

鹏华智投数字经济混合型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2024 年 05 月 17 日（基金合同生效日）起至 2024 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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、基金净值表现及利润分配情况	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
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	17
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	49

8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	67
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
8.12 投资组合报告附注	67
§ 9 基金份额持有人信息.....	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	69
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	69
§ 10 开放式基金份额变动.....	69
§ 11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4 基金投资策略的改变	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	76
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§ 13 备查文件目录	77
13.1 备查文件目录	77
13.2 存放地点	77
13.3 查阅方式	77

§ 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	14,388,682.50 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	3,053,224.97 份	11,335,457.53 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		4006788999	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年 5 月 17 日(基金合同生效日)-2024 年 12 月 31 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	4,398,942.34	6,743,767.51
本期利润	3,588,503.53	7,952,446.74
加权平均基金份额本期利润	0.2113	0.1635
本期加权平均净值利润率	21.02%	15.86%
本期基金份额净值增长率	28.58%	28.08%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	
期末可供分配利润	872,473.85	3,182,971.23
期末可供分配基金份额利润	0.2858	0.2808
期末基金资产净值	3,925,698.82	14,518,428.76
期末基金份额净值	1.2858	1.2808

3.1.3 累计 期末指标	2024 年末	
基金份额累 计净值增长 率	28.58%	28.08%

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

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

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

（4）本基金合同于 2024 年 05 月 17 日生效，至 2024 年 12 月 31 日未满一年，故 2024 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

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	10.27%	2.56%	12.22%	2.37%	-1.95%	0.19%
过去六个月	29.33%	2.25%	34.49%	2.16%	-5.16%	0.09%
自基金合同生效 起至今	28.58%	2.02%	29.46%	1.98%	-0.88%	0.04%

鹏华智投数字经济混合 C

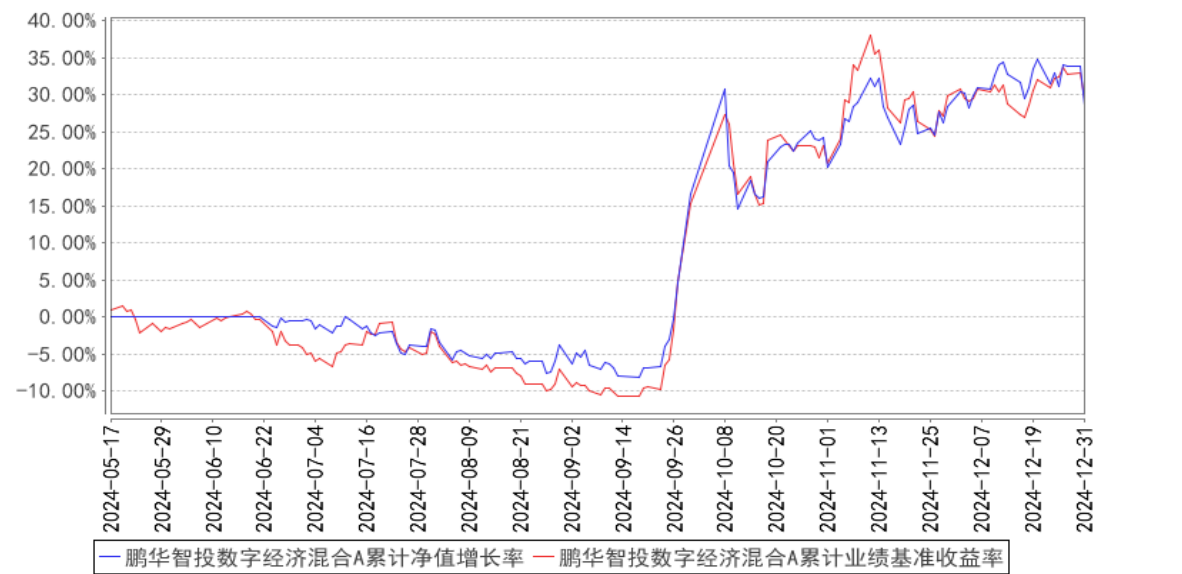
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	10.09%	2.56%	12.22%	2.37%	-2.13%	0.19%

过去六个月	28.93%	2.25%	34.49%	2.16%	-5.56%	0.09%
自基金合同生效 起至今	28.08%	2.02%	29.46%	1.98%	-1.38%	0.04%

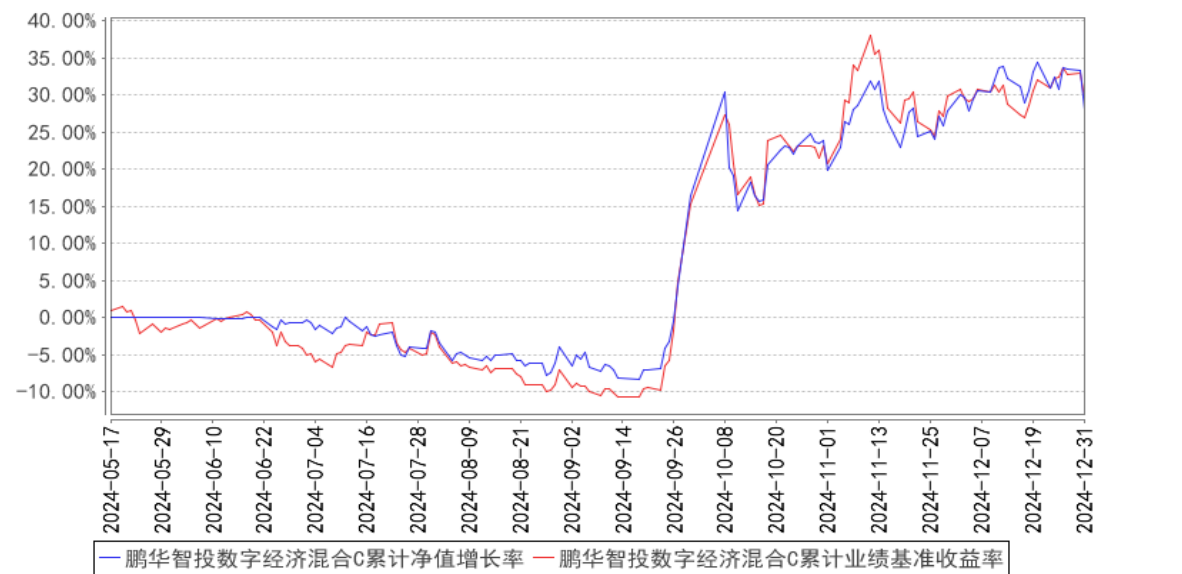
注：业绩比较基准=中证数字经济主题指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中债综合财富（总值）指数收益率×20%。

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

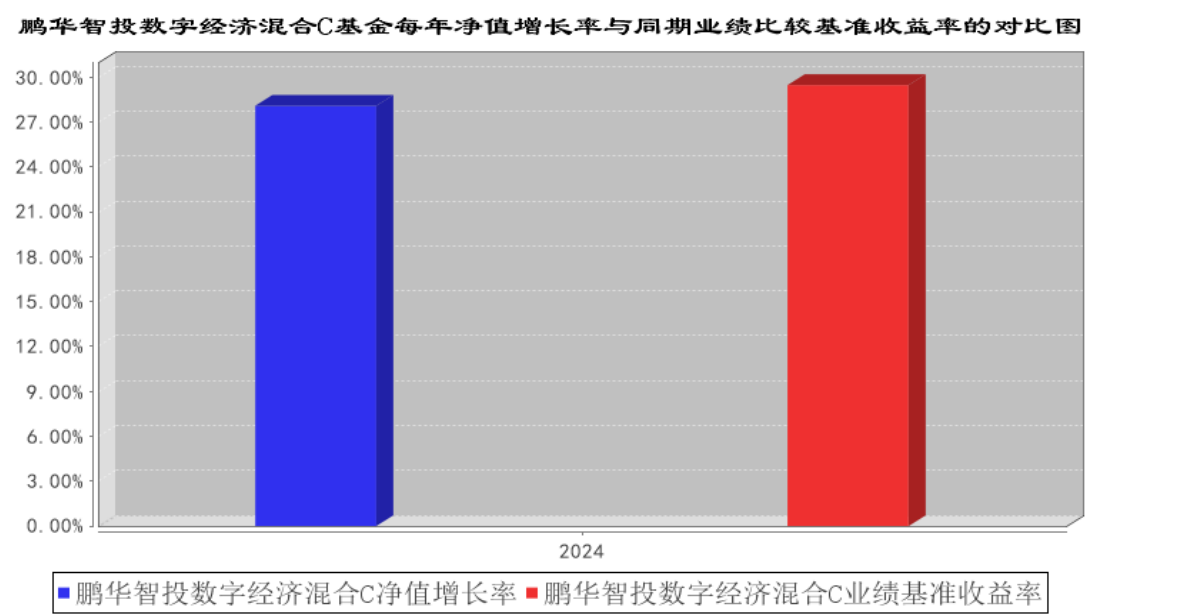
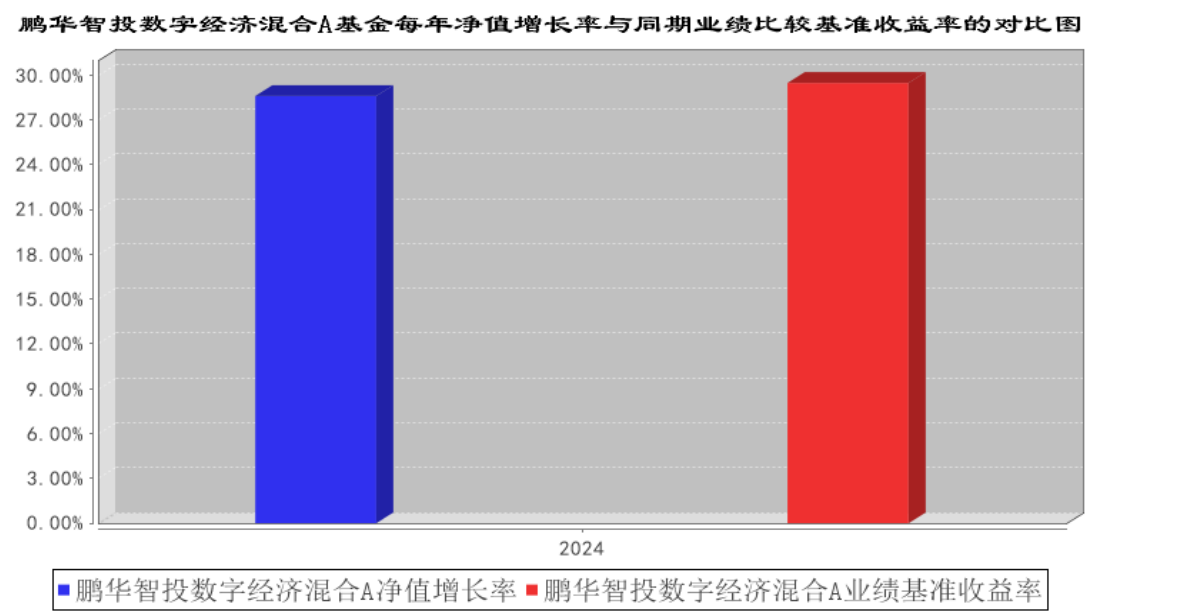


鹏华智投数字经济混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2024 年 05 月 17 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。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

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



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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达到 12,202 亿元，340 只公募基金、14 只全国社保投资组合、8 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏俊杰	基金经理	2024-05-17	-	12 年	苏俊杰先生，国籍中国，理学硕士，12 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 月至今担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理，2022 年 01 月至今担任鹏华中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 12 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华创业板指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，2023 年 02 月至今担任鹏华国证 2000

					指数增强型证券投资基金基金经理，2023 年 06 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 08 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2023 年 09 月至 2024 年 10 月担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 09 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理，2024 年 01 月至今担任鹏华智投 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，苏俊杰先生具备基金从业资格。本基金为本报告期内新成立基金，聘任苏俊杰为本基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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：无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管

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

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

在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、

债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、风控管理部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金成立于 2024 年 5 月 17 日，建仓期内市场先抑后扬，操作上以稳健建仓为主，在下跌过程中逐步提升股票仓位至合同规定的范围内。三季度末在政策的催化下，市场从底部快速反转，指数整体拉高，进入到四季度，以 AI、机器人等为代表的各类题材板块表现活跃，推动数字经济板块震荡走高。我们通过量化模型综合了基本面、量价、另类数据因子对数字经济产业链相关标的进行优选，力争取得超额收益。

展望未来，增量政策还在路上并且预期会不断加码，12 月初政治局会议定调“适度宽松”的货币政策和更加积极的财政政策，进一步提振了市场信心；随后的中央经济工作会议明确提出要大力推进新型工业化，发展数字经济，加快推动人工智能发展的要求。我们相信政策最终会传导到实体经济基本面，上市公司业绩逐步改善带来的基本面驱动行情也有望逐步展开，并推动数字经济板块开启更加持续健康的上行。此外前瞻性指标显示数字经济板块更多细分方向有望在 2025 年迎来基本面拐点，市场经过年初的调整后，相关板块也有望在一季度的春季行情中开始反映相关预期。

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 28.58%，同期业绩比较基准增长率为 29.46%；

C 类份额净值增长率为 28.08%，同期业绩比较基准增长率为 29.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，2025 年中国股市的核心矛盾将逐步转向盈利驱动。随着国内经济结构的持续优化和政策的加码，市场将获得更多的支撑。行业层面，聚焦新质生产力落地，这将为相关行业带来新的增长点，科技制造与能源转型将成为双线并行的主要驱动力。

资金层面，中长期资金的入场速度将加快，随着养老金、保险资金等中长期资金占比的提升，机构投资者比率将进一步增强。这将有助于降低市场的波动率，提升市场的稳定性。然而，市场仍需警惕政策效果滞后及中美博弈升温等内外部风险。政策效果的滞后可能导致市场预期与实际经济表现出现偏差，而中美博弈的升温则可能对市场情绪产生负面影响。

在投资策略上，短期应把握高股息和成长股的轮动节奏。高股息股票在利率下行环境中具有较高的吸引力，而成长股则受益于科技和能源转型的长期趋势。长期来看，投资者应聚焦价值投资，选择那些具有持续盈利能力和良好治理结构的公司，以应对市场的不确定性和波动。

总体而言，2025 年的中国股市将面临新的挑战 and 机遇，把握政策导向的同时紧跟行业趋势，以应对复杂多变的市场环境。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

1、继续完善内部控制体系

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

2、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

报告期内，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

3、开展以风险为导向的内部稽核

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，鹏华智投数字经济混合 A 期末可供分配利润为 872,473.85 元，期末基金份额净值 1.2858 元；鹏华智投数字经济混合 C 期末可供分配利润为 3,182,971.23 元，期末基金份额净值 1.2808 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2024 年 10 月 08 日至 2024 年 11 月 28 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。

本基金自 2024 年 07 月 04 日至 2024 年 08 月 08 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——鹏华基金管理有限公司 2024 年 05 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，鹏华基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(25)第 P02747 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了鹏华智投数字经济混合型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了鹏华智投数字经济

	混合型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于鹏华智投数字经济混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括鹏华智投数字经济混合型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估鹏华智投数字经济混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算鹏华智投数字经济混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督鹏华智投数字经济混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职

	业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对鹏华智投数字经济混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鹏华智投数字经济混合型证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	江丽雅	林婷婷
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2025 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏华智投数字经济混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	7.4.7.1	12,365,253.09
结算备付金		305,478.82
存出保证金		44,523.88

交易性金融资产	7.4.7.2	17,176,729.72
其中：股票投资		17,176,729.72
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		12,367,352.14
应收股利		-
应收申购款		76,365.35
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		42,335,703.00
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		23,695,400.60
应付管理人报酬		56,012.40
应付托管费		9,335.39
应付销售服务费		26,014.53
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	7.4.7.9	104,812.50
负债合计		23,891,575.42
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	14,388,682.50
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	4,055,445.08
净资产合计		18,444,127.58

负债和净资产总计		42,335,703.00
----------	--	---------------

注：（1）报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额为 14,388,682.50 份，其中鹏华智投数字经济混合 A 基金份额总额为 3,053,224.97 份，基金份额净值 1.2858 元；鹏华智投数字经济混合 C 基金份额总额为 11,335,457.53 份，基金份额净值 1.2808 元。（2）本财务报表的实际编制期间为 2024 年 05 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日，无上年度末数据。

7.2 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：2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 5 月 17 日（基金合 同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		12,347,306.50
1. 利息收入		229,571.90
其中：存款利息收入	7.4.7.13	229,571.90
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）		11,505,947.36
其中：股票投资收益	7.4.7.14	11,306,173.97
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	199,773.39
以摊余成本计量的金融资 产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	7.4.7.20	398,240.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填 列）	7.4.7.21	213,546.82
减：二、营业总支出		806,356.23
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	502,418.31
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	83,736.36

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	186,822.26
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.23	33,379.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,540,950.27
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,540,950.27
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		11,540,950.27

注：本财务报表的实际编制期间为 2024 年 05 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间，无上年度可比期间及可比较数据。

7.3 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：2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	226,463,076.83	-	-	226,463,076.83
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	4,055,445.08	-208,018,949.25
	212,074,394.33			
（一）、综合收益总额	-	-	11,540,950.27	11,540,950.27
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	-	-	-7,485,505.19	-219,559,899.52
	212,074,394.33			

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	56,700,808.25	-	11,290,527.12	67,991,335.37
2. 基金赎回款	- 268,775,202.58	-	-18,776,032.31	-287,551,234.89
(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	14,388,682.50	-	4,055,445.08	18,444,127.58

注：本财务报表的实际编制期间为 2024 年 05 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间，无上年度可比较期间及可比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 05 月 17 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 05 月 17 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 05 月 17 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产的分类

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

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

以摊余成本计量:

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

（2）金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损

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

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

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，

如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税（和/或）股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将

投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营

成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

税。

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	12,365,253.09
等于：本金	12,363,503.59
加：应计利息	1,749.50
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	12,365,253.09

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		16,778,489.30	-	17,176,729.72	398,240.42
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	16,778,489.30	-	17,176,729.72	398,240.42

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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.01
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	74,812.49
其中：交易所市场	74,812.49
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	30,000.00
合计	104,812.50

7.4.7.10 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 2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	50,027,235.78	50,027,235.78
本期申购	2,061,608.16	2,061,608.16
本期赎回（以“-”号填列）	-49,035,618.97	-49,035,618.97
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	3,053,224.97	3,053,224.97

鹏华智投数字经济混合 C

项目	本期 2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	176,435,841.05	176,435,841.05
本期申购	54,639,200.09	54,639,200.09

本期赎回（以“-”号填列）	-219,739,583.61	-219,739,583.61
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	11,335,457.53	11,335,457.53

注：1、本基金自 2024 年 4 月 8 日至 2024 年 5 月 15 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 226,286,858.38 元，折合为 226,286,858.38 份基金份额（其中 A 类基金份额 49,981,963.59 份，C 类基金份额 176,304,894.79 份）。根据《鹏华智投数字经济混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 176,218.45 元，在本基金成立后，折合为 176,218.45 份基金份额（其中 A 类基金份额 45,272.19 份，C 类基金份额 130,946.26 份），划入基金份额持有人账户。

2、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 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
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,398,942.34	-810,438.81	3,588,503.53
本期基金份额交易产生的变动数	-2,292,381.82	-423,647.86	-2,716,029.68
其中：基金申购款	847,101.15	-330,012.45	517,088.70
基金赎回款	-3,139,482.97	-93,635.41	-3,233,118.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,106,560.52	-1,234,086.67	872,473.85

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
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	6,743,767.51	1,208,679.23	7,952,446.74

本期基金份额交易产生的变动数	1,008,329.48	-5,777,804.99	-4,769,475.51
其中：基金申购款	25,487,162.98	-14,713,724.56	10,773,438.42
基金赎回款	-24,478,833.50	8,935,919.57	-15,542,913.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,752,096.99	-4,569,125.76	3,182,971.23

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	119,372.81
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	110,004.88
其他	194.21
合计	229,571.90

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。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年5月17日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	11,306,173.97
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	11,306,173.97

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	155,876,059.06
减：卖出股票成本总额	144,322,197.87
减：交易费用	247,687.22
买卖股票差价收入	11,306,173.97

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	199,773.39
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	199,773.39

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	398,240.42
股票投资	398,240.42
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	398,240.42

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	210,434.90
基金转换费收入	3,111.92
合计	213,546.82

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	2,968.22
存托服务费	11.08
其他	400.00
合计	33,379.30

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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

注：1、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于 2024 年 05 月 17 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	502,418.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	241,735.14
应支付基金管理人的净管理费	260,683.17

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	83,736.36

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华智投数字经济混 合 A	鹏华智投数字经济混 合 C	合计
鹏华基金公司	-	974.48	974.48
中国农业银行	-	49,146.07	49,146.07
合计	-	50,120.55	50,120.55

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入

中国农业银行	12,365,253.09	119,372.81
--------	---------------	------------

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。本基金在上年度可比期间未成立。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.12.2 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
688139	海尔生物	2024 年 12 月 23 日	重大事项	35.20	2025 年 1 月 7 日	30.60	14,700	491,009.85	517,440.00	-
300807	天迈科技	2024 年 12 月 30 日	重大事项	30.31	2025 年 1 月 7 日	36.37	11,000	329,086.43	333,410.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（未满一年）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短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 2024 年 12 月 31 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	12,365,253.09	-	-	-	12,365,253.09
结算备付金	305,478.82	-	-	-	305,478.82
存出保证金	44,523.88	-	-	-	44,523.88
交易性金融资产	-	-	-	17,176,729.72	17,176,729.72
应收申购款	-	-	-	76,365.35	76,365.35
应收清算款	-	-	-	12,367,352.14	12,367,352.14
资产总计	12,715,255.79	-	-	29,620,447.21	42,335,703.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	23,695,400.60	23,695,400.60
应付管理人报酬	-	-	-	56,012.40	56,012.40
应付托管费	-	-	-	9,335.39	9,335.39
应付销售服务费	-	-	-	26,014.53	26,014.53
其他负债	-	-	-	104,812.50	104,812.50
负债总计	-	-	-	23,891,575.42	23,891,575.42
利率敏感度缺口	12,715,255.79	-	-	5,728,871.79	18,444,127.58

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	17,176,729.72	93.13
交易性金融资产—基金投资	—	—
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	17,176,729.72	93.13

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2024 年 12 月 31 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	16,325,879.72

第二层次	850,850.00
第三层次	-
合计	17,176,729.72

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：无。

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

注：无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	17,176,729.72	40.57
	其中：股票	17,176,729.72	40.57
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	12,670,731.91	29.93
8	其他各项资产	12,488,241.37	29.50
9	合计	42,335,703.00	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：28,500.00 元，占净值比 0.15%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	11,749,235.85	63.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,525.00	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	33,803.00	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	316,119.00	1.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,640,858.87	25.16
J	金融业	157,950.00	0.86
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	116,645.00	0.63
M	科学研究和技术服务业	33,853.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	71,505.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	50,235.00	0.27
S	综合	-	-
	合计	17,176,729.72	93.13

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	688139	海尔生物	14,700	517,440.00	2.81
2	300807	天迈科技	11,000	333,410.00	1.81
3	601766	中国中车	34,900	292,462.00	1.59
4	000725	京东方 A	65,300	286,667.00	1.55
5	688369	致远互联	13,300	266,931.00	1.45
6	600066	宇通客车	9,900	261,162.00	1.42
7	688009	中国通号	41,600	260,416.00	1.41
8	002938	鹏鼎控股	7,000	255,360.00	1.38
9	300433	蓝思科技	11,300	247,470.00	1.34
10	603766	隆鑫通用	26,500	241,150.00	1.31
11	300866	安克创新	2,200	214,808.00	1.16
12	600592	龙溪股份	21,100	208,468.00	1.13
13	002432	九安医疗	5,100	207,978.00	1.13
14	600745	闻泰科技	5,300	205,534.00	1.11
15	300145	中金环境	53,900	199,969.00	1.08
16	002139	拓邦股份	14,500	197,345.00	1.07
17	300369	绿盟科技	27,100	194,849.00	1.06
18	300515	三德科技	16,300	194,133.00	1.05
19	688023	安恒信息	4,700	191,760.00	1.04
20	301221	光庭信息	3,900	189,462.00	1.03
21	688208	道通科技	4,600	180,136.00	0.98
22	600718	东软集团	16,300	175,551.00	0.95
23	688152	麒麟信安	3,300	171,732.00	0.93
24	002906	华阳集团	5,500	169,125.00	0.92
25	300766	每日互动	11,400	166,554.00	0.90
26	601318	中国平安	3,000	157,950.00	0.86
27	601222	林洋能源	22,000	155,540.00	0.84
28	600563	法拉电子	1,301	154,714.92	0.84
29	002212	天融信	23,500	151,575.00	0.82
30	300476	胜宏科技	3,600	151,524.00	0.82
31	688070	纵横股份	4,200	148,260.00	0.80
32	002468	申通快递	14,300	144,859.00	0.79
33	300113	顺网科技	8,600	144,566.00	0.78
34	688252	天德钰	6,000	143,700.00	0.78
35	002023	海特高新	13,900	141,085.00	0.76
36	600487	亨通光电	8,000	137,760.00	0.75

37	688002	睿创微纳	2,900	136,329.00	0.74
38	301339	通行宝	6,700	136,278.00	0.74
39	688772	珠海冠宇	8,300	133,464.00	0.72
40	002970	锐明技术	2,800	133,364.00	0.72
41	688579	山大地纬	14,367	132,032.73	0.72
42	688079	美迪凯	15,100	130,766.00	0.71
43	603713	密尔克卫	2,500	128,000.00	0.69
44	688158	优刻得-W	9,100	127,218.00	0.69
45	688326	经纬恒润-W	1,500	126,150.00	0.68
46	688685	迈信林	3,800	126,122.00	0.68
47	688100	威胜信息	3,478	125,903.60	0.68
48	688048	长光华芯	3,100	120,869.00	0.66
49	301389	隆扬电子	7,200	120,384.00	0.65
50	000738	航发控制	5,400	120,096.00	0.65
51	688609	九联科技	11,300	119,780.00	0.65
52	600523	贵航股份	9,900	118,008.00	0.64
53	300548	博创科技	2,500	116,025.00	0.63
54	688015	交控科技	5,800	115,014.00	0.62
55	300552	万集科技	3,200	109,920.00	0.60
56	002649	博彦科技	9,000	109,080.00	0.59
57	600183	生益科技	4,400	105,820.00	0.57
58	605333	沪光股份	3,200	104,416.00	0.57
59	688191	智洋创新	6,100	103,822.00	0.56
60	300030	阳普医疗	18,800	103,776.00	0.56
61	688099	晶晨股份	1,500	103,020.00	0.56
62	688322	奥比中光-UW	2,200	102,300.00	0.55
63	002920	德赛西威	900	99,099.00	0.54
64	688608	恒玄科技	300	97,611.00	0.53
65	300730	科创信息	8,000	97,360.00	0.53
66	603236	移远通信	1,400	95,816.00	0.52
67	300771	智莱科技	9,100	95,732.00	0.52
68	688213	思特威-W	1,200	93,264.00	0.51
69	300454	深信服	1,600	91,840.00	0.50
70	002916	深南电路	700	87,500.00	0.47
71	688232	新点软件	3,000	86,970.00	0.47
72	688668	鼎通科技	1,825	85,519.50	0.46
73	688088	虹软科技	2,200	84,832.00	0.46
74	301002	崧盛股份	4,900	83,251.00	0.45
75	688536	思瑞浦	900	83,250.00	0.45
76	000333	美的集团	1,100	82,742.00	0.45
77	002410	广联达	6,800	79,968.00	0.43
78	603613	国联股份	2,900	77,082.00	0.42
79	603893	瑞芯微	700	77,042.00	0.42

80	300638	广和通	3,800	76,570.00	0.42
81	002396	星网锐捷	3,992	75,808.08	0.41
82	300579	数字认证	2,400	75,408.00	0.41
83	300602	飞荣达	3,900	74,958.00	0.41
84	603329	上海雅仕	5,800	74,762.00	0.41
85	300674	宇信科技	3,800	74,176.00	0.40
86	300628	亿联网络	1,900	73,340.00	0.40
87	300244	迪安诊断	6,300	71,505.00	0.39
88	688207	格灵深瞳	4,900	69,776.00	0.38
89	002668	TCL 智家	5,200	68,224.00	0.37
90	002281	光迅科技	1,300	67,821.00	0.37
91	600418	江淮汽车	1,800	67,500.00	0.37
92	688365	光云科技	5,864	66,321.84	0.36
93	300001	特锐德	3,000	65,850.00	0.36
94	688080	映翰通	2,000	65,840.00	0.36
95	603486	科沃斯	1,400	65,800.00	0.36
96	300570	太辰光	900	65,430.00	0.35
97	688018	乐鑫科技	300	65,400.00	0.35
98	300996	普联软件	3,600	65,232.00	0.35
99	300424	航新科技	3,600	65,016.00	0.35
100	600391	航发科技	3,200	63,520.00	0.34
101	300440	运达科技	8,000	63,360.00	0.34
102	300836	佰奥智能	1,500	63,165.00	0.34
103	300048	合康新能	12,500	63,000.00	0.34
104	600633	浙数文化	5,900	61,714.00	0.33
105	000821	京山轻机	4,900	61,005.00	0.33
106	002241	歌尔股份	2,300	59,363.00	0.32
107	603596	伯特利	1,300	57,967.00	0.31
108	688522	纳睿雷达	1,000	56,340.00	0.31
109	000550	江铃汽车	2,400	56,280.00	0.31
110	002463	沪电股份	1,400	55,510.00	0.30
111	002008	大族激光	2,200	55,000.00	0.30
112	300458	全志科技	1,400	54,264.00	0.29
113	600869	远东股份	11,400	54,150.00	0.29
114	300750	宁德时代	200	53,200.00	0.29
115	000338	潍柴动力	3,800	52,060.00	0.28
116	301031	中熔电气	500	52,010.00	0.28
117	300079	数码视讯	9,500	51,395.00	0.28
118	600728	佳都科技	10,800	50,544.00	0.27
119	300365	恒华科技	8,200	50,348.00	0.27
120	600690	海尔智家	1,700	48,399.00	0.26
121	600316	洪都航空	1,500	48,180.00	0.26
122	688279	峰岬科技	300	47,310.00	0.26

123	002845	同兴达	3,100	46,996.00	0.25
124	000977	浪潮信息	900	46,692.00	0.25
125	688568	中科星图	900	45,927.00	0.25
126	688205	德科立	500	45,500.00	0.25
127	002368	太极股份	1,900	44,992.00	0.24
128	002837	英维克	1,100	44,440.00	0.24
129	301321	翰博高新	2,900	41,760.00	0.23
130	688498	源杰科技	300	40,260.00	0.22
131	002371	北方华创	100	39,100.00	0.21
132	300987	川网传媒	2,700	38,232.00	0.21
133	002384	东山精密	1,300	37,960.00	0.21
134	301205	联特科技	500	37,845.00	0.21
135	301218	华是科技	1,700	36,941.00	0.20
136	301165	锐捷网络	500	36,100.00	0.20
137	600131	国网信通	1,900	35,929.00	0.19
138	600050	中国联通	6,300	33,453.00	0.18
139	000050	深天马 A	3,600	32,508.00	0.18
140	300133	华策影视	4,500	32,490.00	0.18
141	601633	长城汽车	1,200	31,596.00	0.17
142	688360	德马科技	1,700	31,586.00	0.17
143	301011	华立科技	1,200	30,828.00	0.17
144	688509	正元地信	7,700	30,569.00	0.17
145	688508	芯朋微	700	30,079.00	0.16
146	688041	海光信息	200	29,958.00	0.16
147	601231	环旭电子	1,800	29,700.00	0.16
148	689009	九号公司-WD	600	28,500.00	0.15
149	002594	比亚迪	100	28,266.00	0.15
150	688228	开普云	630	28,072.80	0.15
151	603583	捷昌驱动	1,100	27,181.00	0.15
152	300018	中元股份	4,000	27,080.00	0.15
153	601127	赛力斯	200	26,678.00	0.14
154	002841	视源股份	700	25,837.00	0.14
155	688286	敏芯股份	415	25,003.75	0.14
156	002273	水晶光电	1,100	24,442.00	0.13
157	688330	宏力达	900	23,616.00	0.13
158	300502	新易盛	200	23,116.00	0.13
159	300790	宇瞳光学	1,200	22,908.00	0.12
160	000768	中航西飞	800	22,592.00	0.12
161	601728	中国电信	3,100	22,382.00	0.12
162	600582	天地科技	3,600	22,248.00	0.12
163	601012	隆基绿能	1,400	21,994.00	0.12
164	001339	智微智能	600	21,954.00	0.12
165	000997	新大陆	1,100	21,945.00	0.12

166	300259	新天科技	6,100	21,350.00	0.12
167	600990	四创电子	1,000	21,280.00	0.12
168	000547	航天发展	2,900	21,199.00	0.11
169	000901	航天科技	1,900	20,843.00	0.11
170	300253	卫宁健康	2,900	20,764.00	0.11
171	600739	辽宁成大	2,000	20,700.00	0.11
172	605365	立达信	1,300	20,410.00	0.11
173	600125	铁龙物流	3,400	20,162.00	0.11
174	000636	风华高科	1,400	20,090.00	0.11
175	600438	通威股份	900	19,899.00	0.11
176	002063	远光软件	3,400	19,584.00	0.11
177	688039	当虹科技	700	18,949.00	0.10
178	600104	上汽集团	900	18,684.00	0.10
179	300448	浩云科技	2,600	17,134.00	0.09
180	300486	东杰智能	2,400	16,416.00	0.09
181	002322	理工能科	1,300	16,367.00	0.09
182	600584	长电科技	400	16,344.00	0.09
183	688255	凯尔达	600	16,026.00	0.09
184	600741	华域汽车	900	15,849.00	0.09
185	600699	均胜电子	1,000	15,670.00	0.08
186	300150	世纪瑞尔	3,400	14,892.00	0.08
187	600373	中文传媒	1,100	13,805.00	0.07
188	688049	炬芯科技	300	13,461.00	0.07
189	688095	福昕软件	200	13,432.00	0.07
190	002284	亚太股份	1,700	13,158.00	0.07
191	300349	金卡智能	900	12,303.00	0.07
192	688092	爱科科技	600	12,300.00	0.07
193	300206	理邦仪器	1,100	12,298.00	0.07
194	603855	华荣股份	600	12,174.00	0.07
195	300916	朗特智能	400	12,000.00	0.07
196	300781	因赛集团	200	11,806.00	0.06
197	688588	凌志软件	837	11,550.60	0.06
198	600707	彩虹股份	1,400	11,508.00	0.06
199	002577	雷柏科技	600	11,358.00	0.06
200	300880	迦南智能	500	11,100.00	0.06
201	301110	青木科技	180	11,077.20	0.06
202	603068	博通集成	400	11,060.00	0.06
203	603516	淳中科技	200	11,056.00	0.06
204	603015	弘讯科技	1,100	10,747.00	0.06
205	000524	岭南控股	1,100	10,648.00	0.06
206	603501	韦尔股份	100	10,441.00	0.06
207	001314	亿道信息	200	10,370.00	0.06
208	300840	酷特智能	500	10,010.00	0.05

209	601598	中国外运	1,800	9,630.00	0.05
210	000157	中联重科	1,300	9,399.00	0.05
211	301179	泽宇智能	500	9,335.00	0.05
212	300550	和仁科技	600	9,090.00	0.05
213	603128	华贸物流	1,400	9,002.00	0.05
214	300249	依米康	700	8,946.00	0.05
215	300884	狄耐克	800	8,944.00	0.05
216	300768	迪普科技	500	8,750.00	0.05
217	600057	厦门象屿	1,300	8,437.00	0.05
218	300546	雄帝科技	500	8,410.00	0.05
219	300543	朗科智能	800	8,384.00	0.05
220	603160	汇顶科技	100	8,054.00	0.04
221	002876	三利谱	300	7,698.00	0.04
222	300252	金信诺	700	7,532.00	0.04
223	603556	海兴电力	200	7,398.00	0.04
224	300352	北信源	1,400	7,392.00	0.04
225	003028	振邦智能	200	7,170.00	0.04
226	300832	新产业	100	7,085.00	0.04
227	688682	霍莱沃	200	6,960.00	0.04
228	688590	新致软件	430	6,892.90	0.04
229	002517	恺英网络	500	6,805.00	0.04
230	000887	中鼎股份	500	6,560.00	0.04
231	688595	芯海科技	200	6,560.00	0.04
232	300040	九洲集团	900	6,525.00	0.04
233	002655	共达电声	500	6,365.00	0.03
234	002870	香山股份	200	6,260.00	0.03
235	300590	移为通信	400	6,184.00	0.03
236	002152	广电运通	500	5,830.00	0.03
237	300031	宝通科技	300	5,496.00	0.03
238	300279	和晶科技	900	5,454.00	0.03
239	688292	浩瀚深度	271	5,365.80	0.03
240	300324	旋极信息	1,600	5,296.00	0.03
241	603648	畅联股份	500	5,130.00	0.03
242	003019	宸展光电	200	5,116.00	0.03
243	002373	千方科技	500	5,070.00	0.03
244	002937	兴瑞科技	300	5,070.00	0.03
245	002467	二六三	900	4,968.00	0.03
246	300882	万胜智能	300	4,824.00	0.03
247	002913	奥士康	200	4,822.00	0.03
248	002957	科瑞技术	300	4,707.00	0.03
249	600219	南山铝业	1,200	4,692.00	0.03
250	603203	快克智能	200	4,604.00	0.02
251	600271	航天信息	500	4,555.00	0.02

252	000651	格力电器	100	4,545.00	0.02
253	600787	中储股份	700	4,466.00	0.02
254	002556	辉隆股份	800	4,456.00	0.02
255	002707	众信旅游	600	4,434.00	0.02
256	603416	信捷电气	100	4,195.00	0.02
257	603788	宁波高发	300	4,149.00	0.02
258	300507	苏奥传感	600	4,020.00	0.02
259	601921	浙版传媒	500	3,940.00	0.02
260	002539	云图控股	500	3,910.00	0.02
261	600038	中直股份	100	3,856.00	0.02
262	300408	三环集团	100	3,851.00	0.02
263	300578	会畅通讯	200	3,850.00	0.02
264	002380	科远智慧	200	3,696.00	0.02
265	300682	朗新集团	300	3,660.00	0.02
266	002402	和而泰	200	3,622.00	0.02
267	300270	中威电子	500	3,575.00	0.02
268	000034	神州数码	100	3,505.00	0.02
269	300123	亚光科技	600	3,480.00	0.02
270	600511	国药股份	100	3,422.00	0.02
271	603018	华设集团	400	3,284.00	0.02
272	002881	美格智能	100	2,996.00	0.02
273	301199	迈赫股份	100	2,933.00	0.02
274	002036	联创电子	300	2,820.00	0.02
275	002180	纳思达	100	2,817.00	0.02
276	300378	鼎捷数智	100	2,587.00	0.01
277	002558	巨人网络	200	2,538.00	0.01
278	000521	长虹美菱	300	2,448.00	0.01
279	601138	工业富联	100	2,150.00	0.01
280	002508	老板电器	100	2,143.00	0.01
281	000682	东方电子	200	2,142.00	0.01
282	603803	瑞斯康达	200	1,908.00	0.01
283	301039	中集车辆	200	1,810.00	0.01
284	688201	信安世纪	200	1,766.00	0.01
285	600180	瑞茂通	400	1,720.00	0.01
286	300532	今天国际	150	1,713.00	0.01
287	300168	万达信息	200	1,588.00	0.01
288	600602	云赛智联	100	1,582.00	0.01
289	000785	居然智家	400	1,428.00	0.01
290	601677	明泰铝业	100	1,203.00	0.01
291	300002	神州泰岳	100	1,159.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002410	广联达	1,648,594.00	8.94
2	688369	致远互联	1,488,670.45	8.07
3	002938	鹏鼎控股	1,310,723.00	7.11
4	000725	京东方 A	1,219,855.00	6.61
5	300628	亿联网络	1,210,448.60	6.56
6	000333	美的集团	1,170,369.00	6.35
7	600487	亨通光电	1,166,340.00	6.32
8	002139	拓邦股份	1,113,977.00	6.04
9	600066	宇通客车	1,103,043.00	5.98
10	688099	晶晨股份	1,096,818.83	5.95
11	601766	中国中车	1,089,139.00	5.91
12	688009	中国通号	1,073,685.60	5.82
13	688023	安恒信息	1,050,885.73	5.70
14	300369	绿盟科技	1,027,688.00	5.57
15	002352	顺丰控股	1,027,206.00	5.57
16	688213	思特威-W	1,022,247.08	5.54
17	688608	恒玄科技	1,020,123.79	5.53
18	603713	密尔克卫	1,012,325.00	5.49
19	600183	生益科技	995,473.00	5.40
20	600690	海尔智家	985,559.00	5.34
21	603766	隆鑫通用	980,479.00	5.32
22	688039	当虹科技	960,339.57	5.21
23	002212	天融信	939,788.00	5.10
24	300866	安克创新	935,043.25	5.07
25	601127	赛力斯	931,937.00	5.05
26	600131	国网信通	921,012.00	4.99
27	688208	道通科技	910,231.80	4.94
28	002281	光迅科技	900,891.00	4.88
29	600718	东软集团	895,874.00	4.86
30	688668	鼎通科技	885,830.49	4.80
31	600215	派斯林	884,309.00	4.79
32	603486	科沃斯	876,572.00	4.75
33	300552	万集科技	875,370.00	4.75
34	688159	有方科技	874,577.04	4.74
35	002463	沪电股份	872,507.00	4.73
36	688031	星环科技-U	869,792.36	4.72
37	688201	信安世纪	848,441.91	4.60
38	002916	深南电路	846,749.00	4.59
39	002468	申通快递	827,397.00	4.49
40	002837	英维克	818,115.00	4.44
41	688579	山大地纬	812,807.37	4.41
42	688100	威胜信息	812,043.03	4.40

43	688286	敏芯股份	810,194.80	4.39
44	002906	华阳集团	806,433.00	4.37
45	300433	蓝思科技	801,846.00	4.35
46	002970	锐明技术	796,997.00	4.32
47	002432	九安医疗	794,312.00	4.31
48	300771	智莱科技	784,576.00	4.25
49	301165	锐捷网络	777,157.00	4.21
50	300458	全志科技	759,657.00	4.12
51	300308	中际旭创	756,924.00	4.10
52	002023	海特高新	743,165.00	4.03
53	688522	纳睿雷达	740,884.92	4.02
54	601598	中国外运	739,577.00	4.01
55	603236	移远通信	739,455.00	4.01
56	002229	鸿博股份	731,626.00	3.97
57	301221	光庭信息	730,180.00	3.96
58	688139	海尔生物	720,064.40	3.90
59	600998	九州通	706,779.00	3.83
60	601318	中国平安	704,067.00	3.82
61	600592	龙溪股份	702,212.00	3.81
62	300515	三德科技	696,087.00	3.77
63	688018	乐鑫科技	687,937.48	3.73
64	688088	虹软科技	677,695.16	3.67
65	300440	运达科技	665,743.00	3.61
66	002517	恺英网络	662,522.00	3.59
67	688568	中科星图	660,775.43	3.58
68	002845	同兴达	649,855.00	3.52
69	688152	麒麟信安	649,505.35	3.52
70	300083	创世纪	643,465.00	3.49
71	300145	中金环境	614,986.00	3.33
72	688322	奥比中光-UW	613,290.08	3.33
73	300766	每日互动	610,235.00	3.31
74	002396	星网锐捷	609,996.00	3.31
75	002008	大族激光	606,597.00	3.29
76	688066	航天宏图	604,533.61	3.28
77	688499	利元亨	600,507.17	3.26
78	600633	浙数文化	597,552.00	3.24
79	000338	潍柴动力	589,659.00	3.20
80	688252	天德钰	588,649.43	3.19
81	000738	航发控制	587,062.00	3.18
82	688079	美迪凯	585,991.60	3.18
83	601222	林洋能源	565,093.00	3.06
84	688787	海天瑞声	563,989.69	3.06
85	002384	东山精密	546,570.00	2.96

86	688365	光云科技	545,017.26	2.95
87	605365	立达信	539,751.00	2.93
88	605186	健麾信息	539,093.00	2.92
89	300031	宝通科技	536,471.00	2.91
90	688685	迈信林	533,072.62	2.89
91	300274	阳光电源	531,871.00	2.88
92	002123	梦网科技	529,814.00	2.87
93	300181	佐力药业	529,481.00	2.87
94	600563	法拉电子	529,264.25	2.87
95	002241	歌尔股份	526,283.00	2.85
96	603018	华设集团	526,147.00	2.85
97	688080	映翰通	523,046.46	2.84
98	300543	朗科智能	523,028.00	2.84
99	300244	迪安诊断	518,238.00	2.81
100	688070	纵横股份	513,517.75	2.78
101	688095	福昕软件	505,841.21	2.74
102	301031	中熔电气	499,917.00	2.71
103	300307	慈星股份	496,621.00	2.69
104	301162	国能日新	495,037.00	2.68
105	300570	太辰光	494,428.00	2.68
106	688327	云从科技-UW	493,644.95	2.68
107	603883	老百姓	491,605.00	2.67
108	002380	科远智慧	489,306.00	2.65
109	300302	同有科技	487,824.00	2.64
110	688326	经纬恒润-W	486,617.98	2.64
111	002649	博彦科技	482,240.00	2.61
112	300251	光线传媒	482,118.00	2.61
113	301205	联特科技	478,147.00	2.59
114	688686	奥普特	473,420.52	2.57
115	601633	长城汽车	467,773.00	2.54
116	600869	远东股份	464,772.00	2.52
117	601098	中南传媒	464,533.00	2.52
118	300259	新天科技	462,939.00	2.51
119	300502	新易盛	462,489.00	2.51
120	603025	大豪科技	462,089.00	2.51
121	688158	优刻得-W	461,980.73	2.50
122	600050	中国联通	461,274.00	2.50
123	603556	海兴电力	461,067.00	2.50
124	300807	天迈科技	460,721.00	2.50
125	000050	深天马 A	455,379.00	2.47
126	300476	胜宏科技	451,701.00	2.45
127	300750	宁德时代	450,051.00	2.44
128	301061	匠心家居	449,824.00	2.44

129	688232	新点软件	447,961.15	2.43
130	688360	德马科技	447,478.85	2.43
131	603893	瑞芯微	446,737.00	2.42
132	301110	青木科技	445,781.40	2.42
133	300365	恒华科技	444,235.00	2.41
134	002090	金智科技	441,427.00	2.39
135	688772	珠海冠宇	440,934.43	2.39
136	002870	香山股份	440,632.00	2.39
137	601728	中国电信	439,777.00	2.38
138	600761	安徽合力	437,613.00	2.37
139	300840	酷特智能	435,919.00	2.36
140	688205	德科立	435,782.98	2.36
141	301339	通行宝	435,015.00	2.36
142	600707	彩虹股份	433,794.00	2.35
143	002602	ST 华通	433,596.00	2.35
144	300638	广和通	432,079.00	2.34
145	689009	九号公司-WD	427,098.90	2.32
146	600219	南山铝业	427,086.00	2.32
147	002301	齐心集团	426,425.00	2.31
148	688002	睿创微纳	425,573.59	2.31
149	300882	万胜智能	425,350.00	2.31
150	688308	欧科亿	425,039.01	2.30
151	601138	工业富联	423,841.00	2.30
152	601717	郑煤机	423,458.00	2.30
153	603501	韦尔股份	422,316.50	2.29
154	000521	长虹美菱	422,182.00	2.29
155	002138	顺络电子	422,127.00	2.29
156	688036	传音控股	421,544.79	2.29
157	002790	瑞尔特	420,451.00	2.28
158	002279	久其软件	419,229.00	2.27
159	002111	威海广泰	416,830.00	2.26
160	300048	合康新能	416,685.00	2.26
161	300002	神州泰岳	416,614.00	2.26
162	300379	东方通	415,639.00	2.25
163	300113	顺网科技	413,769.00	2.24
164	688609	九联科技	413,733.63	2.24
165	001339	智微智能	412,391.00	2.24
166	300311	任子行	412,198.00	2.23
167	300880	迦南智能	408,331.00	2.21
168	300773	拉卡拉	407,531.00	2.21
169	300661	圣邦股份	404,181.00	2.19
170	603583	捷昌驱动	403,138.00	2.19
171	688698	伟创电气	401,712.67	2.18

172	601677	明泰铝业	401,381.00	2.18
173	601607	上海医药	399,488.00	2.17
174	002291	遥望科技	398,372.00	2.16
175	002322	理工能科	396,639.00	2.15
176	002409	雅克科技	394,272.00	2.14
177	688015	交控科技	391,720.43	2.12
178	002273	水晶光电	390,061.00	2.11
179	003028	振邦智能	388,195.00	2.10
180	002474	榕基软件	387,818.00	2.10
181	600104	上汽集团	387,510.00	2.10
182	600745	闻泰科技	386,594.00	2.10
183	300466	赛摩智能	386,585.00	2.10
184	600523	贵航股份	386,547.00	2.10
185	688508	芯朋微	383,818.70	2.08
186	688048	长光华芯	378,514.01	2.05
187	603613	国联股份	377,343.00	2.05
188	300579	数字认证	376,902.00	2.04
189	300394	天孚通信	372,404.00	2.02
190	688301	奕瑞科技	371,107.13	2.01
191	300674	宇信科技	370,456.00	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002410	广联达	1,638,496.00	8.88
2	688608	恒玄科技	1,274,321.23	6.91
3	300628	亿联网络	1,263,152.00	6.85
4	002938	鹏鼎控股	1,185,279.00	6.43
5	000333	美的集团	1,159,730.19	6.29
6	600487	亨通光电	1,153,542.00	6.25
7	688369	致远互联	1,133,162.16	6.14
8	688213	思特威-W	1,121,657.41	6.08
9	688099	晶晨股份	1,106,100.20	6.00
10	301165	锐捷网络	1,086,377.00	5.89
11	002139	拓邦股份	1,074,710.00	5.83
12	688201	信安世纪	1,014,779.12	5.50
13	688039	当虹科技	1,012,088.89	5.49
14	688023	安恒信息	1,004,624.20	5.45
15	002352	顺丰控股	998,151.00	5.41
16	600690	海尔智家	996,514.00	5.40
17	688031	星环科技-U	995,541.22	5.40
18	000725	京东方 A	994,932.00	5.39

19	600183	生益科技	993,923.00	5.39
20	002281	光迅科技	992,255.00	5.38
21	688159	有方科技	989,810.31	5.37
22	688668	鼎通科技	975,680.26	5.29
23	601127	赛力斯	974,043.00	5.28
24	688286	敏芯股份	970,416.15	5.26
25	600066	宇通客车	966,514.00	5.24
26	688208	道通科技	909,363.55	4.93
27	300369	绿盟科技	908,119.00	4.92
28	300866	安克创新	906,618.00	4.92
29	603713	密尔克卫	904,759.00	4.91
30	688018	乐鑫科技	899,313.07	4.88
31	600215	派斯林	888,593.00	4.82
32	600131	国网信通	874,911.00	4.74
33	603766	隆鑫通用	865,192.00	4.69
34	688009	中国通号	862,873.60	4.68
35	002916	深南电路	861,492.00	4.67
36	002463	沪电股份	861,293.00	4.67
37	601766	中国中车	857,418.00	4.65
38	688522	纳睿雷达	845,254.83	4.58
39	002212	天融信	840,890.00	4.56
40	002837	英维克	823,981.00	4.47
41	603486	科沃斯	808,218.00	4.38
42	002468	申通快递	807,802.00	4.38
43	300308	中际旭创	804,082.00	4.36
44	688568	中科星图	790,443.75	4.29
45	603236	移远通信	783,420.00	4.25
46	300458	全志科技	778,549.00	4.22
47	300552	万集科技	777,334.00	4.21
48	600998	九州通	770,019.00	4.17
49	002229	鸿博股份	756,656.00	4.10
50	600718	东软集团	755,197.00	4.09
51	601598	中国外运	748,592.00	4.06
52	300274	阳光电源	729,695.00	3.96
53	688088	虹软科技	699,457.22	3.79
54	300440	运达科技	694,109.00	3.76
55	002970	锐明技术	686,279.00	3.72
56	688100	威胜信息	685,876.67	3.72
57	300771	智莱科技	677,254.00	3.67
58	002517	恺英网络	669,225.00	3.63
59	688579	山大地纬	666,251.76	3.61
60	300083	创世纪	659,934.00	3.58
61	002906	华阳集团	655,653.00	3.55

62	688365	光云科技	648,284.82	3.51
63	688322	奥比中光-UW	638,229.77	3.46
64	300433	蓝思科技	628,468.00	3.41
65	300773	拉卡拉	619,219.00	3.36
66	002396	星网锐捷	614,919.72	3.33
67	605186	健麾信息	609,725.00	3.31
68	688095	福昕软件	609,493.42	3.30
69	688066	航天宏图	606,600.24	3.29
70	002845	同兴达	603,964.00	3.27
71	688499	利元亨	596,427.00	3.23
72	002023	海特高新	595,990.00	3.23
73	601318	中国平安	591,028.00	3.20
74	002384	东山精密	587,284.00	3.18
75	688787	海天瑞声	580,991.66	3.15
76	002008	大族激光	579,858.00	3.14
77	300031	宝通科技	570,759.00	3.09
78	300181	佐力药业	570,235.00	3.09
79	688252	天德钰	562,340.52	3.05
80	300302	同有科技	561,678.00	3.05
81	688301	奕瑞科技	555,626.85	3.01
82	002123	梦网科技	552,860.00	3.00
83	300311	任子行	549,612.00	2.98
84	301221	光庭信息	545,561.00	2.96
85	002432	九安医疗	542,817.00	2.94
86	300543	朗科智能	539,716.00	2.93
87	688686	奥普特	538,105.09	2.92
88	600633	浙数文化	529,240.00	2.87
89	300515	三德科技	520,555.00	2.82
90	301162	国能日新	520,475.00	2.82
91	002380	科远智慧	500,218.00	2.71
92	600050	中国联通	498,719.00	2.70
93	300002	神州泰岳	491,922.00	2.67
94	300502	新易盛	487,795.00	2.64
95	002279	久其软件	486,708.00	2.64
96	300661	圣邦股份	486,074.00	2.64
97	002241	歌尔股份	483,922.00	2.62
98	688327	云从科技-UW	482,853.98	2.62
99	601098	中南传媒	482,570.00	2.62
100	300244	迪安诊断	481,439.00	2.61
101	000338	潍柴动力	481,217.00	2.61
102	603893	瑞芯微	481,013.00	2.61
103	300352	北信源	480,181.00	2.60
104	605365	立达信	478,380.00	2.59

105	301061	匠心家居	478,142.00	2.59
106	300307	慈星股份	475,779.00	2.58
107	603025	大豪科技	473,890.00	2.57
108	300251	光线传媒	472,850.00	2.56
109	000738	航发控制	471,321.00	2.56
110	688698	伟创电气	470,881.89	2.55
111	300259	新天科技	469,543.00	2.55
112	603018	华设集团	468,127.00	2.54
113	688205	德科立	466,439.29	2.53
114	600219	南山铝业	466,344.00	2.53
115	688079	美迪凯	465,646.44	2.52
116	603556	海兴电力	465,586.00	2.52
117	301205	联特科技	464,819.00	2.52
118	600592	龙溪股份	461,872.00	2.50
119	601138	工业富联	458,215.00	2.48
120	300884	狄耐克	457,450.00	2.48
121	002870	香山股份	454,876.00	2.47
122	688036	传音控股	454,240.00	2.46
123	300145	中金环境	454,112.00	2.46
124	688080	映翰通	450,612.20	2.44
125	002474	榕基软件	449,118.00	2.44
126	002301	齐心集团	448,997.00	2.43
127	601677	明泰铝业	447,044.00	2.42
128	601728	中国电信	442,745.00	2.40
129	300766	每日互动	442,401.00	2.40
130	300570	太辰光	442,037.00	2.40
131	688360	德马科技	441,351.48	2.39
132	601607	上海医药	440,940.60	2.39
133	301031	中熔电气	440,181.00	2.39
134	688308	欧科亿	436,806.52	2.37
135	300880	迦南智能	436,099.00	2.36
136	301110	青木科技	434,769.80	2.36
137	002090	金智科技	433,407.00	2.35
138	002602	ST 华通	433,052.00	2.35
139	002273	水晶光电	430,715.00	2.34
140	000050	深天马 A	428,789.00	2.32
141	601633	长城汽车	426,981.00	2.31
142	300379	东方通	424,500.00	2.30
143	603939	益丰药房	421,633.00	2.29
144	001339	智微智能	420,001.00	2.28
145	688685	迈信林	419,992.24	2.28
146	600869	远东股份	419,538.00	2.27
147	300394	天孚通信	417,471.80	2.26

148	002335	科华数据	415,454.00	2.25
149	002138	顺络电子	415,427.00	2.25
150	603583	捷昌驱动	414,085.00	2.25
151	002409	雅克科技	412,237.00	2.24
152	600588	用友网络	411,048.00	2.23
153	300448	浩云科技	408,541.00	2.22
154	002291	遥望科技	408,097.00	2.21
155	689009	九号公司-WD	407,881.16	2.21
156	300882	万胜智能	407,460.00	2.21
157	688049	炬芯科技	407,203.02	2.21
158	601222	林洋能源	404,944.00	2.20
159	000902	新洋丰	403,898.00	2.19
160	600707	彩虹股份	403,811.00	2.19
161	000521	长虹美菱	403,321.00	2.19
162	300466	赛摩智能	401,232.00	2.18
163	603501	韦尔股份	400,542.00	2.17
164	300750	宁德时代	400,378.00	2.17
165	688588	凌志软件	399,219.29	2.16
166	300365	恒华科技	397,615.00	2.16
167	300048	合康新能	392,725.00	2.13
168	688292	浩瀚深度	392,044.62	2.13
169	002111	威海广泰	390,193.00	2.12
170	603128	华贸物流	389,647.00	2.11
171	002583	海能达	389,569.00	2.11
172	688152	麒麟信安	388,757.69	2.11
173	600761	安徽合力	388,456.00	2.11
174	300604	长川科技	387,388.00	2.10
175	300623	捷捷微电	386,802.00	2.10
176	002322	理工能科	385,399.00	2.09
177	002649	博彦科技	380,964.00	2.07
178	688158	优刻得-W	378,501.00	2.05
179	300231	银信科技	374,525.00	2.03
180	688778	厦钨新能	373,175.37	2.02
181	601567	三星医疗	371,767.00	2.02

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	161,100,687.17
卖出股票收入（成交）总额	155,876,059.06

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	44,523.88
2	应收清算款	12,367,352.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	76,365.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,488,241.37

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.12.5 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	688139	海尔生物	517,440.00	2.81	重大事项停牌
2	300807	天迈科技	333,410.00	1.81	重大事项停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
鹏华智投数字经济混合 A	155	19,698.23	0.00	0.00	3,053,224.97	100.00
鹏华智投	140	80,967.55	0.00	0.00	11,335,457.53	100.00

数字经济混合 C						
合计	295	48,775.19	0.00	0.00	14,388,682.50	100.00

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华智投数字经济混合 A	40,131.85	1.3144
	鹏华智投数字经济混合 C	10,013.95	0.0883
	合计	50,145.80	0.3485

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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未持有本基金份额。

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

注：无。

§ 10 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,061,608.16	54,639,200.09
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	49,035,618.97	219,739,583.61
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	3,053,224.97	11,335,457.53

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原副总经理王宗合先生因个人身体原因辞职，经公司第六届董事会第二百零四次会议审议通过，自 2024 年 2 月 6 日起，王宗合先生不再担任公司副总经理。

报告期内，公司原副总经理邢彪先生因个人原因辞职，经公司第六届董事会第二百一十七次董事会审议通过，自 2024 年 4 月 11 日起，邢彪先生不再担任公司副总经理。

报告期内，公司原董事长、董事何如先生因退休原因不再担任公司第六届董事会董事长、董事，经公司 2024 年第三次临时股东会会议、第六届董事会第二百一十八次董事会审议通过，聘任张纳沙女士担任公司第六届董事会董事长、董事，任职日期自 2024 年 4 月 12 日起。

报告期内，公司副总经理刘钦先生不再兼任北京分公司总经理，经公司 2024 年第十五次总裁办公会审议通过，聘任田智勇先生担任北京分公司总经理，任职日期自 2024 年 5 月 7 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 30,000.00 元。该审计机构为本基金提供审计服务的期间为本基金基金合同生效日（2024 年 05 月 17 日）起到本报告期末，不满 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关责任人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 19 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正及警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定未严格执行，个别业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人高度重视，按照法律法规及相关要求积极落实整改工作。截至报告日，上述事项已整改完毕
其他	-

注：无。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投证券	1	61,964,066.40	19.55	27,940.77	18.70	本报告期新增
东北证券	1	40,416,614.11	12.75	18,224.31	12.20	本报告期新增
华泰证券	1	32,067,358.41	10.12	14,461.62	9.68	本报告期新增
申万宏源证券	3	30,105,891.20	9.50	13,576.76	9.09	本报告期新增
光大证券	1	28,824,109.24	9.09	12,996.95	8.70	本报告期新增
东方证券	1	26,676,542.85	8.42	12,028.34	8.05	本报告期新增
信达证券	1	25,775,888.25	8.13	11,622.88	7.78	本报告期

						新增
国金证券	1	24,729,503.66	7.80	11,151.30	7.46	本报告期新增
长江证券	1	21,989,317.40	6.94	9,914.96	6.64	本报告期新增
中信证券	1	13,805,197.00	4.36	12,718.88	8.51	本报告期新增
海通证券	1	10,362,235.17	3.27	4,673.61	3.13	本报告期新增
浙商证券	1	260,022.54	0.08	117.25	0.08	本报告期新增
长城证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
东兴证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
广发证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
国投证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
太平洋证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
西南证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
银河证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
中金公司	1	-	-	-	-	本报告期新增

注：交易单元选择的标准和程序：

1. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称《规定》），基金管理人制定了相应的管理制度规范交易单元选择的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买

卖的证券公司，选择标准包括：财务状况良好，经营行为规范；有完备的合规管理流程和制度，风险控制能力较强；研究、交易等服务能力较强，交易设施能够为投资组合提供有效的交易执行；中国证监会或有权机关规定的其他条件等。

2. 选择程序如下：

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

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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(%)
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证	-	-	-	-	-	-

券						
海通证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 26 日
2	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金份额发售公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 26 日
3	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 26 日
4	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金托管协议	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 26 日
5	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金合同	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 26 日
6	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金招募说明书	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 26 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金持有的股票估值方法变	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监	2024 年 03 月 30 日

	更的提示性公告	会基金电子披露网站	
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》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
9	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
10	鹏华基金管理有限公司关于鹏华智投数字经济混合型证券投资基金调整募集期限的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 26 日
11	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 10 日
12	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型类型的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 16 日
13	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 18 日
14	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低赎回份额和账户最低份额余额限制的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 12 日
15	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 14 日
16	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》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 28 日
17	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》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 28 日
18	鹏华基金管理有限公司关于终止与喜鹊财富基金销售有限公司销售合作关系的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 12 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 13 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与渤海证券股份有限公司认/申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 29 日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 09 月 25 日

22	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 24 日
23	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》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 06 日
24	关于鹏华智投数字经济混合型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的风险提示公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 19 日
25	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 18 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加招商银行股份有限公司基金转换业务申购补差费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 19 日

注：无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20240619~20240619	20,002,700.00	0.00	20,002,700.00	0.00	0.00
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比列过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投资份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)《鹏华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 2024 年年度报告》(原文)。

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2025 年 3 月 28 日