

鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指
数证券投资基金
2025 年中期报告

2025 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：2025 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，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	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	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	46

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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末上市基金前十名持有人	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	48
§ 9 开放式基金份额变动.....	48
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	1000ETF 增强
场内简称	1000 鹏华(扩位简称:1000ETF 增强)
基金主代码	560590
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 1 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	13,710,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求有效跟踪标的指数基础上，通过主动化投资管理，力争获取超越指数表现的投资收益。
投资策略	1、股票投资策略 本基金以中证 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，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争获取超越指数表现的投资收益。 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 0.35%，年跟踪误差不超过 6.5%。

	(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。 (4) 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。 2、债券投资策略 本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。 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。 3、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 4、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。 5、融资及转融通投资策略 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。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金在履行适当程序后可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时本基金具有与标的指数以及

	标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。
--	----------------------

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	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		4006788999	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	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	184,091.46
本期利润	1,528,799.87
加权平均基金份额本期利润	0.1099
本期加权平均净值利润率	9.95%
本期基金份额净值增长率	8.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,308,701.14
期末可供分配基金份额利润	0.1684

期末基金资产净值	16,018,701.14
期末基金份额净值	1.1684
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	16.84%

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

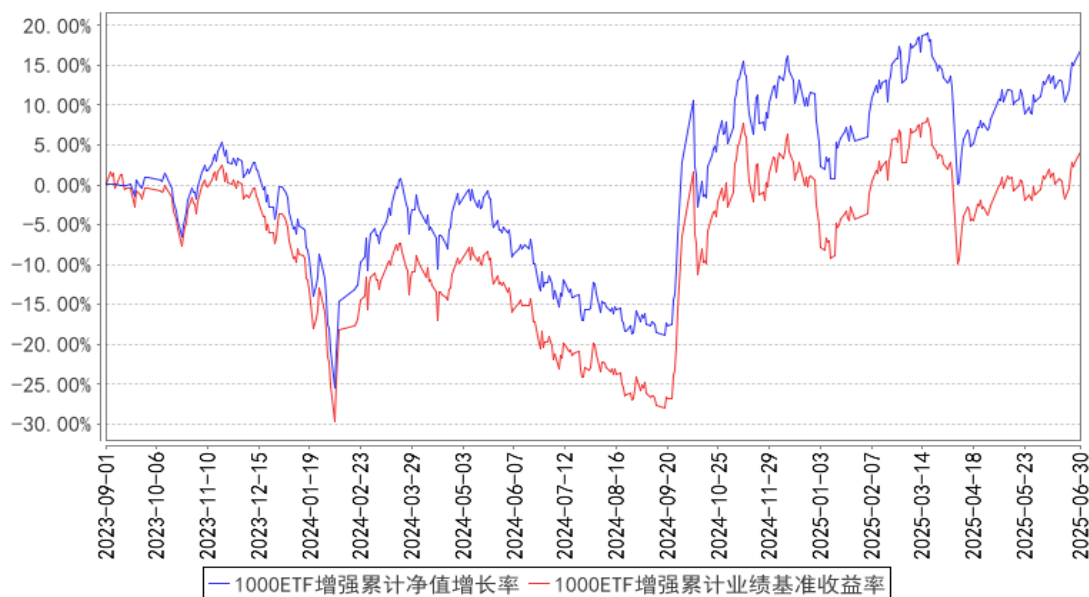
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	5.81%	0.91%	5.47%	0.94%	0.34%	-0.03%
过去三个月	3.62%	1.75%	2.08%	1.82%	1.54%	-0.07%
过去六个月	8.14%	1.59%	6.69%	1.64%	1.45%	-0.05%
过去一年	33.12%	1.84%	29.82%	1.97%	3.30%	-0.13%
自基金合同生效起至今	16.84%	1.73%	4.13%	1.83%	12.71%	-0.10%

注：业绩比较基准=中证 1000 指数收益率。

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

1000ETF增强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 2023 年 09 月 01 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 12,513 亿元，359 只公募基金、12 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		
寇斌权	本基金的基金经理	2023-12-09	-	7 年	寇斌权先生, 国籍中国, 物理学博士, 7 年证券从业经验。2018 年 7 月加盟鹏华基

					金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部大数据分析研究助理、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。2023 年 06 月至今担任鹏华弘华灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 09 月至 2025 年 06 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 09 月至今担任鹏华弘达灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华畅享债券型证券投资基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 08 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发起式联接基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华安荣混合型证券投资基金基金经理，2025 年 06 月至今担任鹏华中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，寇斌权先生具备基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等

各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金在控制相对基准指数中证 1000 指数跟踪误差的基础上，采用量化模型选股，力争稳健地获取相对基准的超额收益。量化选股模型继续坚持动态配置不同预测收益来源、不同预测周期的因子；并继续加大对低相关性、有效投资因子的研发力度。与此同时，持续跟踪市场波动加剧时期的资金面和情绪面对风格切换的影响。通过在策略端、风控端两个维度的优化来提升组合的收益风险比。我们继续以稳健均衡、动态适应市场环境的风格、在模型长期有效性和对短期市场环境波动的适应性中寻找平衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 8.14%，同期业绩比较基准增长率为 6.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，尽管由于海外市场政策的不确定性阶段性对权益市场造成了一定冲击，但权益市场整体表现相对较为良好。在 AI、机器人、创新药、国防尖端装备等新兴科技或高端装备行业，国内与海外的技术差距大幅缩小甚至部分细分领域反超海外市场，一方面带动了国内和海外投资者对于中国科技企业的风险偏好大幅上升，港股市场的估值修复对 A 股市场形成积极利好；另一方面市场从基本面为重转为兼顾挖掘结构性机会、带来了细分板块良性的轮动效应，也充分利好小盘成长板块风格。除去二季度初受关税问题影响、A 股市场出现的冲击性调整，市场整体波动率处于下行状态，而不同风险偏好、不同配置周期的资金逐步增加 A 股权益端配置，A 股权益市场有望进入长期、稳步抬升整体估值通道。

展望后续市场。短期来看最大的不确定性还是来自于中美关税问题，这种不确定性的冲击性作用在宏观维度逐步趋弱，而对细分板块例如芯片产业链等的影响还是会持续性的出现阶段性扰动，对中长期趋势影响可能会逐步回归国内宏观基本面是否出现显著的积极信号。我们预计后续市场整体的上行和下行空间均有限的情况还会延续一段时间，继续看好 AI 特别是大模型方面的持续进步和突破，基座模型和推理模型的能力不断提升，对各个行业带来的技术升级、产业变革机会，

相对利好科技成长风格。

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，本基金期末可供分配利润为 2,308,701.14 元，期末基金份额净值 1.1684 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,054,767.96	1,142,002.85
结算备付金		-	130,131.42
存出保证金		22,512.19	22,922.51
交易性金融资产	6.4.7.2	14,957,120.01	16,742,615.02
其中：股票投资		14,957,120.01	16,742,615.02
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	68,032.79
资产总计		16,034,400.16	18,105,704.59
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,605.18	13,322.15
应付托管费		1,613.47	2,497.90
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	5,480.37	34,893.80
负债合计		15,699.02	50,713.85
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	13,710,000.00	16,710,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,308,701.14	1,344,990.74
净资产合计		16,018,701.14	18,054,990.74
负债和净资产总计		16,034,400.16	18,105,704.59

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1684 元，基金份额总额 13,710,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,603,093.82	-1,960,832.77
1. 利息收入		2,085.59	4,238.51
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,085.59	4,238.51

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）		149,833.92	-1,057,175.77
其中：股票投资收益	6.4.7.14	56,971.59	-1,297,227.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	92,862.33	240,051.80
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,344,708.41	-1,015,602.80
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	106,465.90	107,707.29
减：二、营业总支出		74,293.95	221,689.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	61,825.91	102,287.68
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,592.31	19,178.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	875.73	100,223.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,528,799.87	-2,182,522.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,528,799.87	-2,182,522.46

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,528,799.87	-2,182,522.46

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	16,710,000.00	-	1,344,990.74	18,054,990.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	16,710,000.00	-	1,344,990.74	18,054,990.74
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,000,000.00	-	963,710.40	-2,036,289.60
(一)、综合收益总额	-	-	1,528,799.87	1,528,799.87
(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)	-3,000,000.00	-	-565,089.47	-3,565,089.47
其中：1. 基金申购款	36,000,000.00	-	3,993,655.11	39,993,655.11
2. 基金赎回款	-39,000,000.00	-	-4,558,744.58	-43,558,744.58
(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	13,710,000.00	-	2,308,701.14	16,018,701.14
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	19,710,000.00	-	-45,485.58	19,664,514.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	19,710,000.00	-	-45,485.58	19,664,514.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,000,000.00	-	-2,731,365.32	268,634.68
(一)、综合收益总额	-	-	-2,182,522.46	-2,182,522.46
(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)	3,000,000.00	-	-548,842.86	2,451,157.14
其中：1. 基金申购款	87,000,000.00	-	-6,508,827.18	80,491,172.82
2. 基金赎回款	-84,000,000.00	-	5,959,984.32	-78,040,015.68
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	22,710,000.00	-	-2,776,850.90	19,933,149.10

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 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(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]428 号《关于准予鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数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 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,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 205,710,000.00 元,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(23)第 00220 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2023 年 9 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 205,710,000.00 份基金份额,无认购资金利息份额。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《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 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。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,054,767.96
等于：本金	1,054,662.19
加：应计利息	105.77
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,054,767.96

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	14,081,831.20	-	14,957,120.01	875,288.81
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		14,081,831.20	-	14,957,120.01	875,288.81

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,480.37
其中：交易所市场	5,480.37
银行间市场	-
应付利息	-
合计	5,480.37

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,710,000.00	16,710,000.00
本期申购	36,000,000.00	36,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-39,000,000.00	-39,000,000.00
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	13,710,000.00	13,710,000.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,947,011.79	-1,602,021.05	1,344,990.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,947,011.79	-1,602,021.05	1,344,990.74
本期利润	184,091.46	1,344,708.41	1,528,799.87
本期基金份额交易产生的变动数	-495,365.30	-69,724.17	-565,089.47
其中：基金申购款	7,187,117.64	-3,193,462.53	3,993,655.11
基金赎回款	-7,682,482.94	3,123,738.36	-4,558,744.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,635,737.95	-327,036.81	2,308,701.14

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,810.74
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	222.66
其他	52.19
合计	2,085.59

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	38,400.41
股票投资收益——赎回差价收入	18,571.18
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	56,971.59

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	50,429,380.86
减：卖出股票成本总额	50,340,905.30
减：交易费用	50,075.15
买卖股票差价收入	38,400.41

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	43,558,744.58
减：现金支付赎回款总额	28,979,497.58
减：赎回股票成本总额	14,560,675.82
减：交易费用	—
赎回差价收入	18,571.18

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益**6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	92,862.33
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	92,862.33

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,344,708.41
股票投资	1,344,708.41
债券投资	-
资产支持证券投资	-

基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,344,708.41

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	106,465.90
合计	106,465.90

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	875.73
合计	875.73

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金的一级交易商

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	71,186,144.78	71.61	90,804,760.67	83.94

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	13,229.46	71.60	3,531.58	64.44

关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	74,579.50	88.97	32,004.82	77.90

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	61,825.91	102,287.68
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,102.83	4,738.99
应支付基金管理人的净管理费	53,723.08	97,548.69

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,592.31	19,178.96

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

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
招商银行	1, 054, 767. 96	1, 810. 74	1, 764, 157. 67	2, 921. 19

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金在迷你期间如涉及信息披露费、审计费等固定费用的，上述费用由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。本基金本报告期内基金管理人承担的上述各类费用合计为人民币 113,558.90 元（该金额为未经审计的预估金额）。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金。本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（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、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中

国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

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

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 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2024 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

于 2025 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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 2025 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	1,054,767.96	-	-	-	1,054,767.96
存出保证金	22,512.19	-	-	-	22,512.19
交易性金融资产	-	-	-	14,957,120.01	14,957,120.01
资产总计	1,077,280.15	-	-	14,957,120.01	16,034,400.16
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,605.18	8,605.18
应付托管费	-	-	-	1,613.47	1,613.47
其他负债	-	-	-	5,480.37	5,480.37
负债总计	-	-	-	15,699.02	15,699.02
利率敏感度缺口	1,077,280.15	-	-	14,941,420.99	16,018,701.14
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,142,002.85	-	-	-	1,142,002.85
结算备付金	130,131.42	-	-	-	130,131.42
存出保证金	22,922.51	-	-	-	22,922.51
交易性金融资产	-	-	-	16,742,615.02	16,742,615.02
其他资产	-	-	-	68,032.79	68,032.79
资产总计	1,295,056.78	-	-	16,810,647.81	18,105,704.59

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	13,322.15	13,322.15
应付托管费	-	-	-	2,497.90	2,497.90
其他负债	-	-	-	34,893.80	34,893.80
负债总计	-	-	-	50,713.85	50,713.85
利率敏感度缺口	1,295,056.78	-	-	16,759,933.96	18,054,990.74

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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：投资于股票及存托凭证资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金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，应当保持不低于交易保证金一

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	14,957,120.01	93.37	16,742,615.02	92.73
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	14,957,120.01	93.37	16,742,615.02	92.73

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	743,748.29	842,716.69
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-743,748.29	-842,716.69

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日
第一层次	14,957,120.01
第二层次	—
第三层次	—
合计	14,957,120.01

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	14,957,120.01	93.28
	其中：股票	14,957,120.01	93.28
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	1,054,767.96	6.58
8	其他各项资产	22,512.19	0.14
9	合计	16,034,400.16	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7. 2 的合计项不含可退替代款估值增值。

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	104,940.00	0.66
B	采矿业	66,321.00	0.41
C	制造业	8,838,569.72	55.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	202,768.00	1.27
E	建筑业	168,340.00	1.05
F	批发和零售业	308,164.00	1.92
G	交通运输、仓储和邮政业	166,595.00	1.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件	2,272,180.64	14.18

	和信息技术服务业		
J	金融业	100,662.90	0.63
K	房地产业	64,192.00	0.40
L	租赁和商务服务业	342,357.00	2.14
M	科学研究和技术服务业	167,216.00	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	286,048.00	1.79
S	综合	-	-
	合计	13,088,354.26	81.71

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,502,450.95	9.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	148,400.00	0.93
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,024.80	0.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	109,890.00	0.69
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,868,765.75	11.67

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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	002174	游族网络	17,900	217,127.00	1.36
2	002891	中宠股份	3,500	216,545.00	1.35
3	300682	朗新集团	9,200	216,200.00	1.35
4	300315	掌趣科技	33,900	205,773.00	1.28
5	688166	博瑞医药	3,400	182,614.00	1.14
6	300762	上海瀚讯	7,900	178,777.00	1.12
7	300811	铂科新材	3,800	176,358.00	1.10
8	603005	晶方科技	6,200	176,018.00	1.10
9	000657	中钨高新	14,400	170,784.00	1.07
10	300182	捷成股份	30,800	169,708.00	1.06
11	002171	楚江新材	17,400	169,302.00	1.06
12	300226	上海钢联	7,300	166,732.00	1.04
13	300079	数码视讯	28,200	164,970.00	1.03
14	600388	龙净环保	13,400	160,800.00	1.00
15	603229	奥翔药业	18,300	159,576.00	1.00
16	000059	华锦股份	29,500	159,005.00	0.99
17	300188	国投智能	11,400	157,320.00	0.98
18	603197	保隆科技	4,000	156,280.00	0.98
19	000811	冰轮环境	15,430	151,214.00	0.94
20	300257	开山股份	15,000	151,050.00	0.94
21	600821	金开新能	27,400	148,782.00	0.93
22	688347	华虹公司	2,700	148,257.00	0.93
23	600477	杭萧钢构	55,000	145,750.00	0.91
24	300672	国科微	1,700	144,364.00	0.90
25	688116	天奈科技	3,100	141,887.00	0.89
26	300298	三诺生物	6,200	140,058.00	0.87

27	002649	博彦科技	9,500	138,035.00	0.86
28	688018	乐鑫科技	940	137,334.00	0.86
29	600195	中牧股份	18,600	136,338.00	0.85
30	300463	迈克生物	11,400	135,660.00	0.85
31	600640	国脉文化	10,900	132,108.00	0.82
32	601137	博威合金	7,400	131,646.00	0.82
33	300725	药石科技	3,400	131,580.00	0.82
34	603083	剑桥科技	2,700	127,710.00	0.80
35	300171	东富龙	9,500	126,255.00	0.79
36	002020	京新药业	9,500	123,975.00	0.77
37	600623	华谊集团	16,300	123,391.00	0.77
38	603218	日月股份	9,500	120,555.00	0.75
39	300319	麦捷科技	11,200	120,288.00	0.75
40	002010	传化智联	21,300	118,854.00	0.74
41	002226	江南化工	20,400	118,320.00	0.74
42	600446	金证股份	6,200	117,614.00	0.73
43	601677	明泰铝业	9,100	113,022.00	0.71
44	603043	广州酒家	7,200	112,176.00	0.70
45	002913	奥士康	3,800	111,758.00	0.70
46	300593	新雷能	8,200	109,880.00	0.69
47	300133	华策影视	14,400	108,144.00	0.68
48	688556	高测股份	14,700	105,546.00	0.66
49	300624	万兴科技	1,700	105,485.00	0.66
50	000048	京基智农	6,600	104,940.00	0.66
51	603662	柯力传感	1,600	102,288.00	0.64
52	300777	中简科技	2,700	97,875.00	0.61
53	600827	百联股份	10,500	95,970.00	0.60
54	688321	微芯生物	4,000	95,120.00	0.59
55	300568	星源材质	7,400	93,832.00	0.59
56	002456	欧菲光	7,900	93,615.00	0.58
57	002126	银轮股份	3,800	92,264.00	0.58
58	300768	迪普科技	5,300	90,895.00	0.57
59	300773	拉卡拉	2,700	90,315.00	0.56
60	603866	桃李面包	16,300	88,020.00	0.55
61	600894	广日股份	8,200	86,018.00	0.54
62	300406	九强生物	6,000	84,900.00	0.53
63	002081	金螳螂	24,300	83,349.00	0.52
64	688559	海目星	2,500	82,250.00	0.51
65	600717	天津港	17,900	81,624.00	0.51
66	300693	盛弘股份	2,700	80,892.00	0.50
67	300570	太辰光	800	77,104.00	0.48
68	600782	新钢股份	21,500	76,110.00	0.48
69	688362	甬矽电子	2,500	74,450.00	0.46

70	300755	华致酒行	3,800	73,340.00	0.46
71	002567	唐人神	15,200	72,352.00	0.45
72	000628	高新发展	1,700	72,301.00	0.45
73	002326	永太科技	5,600	72,072.00	0.45
74	000901	航天科技	5,700	70,851.00	0.44
75	603236	移远通信	800	68,640.00	0.43
76	600531	豫光金铅	8,800	68,112.00	0.43
77	600058	五矿发展	8,800	68,024.00	0.42
78	002405	四维图新	7,900	67,466.00	0.42
79	002003	伟星股份	6,100	66,551.00	0.42
80	600100	同方股份	9,100	65,884.00	0.41
81	300151	昌红科技	5,300	65,243.00	0.41
82	688123	聚辰股份	800	64,792.00	0.40
83	002544	普天科技	2,700	63,315.00	0.40
84	300393	中来股份	10,900	62,784.00	0.39
85	002237	恒邦股份	5,300	62,540.00	0.39
86	002987	京北方	2,940	61,299.00	0.38
87	300036	超图软件	4,000	61,040.00	0.38
88	603888	新华网	2,500	59,850.00	0.37
89	002416	爱施德	4,900	58,898.00	0.37
90	002597	金禾实业	2,500	58,875.00	0.37
91	300456	赛微电子	3,400	58,446.00	0.36
92	300685	艾德生物	2,700	58,131.00	0.36
93	000970	中科三环	4,900	57,673.00	0.36
94	603063	禾望电气	1,700	57,562.00	0.36
95	002127	南极电商	14,300	56,771.00	0.35
96	002468	申通快递	5,300	56,657.00	0.35
97	000758	中色股份	11,200	56,336.00	0.35
98	002755	奥赛康	3,500	55,930.00	0.35
99	601222	林洋能源	9,800	55,860.00	0.35
100	688001	华兴源创	2,200	55,594.00	0.35
101	002023	海特高新	4,900	53,018.00	0.33
102	300525	博思软件	3,594	52,328.64	0.33
103	688484	南芯科技	1,300	51,415.00	0.32
104	600252	中恒集团	19,900	50,347.00	0.31
105	601528	瑞丰银行	8,600	49,794.00	0.31
106	600185	珠免集团	8,300	48,721.00	0.30
107	603308	应流股份	2,100	48,468.00	0.30
108	688612	威迈斯	1,800	48,132.00	0.30
109	688658	悦康药业	2,500	47,600.00	0.30
110	001309	德明利	400	47,336.00	0.30
111	603678	火炬电子	1,200	45,636.00	0.28
112	300926	博俊科技	1,700	44,999.00	0.28

113	600556	天下秀	8,600	43,860.00	0.27
114	601208	东材科技	4,600	43,608.00	0.27
115	300166	东方国信	4,000	43,600.00	0.27
116	300088	长信科技	7,300	43,508.00	0.27
117	688766	普冉股份	680	42,976.00	0.27
118	002506	协鑫集成	16,000	42,720.00	0.27
119	300821	东岳硅材	5,300	41,658.00	0.26
120	300045	华力创通	2,100	40,089.00	0.25
121	000581	威孚高科	2,100	39,774.00	0.25
122	600587	新华医疗	2,500	37,850.00	0.24
123	300181	佐力药业	2,100	36,393.00	0.23
124	688372	伟测科技	590	35,636.00	0.22
125	601126	四方股份	2,100	34,167.00	0.21
126	300598	诚迈科技	800	34,040.00	0.21
127	300119	瑞普生物	1,700	33,014.00	0.21
128	605333	沪光股份	1,200	32,940.00	0.21
129	605020	永和股份	1,400	32,256.00	0.20
130	002539	云图控股	3,400	31,892.00	0.20
131	688128	中国电研	1,300	31,850.00	0.20
132	605376	博迁新材	800	30,664.00	0.19
133	601882	海天精工	1,600	30,560.00	0.19
134	688007	光峰科技	2,082	30,105.72	0.19
135	600866	星湖科技	4,300	29,713.00	0.19
136	603533	掌阅科技	1,300	29,003.00	0.18
137	600458	时代新材	2,100	28,812.00	0.18
138	000099	中信海直	1,300	28,314.00	0.18
139	000801	四川九洲	1,800	28,116.00	0.18
140	600330	天通股份	3,900	27,963.00	0.17
141	002215	诺普信	2,700	27,891.00	0.17
142	601519	大智慧	2,700	27,513.00	0.17
143	300101	振芯科技	1,200	27,156.00	0.17
144	300772	运达股份	2,100	27,048.00	0.17
145	301511	德福科技	1,200	24,840.00	0.16
146	002745	木林森	3,100	24,428.00	0.15
147	300674	宇信科技	800	24,232.00	0.15
148	300303	聚飞光电	3,800	24,092.00	0.15
149	002859	洁美科技	1,200	23,892.00	0.15
150	300613	富瀚微	400	19,552.00	0.12
151	002212	天融信	2,500	19,250.00	0.12
152	600459	贵研铂业	1,200	18,612.00	0.12
153	000966	长源电力	4,000	18,000.00	0.11
154	300779	惠城环保	100	17,849.00	0.11
155	000767	晋控电力	6,000	17,160.00	0.11

156	600201	生物股份	2,100	16,842.00	0.11
157	603025	大豪科技	1,200	16,824.00	0.11
158	600114	东睦股份	800	16,272.00	0.10
159	000821	京山轻机	1,400	16,226.00	0.10
160	600864	哈投股份	2,700	16,119.00	0.10
161	601279	英利汽车	4,000	15,960.00	0.10
162	300236	上海新阳	400	15,520.00	0.10
163	000685	中山公用	1,700	14,926.00	0.09
164	300655	晶瑞电材	1,400	14,014.00	0.09
165	600502	安徽建工	2,700	12,690.00	0.08
166	002726	龙大美食	2,100	12,222.00	0.08
167	600729	重庆百货	400	11,932.00	0.07
168	600064	南京高科	1,300	10,023.00	0.06
169	600301	华锡有色	500	9,985.00	0.06
170	301029	怡合达	400	9,144.00	0.06
171	688389	普门科技	700	9,044.00	0.06
172	600776	东方通信	800	8,912.00	0.06
173	601801	皖新传媒	1,200	8,196.00	0.05
174	603323	苏农银行	1,290	7,236.90	0.05
175	688232	新点软件	200	6,008.00	0.04
176	600266	城建发展	1,200	5,448.00	0.03
177	600635	大众公用	1,000	3,900.00	0.02
178	002145	中核钛白	800	3,320.00	0.02
179	300327	中颖电子	100	2,422.00	0.02
180	002895	川恒股份	100	2,256.00	0.01
181	600771	广誉远	100	2,016.00	0.01
182	300459	汤姆猫	100	560.00	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	688027	国盾量子	700	192,507.00	1.20
2	002446	盛路通信	25,200	185,976.00	1.16
3	000543	皖能电力	21,200	148,400.00	0.93
4	300737	科顺股份	30,400	146,528.00	0.91
5	600363	联创光电	1,900	110,827.00	0.69
6	000415	渤海租赁	33,000	109,890.00	0.69
7	688318	财富趋势	940	108,024.80	0.67
8	002837	英维克	3,560	105,767.60	0.66
9	300679	电连技术	2,200	99,836.00	0.62
10	688676	金盘科技	2,700	90,315.00	0.56
11	002851	麦格米特	1,700	85,238.00	0.53
12	688608	恒玄科技	200	69,596.00	0.43

13	605589	圣泉集团	1,725	47,868.75	0.30
14	688235	百济神州-U	200	46,728.00	0.29
15	300857	协创数据	520	44,751.20	0.28
16	301216	万凯新材	3,500	43,645.00	0.27
17	001696	宗申动力	1,700	38,165.00	0.24
18	688388	嘉元科技	1,800	36,144.00	0.23
19	688261	东微半导	652	26,895.00	0.17
20	603989	艾华集团	1,300	20,020.00	0.12
21	003040	楚天龙	800	19,400.00	0.12
22	688298	东方生物	700	19,145.00	0.12
23	002585	双星新材	3,400	18,564.00	0.12
24	300627	华测导航	520	18,200.00	0.11
25	300757	罗博特科	100	14,997.00	0.09
26	300346	南大光电	460	14,554.40	0.09
27	603801	志邦家居	700	6,783.00	0.04

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	300762	上海瀚讯	578,133.00	3.20
2	002456	欧菲光	560,201.00	3.10
3	300315	掌趣科技	533,028.00	2.95
4	300346	南大光电	514,870.20	2.85
5	300627	华测导航	480,578.00	2.66
6	300079	数码视讯	458,682.00	2.54
7	002174	游族网络	439,703.00	2.44
8	300593	新雷能	437,176.00	2.42
9	300185	通裕重工	434,716.00	2.41
10	002506	协鑫集成	434,668.00	2.41
11	300083	创世纪	434,276.00	2.41
12	002020	京新药业	432,231.00	2.39
13	002544	普天科技	423,185.00	2.34
14	300181	佐力药业	417,632.00	2.31
15	000528	柳工	407,057.00	2.25
16	300438	鹏辉能源	403,008.00	2.23
17	300598	诚迈科技	397,157.00	2.20
18	002516	旷达科技	392,987.00	2.18
19	002428	云南锗业	391,456.00	2.17
20	300134	大富科技	387,880.00	2.15
21	002396	星网锐捷	385,953.00	2.14
22	002091	江苏国泰	383,412.00	2.12
23	300319	麦捷科技	381,692.00	2.11

24	002446	盛路通信	373,820.00	2.07
25	000048	京基智农	371,009.00	2.05
26	002498	汉缆股份	362,427.00	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。

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	300083	创世纪	566,251.00	3.14
2	002544	普天科技	554,898.00	3.07
3	002249	大洋电机	554,769.74	3.07
4	002498	汉缆股份	538,682.00	2.98
5	300598	诚迈科技	510,557.00	2.83
6	300346	南大光电	501,468.00	2.78
7	300457	赢合科技	499,311.00	2.77
8	000030	富奥股份	499,106.00	2.76
9	002020	京新药业	487,989.00	2.70
10	300315	掌趣科技	480,554.00	2.66
11	000528	柳工	478,394.00	2.65
12	300593	新雷能	475,761.80	2.64
13	002456	欧菲光	470,568.00	2.61
14	300627	华测导航	451,093.00	2.50
15	002378	章源钨业	450,549.00	2.50
16	002174	游族网络	439,940.00	2.44
17	300079	数码视讯	422,769.00	2.34
18	300185	通裕重工	420,543.00	2.33
19	300438	鹏辉能源	408,739.00	2.26
20	000503	国新健康	402,885.00	2.23
21	300181	佐力药业	398,354.00	2.21
22	002428	云南锗业	397,972.00	2.20
23	300762	上海瀚讯	397,688.00	2.20
24	002705	新宝股份	389,164.00	2.16
25	002139	拓邦股份	385,576.00	2.14
26	002091	江苏国泰	385,501.00	2.14
27	300134	大富科技	379,220.00	2.10
28	002506	协鑫集成	375,520.00	2.08
29	002516	旷达科技	374,681.00	2.08
30	002396	星网锐捷	371,183.00	2.06
31	002745	木林森	364,883.00	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。

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	48,984,357.68
卖出股票收入（成交）总额	50,429,380.86

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

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

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	22,512.19
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,512.19

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

注：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

注：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

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 (%)
331	41,419.94	10,392,200.00	75.80	3,317,800.00	24.20

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	华泰证券股份有限公司	5,063,900.00	36.94

2	鹏华基金—上海证券正和 2 号 FOF 单一资产管理计划—鹏华基金安益 1 号单一资产管理	1,846,700.00	13.47
3	简街香港有限公司—JSQB 有限公司 (R)	1,833,890.00	13.38
4	招商证券股份有限公司	849,410.00	6.20
5	上海柏泰华盈私募基金管理有限公司—柏泰华盈常青藤套利 2 号私募证券投资基金	521,500.00	3.80
6	BARCLAYS BANK PLC	240,100.00	1.75
7	陈栋	200,000.00	1.46
8	陆东霞	133,000.00	0.97
9	张智勇	111,500.00	0.81
10	汪皓璐	100,000.00	0.73
10	鲜漪	100,000.00	0.73

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 9 月 1 日） 基金份额总额	205,710,000.00
本报告期期初基金份额总额	16,710,000.00
本报告期基金总申购份额	36,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	39,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	13,710,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金基金份额持有人大会已通过通讯方式召开,大会投票表决时间自 2025 年 1 月 16 日起至 2025 年 3 月 3 日 17:00 止。本基金基金份额持有人大会于 2025 年 3 月 5 日进行了计票表决,根据计票结果,本人直接出具有效表决意见或授权他人代表出具有效表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额少于权益登记日(2025 年 1 月 15 日)基金份额总数的二分之一,因此未达到法律法规规定和《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合同》约定的关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的有效条件。详情请见本基金管理人于 2025 年 3 月 6 日在中国证监会规定媒介发布的《鹏华基金管理有限公司关于鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

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:

无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

本报告期内,基金托管人无重大人事变动。

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注:无。

10.6.2 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,基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券	2	71,186,144.78	71.61	13,229.46	71.60	-
国投证券	2	28,227,593.76	28.39	5,247.04	28.40	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
山西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

2. 选择程序如下：

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

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

4. 国泰海通会商并获得上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统、中国结算、各签约存管银行及基金管理公司等相关单位的协同支持，拟定于 2025 年 9 月 12 日的日终清算后，于上述单位实施法人切换、客户及业务迁移合并，将原海通证券的客户及业务迁移合并入国泰海通。截止本报告期末，原租用海通证券、国泰君安的交易单元未完成迁移合并，故本表列示的海通证券、国泰君安数据包含本基金在本报告期内通过原交易单元交易的情况。

10.7.2 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 (%)
国信证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
高盛中 国	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华源证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-

信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 15 日
2	鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 16 日
3	鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 17 日
4	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 21 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加财通证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 22 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加开源证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 28 日
7	鹏华基金管理有限公司关于鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 06 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 21 日

9	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 28 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 31 日
11	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 07 日
12	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 14 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国联民生证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 06 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 26 日

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20250113~20250115, 20250124~20250204, 20250207~20250209, 20250211~20250212, 20250214~20250216, 20250218~20250219, 20250221~20250223, 20250324~20250324, 20250327~20250406, 20250410~20250	2,770,910.00	48,292,800.00	50,214,300.00	849,410.00	6.20

		413, 20250415~20250422, 20250429~20250429, 20250514~20250519, 20250521~20250615, 20250618~20250618, 20250620~20250629					
	2	20250617~20250617	1, 846, 700.00	0.00	0.00	1, 846, 700.00	13.47
	3	20250630~20250630	1, 272, 100.00	19, 605, 400.00	15, 813, 600.00	5, 063, 900.00	36.94
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金在迷你期间如涉及信息披露费、审计费等固定费用的，上述费用由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）《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合同》；
- （二）《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 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：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日