.00	0.17
162	600710	苏美达	535,700	5,121,292.00	0.17
163	300170	汉得信息	335,100	5,106,924.00	0.17
164	688630	芯碁微装	9,200	5,054,388.00	0.17
165	000534	万泽股份	184,100	5,036,976.00	0.17
166	301205	联特科技	14,600	4,877,860.00	0.16
167	002149	西部材料	89,400	4,828,494.00	0.16
168	688091	上海谊众	119,790	4,815,558.00	0.16
169	600158	中体产业	704,300	4,746,982.00	0.16
170	002364	中恒电气	87,200	4,691,360.00	0.15
171	300378	鼎捷数智	129,357	4,669,787.70	0.15
172	301339	通行宝	451,240	4,616,185.20	0.15
173	688131	皓元医药	48,183	4,558,111.80	0.15
174	000612	焦作万方	426,300	4,514,517.00	0.15

175	603026	石大胜华	50,500	4,513,185.00	0.15
176	605118	力鼎光电	128,500	4,483,365.00	0.15
177	001914	招商积余	543,700	4,436,592.00	0.15
178	600667	太极实业	151,300	4,414,934.00	0.15
179	600718	东软集团	607,500	4,398,300.00	0.14
180	301489	思泉新材	26,380	4,341,620.40	0.14
181	603306	华懋科技	41,700	4,323,873.00	0.14
182	002245	蔚蓝锂芯	228,688	4,278,752.48	0.14
183	600388	龙净环保	291,900	4,247,145.00	0.14
184	002960	青鸟智控	494,192	4,185,806.24	0.14
185	600075	新疆天业	1,027,300	4,150,292.00	0.14
186	603698	航天工程	107,500	4,145,200.00	0.14
187	300244	迪安诊断	220,700	4,135,918.00	0.14
188	002110	三钢闽光	1,431,400	4,122,432.00	0.14
189	002545	东方铁塔	252,500	4,095,550.00	0.13
190	002010	传化智联	907,600	4,056,972.00	0.13
191	300337	银邦股份	341,300	3,979,558.00	0.13
192	002181	粤传媒	396,400	3,944,180.00	0.13
193	002895	川恒股份	134,700	3,933,240.00	0.13
194	600761	安徽合力	235,100	3,846,236.00	0.13
195	300682	朗新科技	383,900	3,800,610.00	0.12
196	600963	岳阳林纸	1,244,100	3,782,064.00	0.12
197	688700	东威科技	42,212	3,773,752.80	0.12
198	600877	电科芯片	219,800	3,765,174.00	0.12
199	603876	鼎胜新材	142,500	3,706,425.00	0.12
200	605123	派克新材	38,200	3,705,782.00	0.12
201	002400	省广集团	580,900	3,665,479.00	0.12
202	600151	航天机电	322,300	3,616,206.00	0.12
203	001301	尚太科技	38,100	3,562,731.00	0.12
204	300184	力源信息	200,400	3,517,020.00	0.12
205	600986	浙文互联	500,500	3,493,490.00	0.11
206	002516	旷达科技	625,500	3,490,290.00	0.11
207	002192	融捷股份	38,200	3,415,080.00	0.11
208	300602	飞荣达	66,200	3,389,440.00	0.11
209	600552	凯盛科技	102,400	3,336,192.00	0.11
210	300693	盛弘股份	66,496	3,241,680.00	0.11
211	300133	华策影视	455,000	3,221,400.00	0.11
212	002151	北斗星通	100,700	3,197,225.00	0.11
213	000990	诚志股份	386,500	3,161,570.00	0.10
214	688097	博众精工	50,133	3,160,885.65	0.10
215	688300	联瑞新材	12,900	3,152,760.00	0.10
216	603317	天味食品	242,048	3,149,044.48	0.10
217	603663	三祥新材	32,300	3,110,490.00	0.10

218	605196	华通线缆	116,800	3,048,480.00	0.10
219	000970	中科三环	195,300	2,966,607.00	0.10
220	300323	华灿光电	142,200	2,900,880.00	0.10
221	300850	新强联	107,970	2,893,596.00	0.10
222	001337	四川黄金	78,100	2,863,146.00	0.09
223	688088	虹软科技	80,500	2,861,775.00	0.09
224	688800	瑞可达	29,780	2,857,986.60	0.09
225	603929	亚翔集成	10,500	2,856,210.00	0.09
226	301216	万凯新材	123,600	2,841,564.00	0.09
227	600210	紫江企业	451,200	2,797,440.00	0.09
228	600335	国机汽车	586,700	2,745,756.00	0.09
229	002985	北摩高科	99,044	2,743,518.80	0.09
230	600094	大名城	792,400	2,741,704.00	0.09
231	603556	海兴电力	122,800	2,701,600.00	0.09
232	603305	旭升集团	219,500	2,660,340.00	0.09
233	603283	赛腾股份	32,600	2,639,948.00	0.09
234	600338	西藏珠峰	171,799	2,618,216.76	0.09
235	300456	赛微电子	60,800	2,582,176.00	0.08
236	688593	新相微	65,829	2,562,064.68	0.08
237	000058	深赛格	414,700	2,546,258.00	0.08
238	002063	远光软件	497,550	2,537,505.00	0.08
239	001267	汇绿生态	46,800	2,503,800.00	0.08
240	600323	瀚蓝环境	88,200	2,421,972.00	0.08
241	688660	电气风电	277,353	2,390,782.86	0.08
242	600882	妙可蓝多	148,300	2,371,317.00	0.08
243	600509	天富能源	277,200	2,342,340.00	0.08
244	603043	广州酒家	186,700	2,315,080.00	0.08
245	601778	晶科科技	537,500	2,311,250.00	0.08
246	300085	银之杰	66,000	2,308,020.00	0.08
247	301171	易点天下	67,600	2,295,696.00	0.08
248	300468	四方精创	108,000	2,269,080.00	0.07
249	603124	江南新材	12,100	2,262,458.00	0.07
250	000680	山推股份	223,900	2,250,195.00	0.07
251	688639	华恒生物	137,200	2,214,408.00	0.07
252	002967	广电计量	122,100	2,203,905.00	0.07
253	301005	超捷股份	19,700	2,197,732.00	0.07
254	300806	斯迪克	19,600	2,195,200.00	0.07
255	301071	力量钻石	23,500	2,173,750.00	0.07
256	600114	东睦股份	57,200	2,159,872.00	0.07
257	002171	楚江新材	157,300	2,134,561.00	0.07
258	300913	兆龙互连	44,300	2,122,413.00	0.07
259	688686	奥普特	12,583	2,118,851.37	0.07
260	002368	太极股份	150,500	2,105,495.00	0.07

261	300738	奥飞数据	104,000	2,102,880.00	0.07
262	002563	森马服饰	412,400	2,078,496.00	0.07
263	002020	京新药业	166,200	2,075,838.00	0.07
264	300814	中富电路	10,000	2,045,000.00	0.07
265	688279	峰昭科技	9,100	2,042,404.00	0.07
266	603612	索通发展	111,200	2,016,056.00	0.07
267	600782	新钢股份	809,900	2,008,552.00	0.07
268	600596	新安股份	125,600	2,004,576.00	0.07
269	600508	上海能源	268,500	1,978,845.00	0.07
270	300443	金雷股份	90,800	1,959,464.00	0.06
271	002324	普利特	161,260	1,946,408.20	0.06
272	688127	蓝特光学	19,900	1,942,240.00	0.06
273	300131	英唐智控	102,000	1,941,060.00	0.06
274	003039	顺控发展	175,900	1,936,659.00	0.06
275	000917	电广传媒	288,700	1,931,403.00	0.06
276	600391	航发科技	57,700	1,930,065.00	0.06
277	002434	万里扬	317,800	1,922,690.00	0.06
278	002639	雪人集团	136,600	1,900,106.00	0.06
279	600662	外服控股	461,200	1,858,636.00	0.06
280	002221	东华能源	344,100	1,809,966.00	0.06
281	600389	江山股份	92,700	1,809,504.00	0.06
282	688691	灿芯股份	15,400	1,785,322.00	0.06
283	301039	中集车辆	248,500	1,751,925.00	0.06
284	002081	金螳螂	404,200	1,750,186.00	0.06
285	688586	江航装备	146,120	1,708,142.80	0.06
286	300821	东岳硅材	82,100	1,687,976.00	0.06
287	002004	华邦健康	428,600	1,684,398.00	0.06
288	300341	麦克奥迪	126,600	1,677,450.00	0.06
289	002250	联化科技	120,600	1,648,602.00	0.05
290	688353	华盛锂电	14,200	1,648,194.00	0.05
291	605020	永和股份	40,100	1,632,872.00	0.05
292	603236	移远通信	30,842	1,578,185.14	0.05
293	300363	博腾股份	95,100	1,544,424.00	0.05
294	002815	崇达技术	92,800	1,539,552.00	0.05
295	300573	兴齐眼药	37,475	1,527,481.00	0.05
296	300171	东富龙	138,100	1,527,386.00	0.05
297	300134	大富科技	178,600	1,527,030.00	0.05
298	300101	振芯科技	94,400	1,526,448.00	0.05
299	301571	国科天成	22,800	1,486,104.00	0.05
300	300776	帝尔激光	6,900	1,483,224.00	0.05
301	600267	海正药业	145,700	1,473,027.00	0.05
302	301392	汇成真空	5,100	1,472,064.00	0.05
303	300684	中石科技	23,100	1,409,100.00	0.05

304	300702	天宇股份	69,600	1,403,136.00	0.05
305	688567	孚能科技	132,748	1,393,854.00	0.05
306	688523	航天环宇	26,300	1,378,120.00	0.05
307	688062	迈威生物-U	46,305	1,308,116.25	0.04
308	000550	江铃汽车	80,200	1,300,844.00	0.04
309	002626	金达威	96,200	1,267,916.00	0.04
310	603667	五洲新春	19,200	1,257,984.00	0.04
311	300166	东方国信	70,000	1,239,700.00	0.04
312	000973	佛塑科技	86,000	1,234,100.00	0.04
313	000969	安泰科技	48,900	1,200,006.00	0.04
314	600531	豫光金铅	81,000	1,195,560.00	0.04
315	000901	航天科技	66,500	1,183,035.00	0.04
316	600645	中源协和	68,800	1,177,168.00	0.04
317	300990	同飞股份	11,200	1,176,784.00	0.04
318	600266	城建发展	296,000	1,157,360.00	0.04
319	603583	捷昌驱动	50,300	1,146,840.00	0.04
320	688433	华曙高科	13,200	1,129,920.00	0.04
321	688327	云从科技-UW	90,538	1,128,103.48	0.04
322	301196	唯科科技	8,680	1,088,645.60	0.04
323	600456	宝钛股份	38,300	1,047,505.00	0.03
324	688001	华兴源创	12,000	1,028,400.00	0.03
325	000048	京基智农	45,672	1,008,894.48	0.03
326	688698	伟创电气	18,800	986,060.00	0.03
327	002015	协鑫能科	59,700	974,304.00	0.03
328	603319	美湖股份	29,000	963,090.00	0.03
329	002922	伊戈尔	29,000	951,200.00	0.03
330	301550	斯菱智驱	10,300	941,729.00	0.03
331	600744	华银电力	142,000	913,060.00	0.03
332	600301	华锡有色	14,700	901,404.00	0.03
333	002073	软控股份	175,000	899,500.00	0.03
334	600929	雪天盐业	197,600	897,104.00	0.03
335	002745	木林森	68,700	862,185.00	0.03
336	601069	西部黄金	38,700	851,400.00	0.03
337	301268	铭利达	60,600	847,188.00	0.03
338	300065	海兰信	37,200	829,932.00	0.03
339	000833	粤桂股份	34,100	798,622.00	0.03
340	688158	优刻得-W	21,715	798,243.40	0.03
341	002043	兔宝宝	71,000	786,680.00	0.03
342	688776	国光电气	12,800	785,152.00	0.03
343	002046	国机精工	10,200	751,230.00	0.02
344	000628	高新发展	15,600	739,440.00	0.02
345	600331	宏达股份	67,000	736,330.00	0.02
346	002268	电科网安	56,400	727,560.00	0.02

347	002246	北化股份	37,500	705,000.00	0.02
348	600259	中稀有色	6,900	701,109.00	0.02
349	002104	恒宝股份	67,900	700,049.00	0.02
350	688726	拉普拉斯	13,200	697,620.00	0.02
351	002498	汉缆股份	99,200	676,544.00	0.02
352	002416	爱施德	74,900	671,104.00	0.02
353	300687	赛意信息	21,500	666,500.00	0.02
354	600478	科力远	131,200	661,248.00	0.02
355	600366	宁波韵升	44,200	648,856.00	0.02
356	301662	宏工科技	5,900	597,788.00	0.02
357	002174	游族网络	46,800	590,148.00	0.02
358	600206	有研新材	8,800	586,080.00	0.02
359	688545	兴福电子	4,400	585,464.00	0.02
360	000962	东方钽业	6,300	570,780.00	0.02
361	600113	浙江东日	16,400	544,152.00	0.02
362	603619	中曼石油	28,700	536,977.00	0.02
363	300153	科泰电源	23,100	522,522.00	0.02
364	688123	聚辰股份	2,453	521,507.80	0.02
365	300260	新莱应材	5,100	512,346.00	0.02
366	603533	掌阅科技	24,400	495,076.00	0.02
367	600063	皖维高新	64,900	493,240.00	0.02
368	002183	怡亚通	86,900	463,177.00	0.02
369	603888	新华网	26,500	451,295.00	0.01
370	000880	潍柴重机	18,000	414,180.00	0.01
371	300618	寒锐钴业	11,400	406,980.00	0.01
372	002488	金固股份	45,200	402,732.00	0.01
373	000899	赣能股份	41,400	399,924.00	0.01
374	002947	恒铭达	5,200	395,460.00	0.01
375	688549	中巨芯-U	10,600	390,186.00	0.01
376	603328	依顿电子	31,000	388,430.00	0.01
377	002539	云图控股	34,300	388,276.00	0.01
378	300685	艾德生物	22,894	385,534.96	0.01
379	600550	保变电气	31,400	368,322.00	0.01
380	688262	国芯科技	8,400	363,132.00	0.01
381	688003	天准科技	2,836	361,022.80	0.01
382	600850	电科数字	24,000	349,440.00	0.01
383	000688	国城矿业	10,100	345,723.00	0.01
384	300926	博俊科技	19,100	339,025.00	0.01
385	600064	南京高科	46,300	330,119.00	0.01
386	002276	万马股份	31,700	320,487.00	0.01
387	002839	张家港行	79,700	310,830.00	0.01
388	002536	飞龙股份	6,200	292,516.00	0.01
389	301316	慧博云通	7,100	279,598.00	0.01

390	300761	立华股份	16,100	264,201.00	0.01
391	301389	隆扬电子	3,000	260,370.00	0.01
392	000681	视觉中国	12,400	247,256.00	0.01
393	002557	洽洽食品	13,600	244,256.00	0.01
394	002290	禾盛新材	2,500	229,675.00	0.01
395	002326	永太科技	9,500	224,675.00	0.01
396	002531	天顺风能	26,600	224,238.00	0.01
397	601975	招商南油	58,900	219,697.00	0.01
398	688177	百奥泰	12,286	206,650.52	0.01
399	002239	奥特佳	83,000	205,010.00	0.01
400	300779	惠城环保	3,900	195,780.00	0.01
401	000600	建投能源	22,200	194,250.00	0.01
402	603567	珍宝岛	43,000	188,340.00	0.01
403	002925	盈趣科技	6,900	170,154.00	0.01
404	600480	凌云股份	19,580	162,709.80	0.01
405	603301	振德医疗	1,800	156,888.00	0.01
406	600258	首旅酒店	11,600	126,672.00	0.00
407	688443	智翔金泰-U	5,400	125,550.00	0.00
408	600507	方大特钢	30,200	122,310.00	0.00
409	688658	悦康药业	9,400	120,884.00	0.00
410	603881	数据港	4,560	114,000.00	0.00
411	002979	雷赛智能	1,900	105,982.00	0.00
412	002779	中坚科技	1,200	94,272.00	0.00
413	301018	申菱环境	800	92,488.00	0.00
414	300768	迪普科技	6,100	83,997.00	0.00
415	300253	卫宁健康	12,000	80,760.00	0.00
416	300088	长信科技	6,500	75,400.00	0.00
417	002706	良信股份	6,700	73,097.00	0.00
418	603162	海通发展	6,400	57,408.00	0.00
419	300969	恒帅股份	600	56,256.00	0.00
420	301421	波长光电	500	51,775.00	0.00
421	002534	西子洁能	2,600	48,230.00	0.00
422	300855	图南股份	1,500	46,890.00	0.00
423	688392	骄成超声	200	45,436.00	0.00
424	002701	奥瑞金	9,000	38,340.00	0.00
425	688382	益方生物-U	1,900	34,200.00	0.00
426	600629	华建集团	2,760	33,423.60	0.00
427	000685	中山公用	2,900	32,364.00	0.00
428	600184	光电股份	1,000	32,010.00	0.00
429	002011	盾安环境	2,700	28,647.00	0.00
430	000030	富奥股份	5,400	20,898.00	0.00
431	600420	国药现代	1,300	10,335.00	0.00
432	688612	威迈斯	233	6,894.47	0.00

433	603730	岱美股份	200	2,234.00	0.00
434	300360	炬华科技	100	1,175.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600595	中孚实业	2,332,500	13,108,650.00	0.43
2	603986	兆易创新	15,200	12,388,000.00	0.41
3	688045	必易微	147,083	11,881,364.74	0.39
4	600105	永鼎股份	162,782	10,984,529.36	0.36
5	002487	大金重工	182,400	10,573,728.00	0.35
6	300658	延江股份	866,900	9,908,667.00	0.33
7	002284	亚太股份	889,200	8,438,508.00	0.28
8	300223	北京君正	33,400	8,313,260.00	0.27
9	688173	希荻微	418,217	8,004,673.38	0.26
10	001309	德明利	8,000	7,543,200.00	0.25
11	300953	震裕科技	55,759	7,454,978.30	0.25
12	688556	高测股份	561,224	7,453,054.72	0.24
13	688498	源杰科技	3,902	7,359,172.00	0.24
14	300475	香农芯创	23,500	7,050,000.00	0.23
15	002079	苏州固锟	461,700	6,939,351.00	0.23
16	601869	长飞光纤	11,900	6,496,210.00	0.21
17	002402	和而泰	249,900	6,454,917.00	0.21
18	688002	睿创微纳	40,008	6,188,837.52	0.20
19	688275	万润新能	46,832	5,973,421.60	0.20
20	002587	奥拓电子	714,700	5,581,807.00	0.18
21	301377	鼎泰高科	9,400	5,178,460.00	0.17
22	688313	仕佳光子	27,933	5,157,828.45	0.17
23	600499	科达制造	371,500	5,126,700.00	0.17
24	000949	新乡化纤	800,400	5,074,536.00	0.17
25	600230	沧州大化	347,700	4,527,054.00	0.15
26	300548	长芯博创	16,043	4,459,954.00	0.15
27	688416	恒烁股份	31,591	4,422,740.00	0.15
28	002008	大族激光	27,500	4,128,025.00	0.14
29	688347	华虹宏力	11,979	4,028,537.70	0.13
30	300590	移为通信	245,600	3,524,360.00	0.12
31	300620	光库科技	9,100	3,441,620.00	0.11
32	688620	安凯微	204,164	3,307,456.80	0.11
33	301189	奥尼电子	55,800	3,288,294.00	0.11
34	002266	浙富控股	641,800	3,247,508.00	0.11
35	300919	中伟新材	73,071	3,196,856.25	0.11
36	000761	本钢板材	1,470,000	3,160,500.00	0.10
37	002115	三维通信	306,700	3,159,010.00	0.10

38	688202	美迪西	39,100	3,155,761.00	0.10
39	300290	ST 荣科	466,500	3,102,225.00	0.10
40	300970	华绿生物	169,660	3,101,384.80	0.10
41	603396	金辰股份	116,400	3,084,600.00	0.10
42	600590	泰豪科技	281,200	2,840,120.00	0.09
43	688653	康希通信	162,693	2,827,604.34	0.09
44	300270	中威电子	216,600	2,817,966.00	0.09
45	300842	帝科股份	30,100	2,684,017.00	0.09
46	600808	马钢股份	1,068,100	2,670,250.00	0.09
47	002649	博彦科技	327,394	2,664,987.16	0.09
48	300118	东方日升	207,200	2,579,640.00	0.08
49	300464	星徽股份	361,300	2,576,069.00	0.08
50	300006	莱美药业	500,300	2,566,539.00	0.08
51	688677	海泰新光	24,000	2,427,120.00	0.08
52	688369	致远互联	111,099	2,334,189.99	0.08
53	603778	国晟科技	185,200	2,277,960.00	0.07
54	301086	鸿富瀚	10,700	2,239,296.00	0.07
55	600894	广日股份	269,000	2,049,780.00	0.07
56	300774	倍杰特	190,200	2,044,650.00	0.07
57	300164	通源石油	236,800	1,894,400.00	0.06
58	002810	山东赫达	73,800	1,822,860.00	0.06
59	603042	华脉科技	125,650	1,809,360.00	0.06
60	600549	厦门钨业	20,500	1,746,600.00	0.06
61	300055	万邦达	270,900	1,741,887.00	0.06
62	300497	富祥股份	73,800	1,635,408.00	0.05
63	300407	凯发电气	142,400	1,537,920.00	0.05
64	603256	宏和科技	5,600	1,485,848.00	0.05
65	300837	浙矿股份	61,800	1,468,368.00	0.05
66	300450	先导智能	35,400	1,441,488.00	0.05
67	300681	英搏尔	50,000	1,431,000.00	0.05
68	300887	谱尼测试	199,400	1,387,824.00	0.05
69	301002	崧盛股份	35,800	1,381,880.00	0.05
70	688795	摩尔线程-U	1,856	1,329,805.44	0.04
71	002803	吉宏股份	51,000	1,317,840.00	0.04
72	300769	德方纳米	19,300	1,283,450.00	0.04
73	688737	中自科技	67,000	1,282,380.00	0.04
74	301321	翰博高新	28,200	1,245,030.00	0.04
75	002342	巨力索具	117,500	1,234,925.00	0.04
76	002446	盛路通信	103,800	1,114,812.00	0.04
77	002131	利欧股份	234,600	1,114,350.00	0.04
78	603308	应流股份	18,400	1,111,360.00	0.04
79	688227	品高股份	9,882	1,014,782.58	0.03
80	001316	润贝航科	29,800	982,804.00	0.03

81	300073	当升科技	19,200	922,368.00	0.03
82	002998	优彩资源	130,900	852,159.00	0.03
83	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.03
84	600343	航天动力	30,100	843,402.00	0.03
85	688783	西安奕材-U	13,290	822,916.80	0.03
86	688733	壹石通	16,802	694,762.70	0.02
87	600801	华新建材	40,900	638,040.00	0.02
88	688251	井松智能	24,324	623,424.12	0.02
89	301526	国际复材	12,800	597,376.00	0.02
90	300401	花园生物	26,900	588,841.00	0.02
91	688343	云天励飞-U	7,149	583,787.34	0.02
92	301666	大普微-UW	1,220	565,262.60	0.02
93	688095	福昕软件	8,337	495,467.91	0.02
94	600152	维科技术	49,500	494,505.00	0.02
95	300079	数码视讯	117,700	494,340.00	0.02
96	300605	恒锋信息	43,200	399,168.00	0.01
97	300745	欣锐科技	9,400	396,868.00	0.01
98	300986	志特新材	22,800	391,020.00	0.01
99	603538	美诺华	11,800	384,090.00	0.01
100	300700	岱勒新材	17,200	366,016.00	0.01
101	002136	安纳达	27,200	355,776.00	0.01
102	002622	皓宸医疗	170,500	352,935.00	0.01
103	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
104	300030	阳普医疗	56,600	328,846.00	0.01
105	688108	赛诺医疗	15,300	283,509.00	0.01
106	301536	星辰科技	2,200	283,162.00	0.01
107	600884	杉杉股份	19,600	265,580.00	0.01
108	300854	中兰环保	13,900	265,212.00	0.01
109	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
110	300666	江丰电子	700	258,020.00	0.01
111	600973	宝胜股份	35,100	248,859.00	0.01
112	300226	上海钢联	12,980	198,723.80	0.01
113	688270	ST 臻镭	2,370	185,713.20	0.01
114	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
115	002850	科达利	900	170,370.00	0.01
116	300516	久之洋	4,420	144,799.20	0.00
117	002580	圣阳股份	7,100	143,136.00	0.00
118	605299	舒华体育	10,100	134,835.00	0.00
119	600841	动力新科	21,900	133,590.00	0.00
120	002413	雷科防务	13,500	131,760.00	0.00
121	301656	联合动力	6,995	120,523.85	0.00
122	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
123	003012	东鹏控股	27,500	119,900.00	0.00

124	600410	华胜天成	6,500	102,895.00	0.00
125	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
126	688046	药康生物	4,000	96,800.00	0.00
127	002440	闰土股份	9,400	96,350.00	0.00
128	600183	生益科技	500	86,700.00	0.00
129	600683	京投发展	7,200	82,800.00	0.00
130	688781	视涯科技-UW	1,300	61,893.00	0.00
131	688280	精进电动-W	10,400	57,096.00	0.00
132	300086	康芝药业	9,000	53,100.00	0.00
133	688084	晶品特装	963	48,419.64	0.00
134	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
135	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
136	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
137	603629	利通电子	200	35,762.00	0.00
138	300554	三超新材	1,300	35,685.00	0.00
139	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
140	002558	巨人网络	900	24,804.00	0.00
141	300790	宇瞳光学	920	24,021.20	0.00
142	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
143	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
144	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
145	300139	晓程科技	500	18,275.00	0.00
146	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
147	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
148	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
149	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
150	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
151	300756	金马游乐	420	13,881.00	0.00
152	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
153	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
154	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
155	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
156	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
157	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
158	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
159	603803	瑞斯康达	400	4,696.00	0.00
160	603766	隆鑫通用	300	3,579.00	0.00
161	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
162	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
163	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
164	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	688516	奥特维	60,973,822.49	2.34
2	300244	迪安诊断	48,734,422.57	1.87
3	002911	佛燃能源	46,252,579.00	1.78
4	603588	高能环境	42,991,887.00	1.65
5	688110	东芯股份	42,165,058.43	1.62
6	300438	鹏辉能源	41,123,246.87	1.58
7	688559	海目星	40,350,309.28	1.55
8	688200	华峰测控	39,848,470.90	1.53
9	300034	钢研高纳	39,380,959.65	1.51
10	300548	长芯博创	39,178,129.58	1.50
11	002747	埃斯顿	39,171,295.00	1.50
12	605599	菜百股份	38,158,133.00	1.46
13	000778	新兴铸管	38,001,099.00	1.46
14	300475	香农芯创	35,997,455.84	1.38
15	600595	中孚实业	35,348,207.00	1.36
16	688515	裕太微-U	34,531,347.42	1.33
17	301171	易点天下	34,016,606.00	1.31
18	688333	铂力特	33,749,874.78	1.30
19	000603	盛达资源	33,648,303.00	1.29
20	688372	伟测科技	33,205,405.15	1.27

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	300548	长芯博创	59,815,560.00	2.30
2	300244	迪安诊断	55,652,131.70	2.14
3	688515	裕太微-U	55,493,883.03	2.13
4	603588	高能环境	52,594,701.76	2.02
5	688331	荣昌生物	49,407,227.81	1.90
6	300438	鹏辉能源	47,438,489.00	1.82
7	688200	华峰测控	47,321,168.77	1.82
8	301095	广立微	45,617,574.00	1.75
9	688516	奥特维	45,289,610.58	1.74
10	300475	香农芯创	44,760,033.65	1.72
11	002484	江海股份	43,779,741.00	1.68
12	688372	伟测科技	42,418,256.36	1.63
13	300747	锐科激光	41,240,894.87	1.58
14	688498	源杰科技	41,014,592.73	1.57

15	301031	中熔电气	38,862,580.12	1.49
16	002324	普利特	38,814,332.20	1.49
17	300505	川金诺	37,217,279.12	1.43
18	605599	菜百股份	36,683,175.00	1.41
19	688001	华兴源创	35,354,590.24	1.36
20	002815	崇达技术	35,325,743.00	1.36

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	6,307,268,910.65
卖出股票收入（成交）总额	6,337,804,958.86

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

上海剑桥科技股份有限公司在报告编制日前一年内受到中华人民共和国龙吴海关的处罚。

盛达金属资源股份有限公司在报告期内被中国证券监督管理委员会立案调查。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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	29,240,793.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,720,096.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,960,890.29

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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	22,386	43,368.33	79,947,941.32	8.23	890,895,432.40	91.77
鹏华中证 1000 指 数增强 C	66,921	11,196.12	83,907,892.11	11.20	665,347,497.88	88.80
鹏华中证 1000 指 数增强 I	144	13,194.54	0.00	0.00	1,900,014.46	100.00
合计	89,451	19,250.75	163,855,833.43	9.52	1,558,142,944.74	90.48

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 (%)
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	鹏华中证 1000 指数增强 A	255,743.53	0.0263
	鹏华中证 1000 指数增强 C	20,436.09	0.0027
	鹏华中证 1000 指数增强 I	368,617.01	19.4007
	合计	644,796.63	0.0374

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

注：1、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。

2、截至本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华中证 1000 指数增强 A	鹏华中证 1000 指数增强 C	鹏华中证 1000 指数增强 I
基金合同生效 日（2022 年 12 月 26 日） 基金份额总额	167,000,706.79	41,458,941.72	—
本报告期期初 基金份额总额	815,882,604.25	851,235,922.07	731,194.67
本报告期基金 总申购份额	1,544,621,929.00	1,268,068,852.38	26,956,810.61
减：本报告期 基金总赎回份 额	1,389,661,159.53	1,370,049,384.46	25,787,990.82
本报告期基金 拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末 基金份额总额	970,843,373.72	749,255,389.99	1,900,014.46

§ 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

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 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。

10.6.4 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。

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(%)	
国信证券	3	12,641,935,555.85	100.00	2,476,685.12	100.00	本报告期新增1个

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(%)
国信证券	-	-	-	-	-	-

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	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 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	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 C 类基金份额和 I 类基金份额暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《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 02 月 27 日
6	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 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	2026 年 03 月 30 日

		站	
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部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	《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 31 日
8	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
9	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
10	鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 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
11	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
12	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
13	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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

(三)《鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金 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