鹏华品质精选混合型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 7
2.4 信息披露方式 8
2.5 其他相关资料 8
§3 主要财务指标和基金净值表现 8
3.1 主要会计数据和财务指标 8
3.2 基金净值表现 9
3.3 其他指标 10
§4 管理人报告 11
4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
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 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
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 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 47
7.1 期末基金资产组合情况 47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 47
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 48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 53
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 53
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 53

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 53
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 53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 53
7.12 投资组合报告附注 53

§8 基金份额持有人信息 54

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 54
8.2 盈利投资者数量占比 54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 54
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 55

§9 开放式基金份额变动 55

§10 重大事件揭示 56

10.1 基金份额持有人大会决议 56
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 56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 56
10.4 基金投资策略的改变 56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 56
10.8 其他重大事件 59

§11 影响投资者决策的其他重要信息 61

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 61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 61

§12 备查文件目录 61

12.1 备查文件目录 61
12.2 存放地点 61
12.3 查阅方式 61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华品质精选混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华品质精选混合	
基金主代码	012785	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 28 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	732,182,174.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华品质精选混合 A	鹏华品质精选混合 C
下属分级基金的交易代码	012785	012786
报告期末下属分级基金的份额总额	672,063,362.43 份	60,118,811.68 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过对不同资产类别的动态配置和个股精选，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。 2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1）自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等，分析把握其投资机会；2）自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业成长性和基本面进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。 （1）自上而下的行业遴选 本基金将在考虑当前经济形势和资本市场特征的基础上，结合行业生命周期、宏观经济周期不同阶段的行业景气程度以及股票市场行业轮动规律的基础上，自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波

	动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。同时，本基金将根据宏观经济及证券市场环境的变化，及时对行业配置进行动态调整。 （2）自下而上的个股选择 本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业成长性及基本面进行综合的研判，精选优质个股。 1）定性分析 本基金通过以下两方面标准对股票的成长性及基本面进行研究分析并筛选出优质的公司： 一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。 另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。 2）定量方面 成长性评估。本基金采用年复合营业收入增长率、盈利增长率、息税前利润增长率、净资产收益率以及现金流量增长率等指标综合考察上市公司的成长性。 估值水平评估。本基金考察企业贴现现金流以及内在价值贴现，结合市盈率（市值/净利润）、市净率（市值/净资产）、市销率（市值/营业收入）等指标衡量股票的价值是否被低估，并且基于公司所属的不同行业，采取不同的估值方法，以此寻找不同行业股票的合理价格区间，并进行动态调整。 盈利水平评估。本基金重点考察主营业务收入、ROE、经营现金流、盈利波动程度四大关键指标，以衡量具有高质量持续增长的公司。 （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。 （4）存托凭证的投资策略 对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。 3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下

	地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。 4、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。 5、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 6、参与融资业务策略 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，如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可在履行适当程序后相应调整。 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 800 指数收益率×70%+恒生指数收益率（经汇率调整）×10%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高永杰	许俊
	联系电话	0755-81395402	010-66596688
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4006788533	95566
传真		0755-82021126	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		张纳沙	葛海蛟

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	鹏华品质精选混合 A	鹏华品质精选混合 C
本期已实现收益	165,431,708.96	10,065,228.74
本期利润	342,454,403.42	21,476,610.82
加权平均基金份额本期利润	0.3651	0.4345
本期加权平均净值利润率	44.12%	53.49%
本期基金份额净值增长率	52.16%	51.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-129,357,250.52	-13,406,301.67
期末可供分配基金份额利润	-0.1925	-0.2230
期末基金资产净值	778,742,620.62	67,059,426.47
期末基金份额净值	1.1587	1.1154
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	15.87%	11.54%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华品质精选混合 A

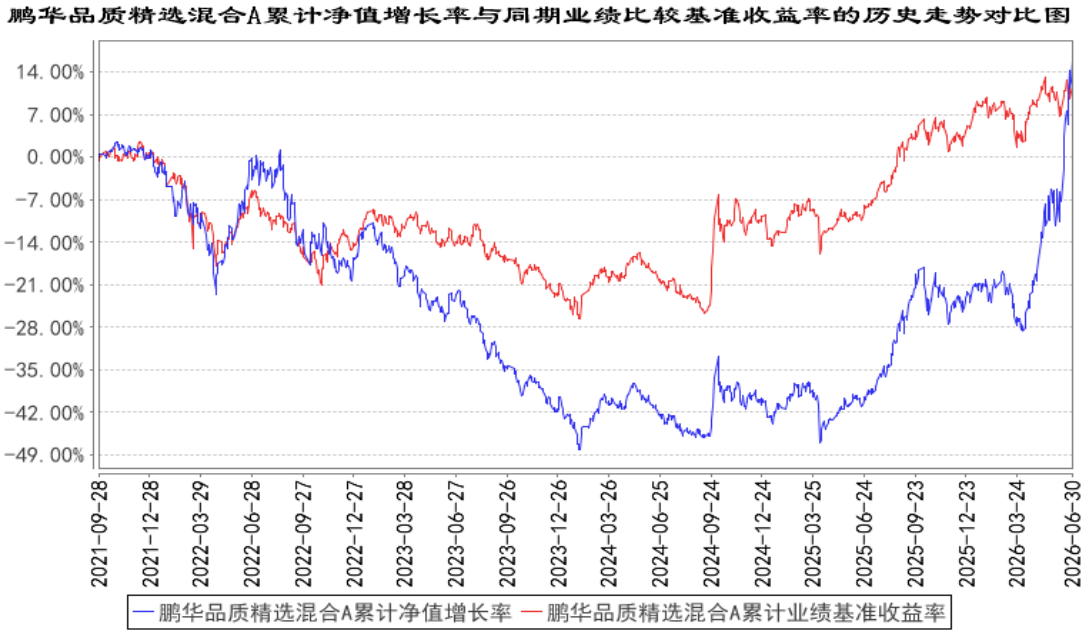
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	61.72%	2.25%	8.74%	1.01%	52.98%	1.24%
过去六个月	52.16%	1.96%	6.65%	0.95%	45.51%	1.01%
过去一年	90.04%	1.68%	21.78%	0.84%	68.26%	0.84%
过去三年	48.89%	1.44%	29.74%	0.92%	19.15%	0.52%
自基金合同生效起至今	15.87%	1.36%	11.74%	0.90%	4.13%	0.46%

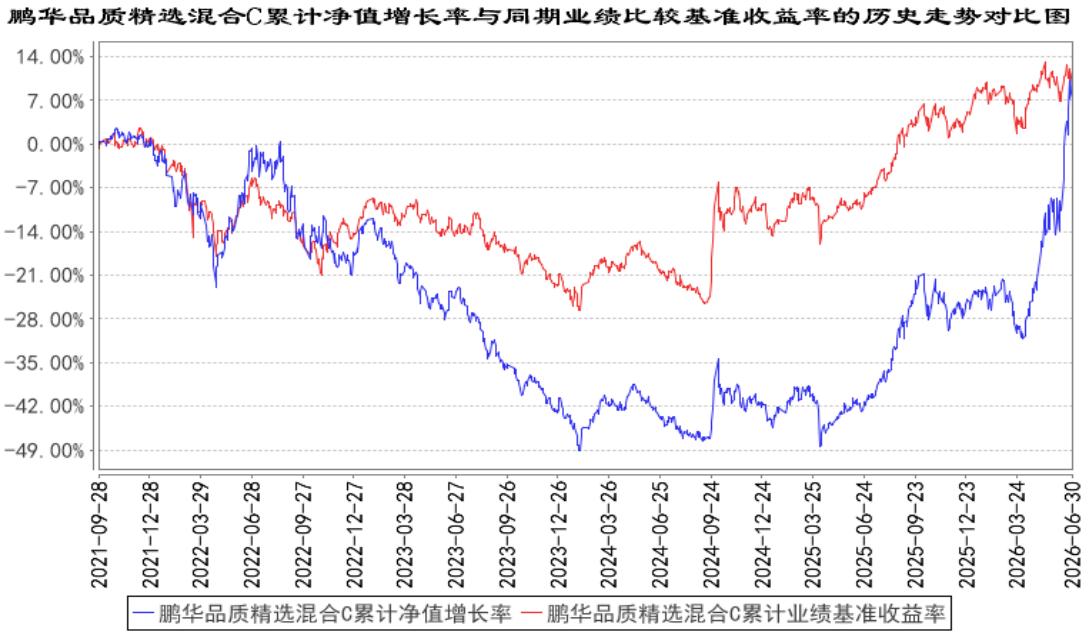
鹏华品质精选混合 C

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	61.39%	2.25%	8.74%	1.01%	52.65%	1.24%
过去六个月	51.55%	1.96%	6.65%	0.95%	44.90%	1.01%
过去一年	88.54%	1.68%	21.78%	0.84%	66.76%	0.84%
过去三年	45.35%	1.44%	29.74%	0.92%	15.61%	0.52%
自基金合同生效起至今	11.54%	1.36%	11.74%	0.90%	-0.20%	0.46%

注：业绩比较基准=中证 800 指数收益率×70%+恒生指数收益率（经汇率调整）×10%+中证综合债指数收益率×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





注：1、本基金基金合同于 2021 年 09 月 28 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模为 15,047 亿元，公司管理着 410 只公募基金，23 只社保基金、养老基金及划转资本组合。历经二十余年基金投资管理实践，公司在基金投资运作、风险控制等方面积累了丰富经验。

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		
孟昊	本基金的基金经理	2021-09-28	2026-02-06	12 年	孟昊先生，国籍中国，理学硕士，12 年证券从业经验。2014 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任研究部高级研究员、权益投资二部基金经理，现担任研究部总经理/基金经理。2018 年 02 月至 2019 年 09 月担任鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 11 月至今担任鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 07 月至今担任鹏华环保产业股票型证券投资基金基金经理，2020 年 02 月至 2024 年 02 月担任鹏华优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 08 月至 2024 年 01 月担任鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 09 月至 2026 年 02 月担任鹏华品质精选混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月至今担任鹏华沃鑫混合型证券投资基金基金经理，2022 年 01 月至今担任鹏华成长领航两年持有期混合型证券投资基金基金经理，孟昊先生具备基金从业资格。
李琢	本基金的基金经理	2026-02-06	-	10 年	李琢先生，国籍中国，经济学硕士，10 年证券从业经验。曾任华泰证券股份有限公司研究员，平安养老保险股份有限公司研

					究员，深圳市凯丰投资管理有限公司首席研究员。2020 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任研究部高级研究员、资深研究员，现担任研究部基金经理。2024 年 01 月至今担任鹏华股息精选混合型证券投资基金基金经理，2026 年 02 月至今担任鹏华品质精选混合型证券投资基金基金经理，李琢先生具备基金从业资格。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年 A 股市场总体延续较好表现，然而结构演绎的极致化也创了历史记录，除 AI 硬件外的行业几乎没有持续的板块性行情，只有锂电、化工、煤炭、创新药以及航天军工等极少数板块有阶段性表现，极致分化的行情也增加了市场的波动性。2 月初组合完成基金经理变更后，我们很快完成了对持仓的调整，加仓了商业航天与石油化工板块，但随着情绪快速退潮，相关商业

航天主题标的出现了较大回撤，同时市场也认识到需求的价格弹性与库存韧性较高，美伊冲突开始后不久化工与煤炭等板块就见到阶段性顶部。二季度，随着市场认识到 coding 渗透率加速提升并上修 AI 资本开支强度预期，AI 硬件板块迎来新一波行情，组合调整较快并聚焦半导体设备板块配置，整体净值表现较好，同时组合也阶段性参与了锂电中上游板块的行情。

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52.16%，同期业绩比较基准增长率为6.65%；C 类份额净值增长率为 51.55%，同期业绩比较基准增长率为 6.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

相对年初的判断，我们认为宏观环境发生了两大变化，其一是全球央行宽松周期基本已经结束，甚至不少央行已经开启加息，意味着除资产比价效应带来的流动性腾挪之外，股票市场的增量流动性已经开始放缓；其二是广义工业周期相对较弱，AI 与非 AI 行业回报率差距持续拉大。这两个变化一方面对应着金融资源对整体经济的拉动作用不足，另一方面也意味着行业间对有限资源的争夺日趋激烈，能够提供增量股东回报的线索比较少。对于市场来说，结构性的特征预计仍然十分明显，但同时波动也在持续放大，投资难度在提升。当前上行能见度比较高的机会仍然集中于 AI 链条，但市场对 ROI 等盈利质量的关注度也在持续提升，我们也将持续在该领域投入精力，沿着产业趋势寻找处于创新技术路径关键节点或具备工艺壁垒能够持续拓展份额的公司，也同时看好国产替代的相关机会。此外，CXO 和非银等持续兑现业绩但持仓拥挤度较低的板块也将成为平衡组合风险收益特征的重要选择方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，鹏华品质精选混合 A 期末可供分配利润为-129,357,250.52 元，期末基金份额净值 1.1587 元，不符合利润分配条件；鹏华品质精选混合 C 期末可供分配利润为-13,406,301.67 元，期末基金份额净值 1.1154 元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在鹏华品质精选混合型证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的"金融工具风险及管理"、" 关联方承销证券"、"关联方证券出借"部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华品质精选混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	61,736,888.33	50,998,712.44
结算备付金		7,418,078.85	3,056,194.01
存出保证金		463,897.52	131,024.98
交易性金融资产	6.4.7.2	793,515,178.86	759,286,175.16
其中：股票投资		793,515,178.86	759,286,175.16
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	-	33,642,550.59
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		14,265,209.96	6,912,207.12
应收股利		-	-
应收申购款		539,957.19	18,723.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		877,939,210.71	854,045,587.51
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		458,815.24	8,075,249.84
应付赎回款		29,566,375.08	3,285,151.61
应付管理人报酬		881,303.07	862,516.37
应付托管费		146,883.81	143,752.74
应付销售服务费		39,509.70	28,348.92
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	1,044,276.72	552,722.23
负债合计		32,137,163.62	12,947,741.71
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	732,182,174.11	1,106,426,089.04
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	113,619,872.98	-265,328,243.24
净资产合计		845,802,047.09	841,097,845.80
负债和净资产总计		877,939,210.71	854,045,587.51

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额为 732,182,174.11 份，其中鹏华品质精选混合 A 基金份额总额为 672,063,362.43 份，基金份额净值 1.1587 元；鹏华品质精选混合 C 基金份额总额为 60,118,811.68 份，基金份额净值 1.1154 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华品质精选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		369,855,178.77	27,526,207.93
1.利息收入		147,022.75	276,726.63
其中：存款利息收入	6.4.7.13	128,156.72	98,077.29
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		18,866.03	178,649.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		181,231,442.14	-31,478,142.62
其中：股票投资收益	6.4.7.14	179,949,507.93	-38,868,471.81
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	1,281,934.21	7,390,329.19

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	188,434,076.54	58,726,881.08
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	42,637.34	742.84
减：二、营业总支出		5,924,164.53	5,484,645.92
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	4,853,056.45	4,491,557.76
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	808,842.75	748,592.93
3．销售服务费	6.4.10.2.3	158,700.20	140,371.61
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	103,565.13	104,123.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		363,931,014.24	22,041,562.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		363,931,014.24	22,041,562.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		363,931,014.24	22,041,562.01

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华品质精选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,106,426,089.04	-	- 265,328,243.24	841,097,845.80

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,106,426,089.04	-	-265,328,243.24	841,097,845.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-374,243,914.93	-	378,948,116.22	4,704,201.29
（一）、综合收益总额	-	-	363,931,014.24	363,931,014.24
（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）	-374,243,914.93	-	15,017,101.98	-359,226,812.95
其中：1.基金申购款	52,479,217.18	-	-4,210,558.37	48,268,658.81
2.基金赎回款	-426,723,132.11	-	19,227,660.35	-407,495,471.76
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	732,182,174.11	-	113,619,872.98	845,802,047.09

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,332,826,533.54	-	-544,697,061.35	788,129,472.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,332,826,533.54	-	-544,697,061.35	788,129,472.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-110,160,754.85	-	66,392,080.96	-43,768,673.89
(一)、综合收益总额	-	-	22,041,562.01	22,041,562.01
(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)	-110,160,754.85	-	44,350,518.95	-65,810,235.90
其中：1.基金申购款	2,569,743.42	-	-1,076,054.39	1,493,689.03
2.基金赎回款	-112,730,498.27	-	45,426,573.34	-67,303,924.93
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,222,665,778.69	-	-478,304,980.39	744,360,798.30

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

鹏华品质精选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”)《关于准予鹏华品质精选混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2021]1833号)批准，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》及其配套规则和《鹏华品质精选混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2021 年 9 月 28 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 2,221,145,463.73 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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

本基金于 2021 年 9 月 8 日至 2021 年 9 月 24 日募集，并于 2021 年 9 月 24 日募集完毕。募集期间净认购资金人民币 2,220,409,111.13 元。认购资金在募集期间产生的利息人民币 736,352.60 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 2,221,145,463.73 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了毕马威华振验字第 2100311 号验资报告。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》和《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华品质精选混合型证券投资基金基金合同》以及在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》和财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，截至 2027 年 12 月 31 日适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；对金融同业往来利息收入，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其

股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	61,736,888.33
等于：本金	61,729,390.83
加：应计利息	7,497.50
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	61,736,888.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		453,593,855.40	-	793,515,178.86	339,921,323.46
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		453,593,855.40	-	793,515,178.86	339,921,323.46

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6.50
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	964,927.06
其中：交易所市场	964,927.06
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
合计	1,044,276.72

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华品质精选混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,050,622,055.97	1,050,622,055.97
本期申购	19,230,994.45	19,230,994.45
本期赎回（以“-”号填列）	-397,789,687.99	-397,789,687.99
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	672,063,362.43	672,063,362.43

鹏华品质精选混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,804,033.07	55,804,033.07
本期申购	33,248,222.73	33,248,222.73
本期赎回（以“-”号填列）	-28,933,444.12	-28,933,444.12
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	60,118,811.68	60,118,811.68

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

鹏华品质精选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-402,247,535.95	151,654,023.60	-250,593,512.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-402,247,535.95	151,654,023.60	-250,593,512.35
本期利润	165,431,708.96	177,022,694.46	342,454,403.42
本期基金份额交易产生的变动数	107,458,576.47	-92,640,209.35	14,818,367.12
其中：基金申购款	-5,444,983.99	4,117,398.56	-1,327,585.43
基金赎回款	112,903,560.46	-96,757,607.91	16,145,952.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-129,357,250.52	236,036,508.71	106,679,258.19

鹏华品质精选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-22,512,585.73	7,777,854.84	-14,734,730.89
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-22,512,585.73	7,777,854.84	-14,734,730.89
本期利润	10,065,228.74	11,411,382.08	21,476,610.82
本期基金份额交易产生的变动数	-958,944.68	1,157,679.54	198,734.86
其中：基金申购款	-10,432,861.27	7,549,888.33	-2,882,972.94
基金赎回款	9,473,916.59	-6,392,208.79	3,081,707.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,406,301.67	20,346,916.46	6,940,614.79

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	116,989.21
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	10,008.95
其他	1,158.56
合计	128,156.72

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	179,949,507.93
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	179,949,507.93

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,544,725,081.49
减：卖出股票成本总额	2,360,826,464.94
减：交易费用	3,949,108.62
买卖股票差价收入	179,949,507.93

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,281,934.21
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	1,281,934.21

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	188,434,076.54
股票投资	188,434,076.54
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	188,434,076.54

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	41,485.33
基金转换费收入	1,152.01
合计	42,637.34

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	13,272.49
账户维护费	9,000.00
证券组合费	1,949.48
合计	103,565.13

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国信证券	114,487,047.00	2.41	2,635,224.00	0.13

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
国信证券	-	-	29,982,000.00	1.28

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 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国信证券	51,622.32	2.39	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国信证券	1,188.30	0.13	-	-

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

2.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,853,056.45	4,491,557.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,937,842.51	1,797,526.34
应支付基金管理人的净管理费	2,915,213.94	2,694,031.42

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	808,842.75	748,592.93

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华品质精选混合 A	鹏华品质精选混合 C	合计
国信证券	-	774.14	774.14

鹏华基金公司	-	11,054.81	11,054.81
中国银行	-	24,553.60	24,553.60
合计	-	36,382.55	36,382.55

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华品质精选混合 A	鹏华品质精选混合 C	合计
国信证券	-	903.99	903.99
鹏华基金公司	-	631.74	631.74
中国银行	-	25,556.03	25,556.03
合计	-	27,091.76	27,091.76

注：鹏华品质精选混合 A 基金份额不支付销售服务费;支付基金销售机构的鹏华品质精选混合 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.8%，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×0.8%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国银行	61,736,888.33	116,989.21	41,982,287.56	86,571.90

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	25,669	259,513.59	259,513.59	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	11,000	111,210.00	111,210.00	-

001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	4,113	41,623.56	114,053.49	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇	2026 年 4	6 个月	新股	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-

	智能	月22日		流通受限						
301666	大普微-UW	2026年4月8日	6个月	新股流通受限	46.08	463.33	915	42,163.20	423,946.95	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股流通	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-

				受限						
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688795	摩尔线程-U	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	2,805	320,555.40	1,898,816.70	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-

688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	970	19,089.60	137,245.30	-

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

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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，包括国内依法发行或上市交易的股票（包含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“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。基金的投资组合比例为：股票资产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%）；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。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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中国银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2025 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公

司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	61,736,888.33	-	-	-	61,736,888.33
结算备付金	7,418,078.85	-	-	-	7,418,078.85
存出保证金	463,897.52	-	-	-	463,897.52
交易性金融资产	-	-	-	793,515,178.86	793,515,178.86
应收申购款	-	-	-	539,957.19	539,957.19
应收清算款	-	-	-	14,265,209.96	14,265,209.96
资产总计	69,618,864.70	-	-	808,320,346.01	877,939,210.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	29,566,375.08	29,566,375.08
应付管理人报酬	-	-	-	881,303.07	881,303.07
应付托管费	-	-	-	146,883.81	146,883.81
应付清算款	-	-	-	458,815.24	458,815.24
应付销售服务费	-	-	-	39,509.70	39,509.70
其他负债	-	-	-	1,044,276.72	1,044,276.72
负债总计	-	-	-	32,137,163.62	32,137,163.62
利率敏感度缺口	69,618,864.70	-	-	776,183,182.39	845,802,047.09
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	50,998,712.44	-	-	-	50,998,712.44
结算备付金	3,056,194.01	-	-	-	3,056,194.01
存出保证金	131,024.98	-	-	-	131,024.98
交易性金融资产	-	-	-	759,286,175.16	759,286,175.16
买入返售金融资产	33,642,550.59	-	-	-	33,642,550.59
应收申购款	-	-	-	18,723.21	18,723.21
应收清算款	-	-	-	6,912,207.12	6,912,207.12
资产总计	87,828,482.02	-	-	766,217,105.49	854,045,587.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,285,151.61	3,285,151.61
应付管理人报酬	-	-	-	862,516.37	862,516.37
应付托管费	-	-	-	143,752.74	143,752.74
应付清算款	-	-	-	8,075,249.84	8,075,249.84
应付销售服务费	-	-	-	28,348.92	28,348.92
其他负债	-	-	-	552,722.23	552,722.23
负债总计	-	-	-	12,947,741.71	12,947,741.71
利率敏感度缺口	87,828,482.02	-	-	753,269,363.78	841,097,845.80

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	15,245,393.29	-	15,245,393.29
资产合计	-	15,245,393.29	-	15,245,393.29
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	15,245,393.29	-	15,245,393.29
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	122,275,524.41	-	122,275,524.41
资产合计	-	122,275,524.41	-	122,275,524.41
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外	-	122,275,524.41	-	122,275,524.41

汇风险敞口净额				

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	所有外币相对人民币升值 5%	762,269.66	6,113,776.22
	所有外币相对人民币贬值 5%	-762,269.66	-6,113,776.22

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票资产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%）；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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	793,515,178.86	93.82	759,286,175.16	90.27
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	793,515,178.86	93.82	759,286,175.16	90.27

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	比较基准上涨 5%资产净值变动	55,755,270.94	54,822,757.59
	比较基准下降 5%资产净值变动	-55,755,270.94	-54,822,757.59

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	789,791,657.77
第二层次	370,723.59
第三层次	3,352,797.50
合计	793,515,178.86

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	793,515,178.86	90.38
	其中：股票	793,515,178.86	90.38
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	69,154,967.18	7.88
8	其他各项资产	15,269,064.67	1.74
9	合计	877,939,210.71	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 15,245,393.29 元，占净值比 1.80%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.00
C	制造业	735,084,633.20	86.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	370,723.59	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,776,695.50	5.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	778,269,785.57	92.02

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	25,373.12	0.00
金融	15,651.27	0.00
信息技术	15,193,916.42	1.80
通信服务	10,452.48	0.00
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	15,245,393.29	1.80

注：以上分类采用国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688347	华虹宏力	148,339	49,886,405.70	5.90
2	688256	寒武纪	26,810	42,776,695.50	5.06
3	688200	华峰测控	76,840	40,348,684.00	4.77
4	300308	中际旭创	29,600	37,592,000.00	4.44
5	688409	富创精密	113,315	34,702,718.75	4.10
6	603061	金海通	68,730	34,517,580.60	4.08
7	688041	海光信息	91,669	33,945,030.70	4.01
8	600183	生益科技	193,400	33,535,560.00	3.96
9	688082	盛美上海	76,287	32,955,984.00	3.90
10	600105	永鼎股份	474,400	32,012,512.00	3.78
11	600487	亨通光电	283,100	30,954,154.00	3.66
12	002428	云南锗业	245,300	29,480,154.00	3.49
13	002384	东山精密	110,800	29,068,380.00	3.44
14	601869	长飞光纤	49,000	26,749,100.00	3.16
15	688008	澜起科技	79,161	24,531,993.90	2.90

16	688627	精智达	32,811	23,459,865.00	2.77
17	000811	冰轮环境	347,300	19,525,206.00	2.31
18	688498	源杰科技	10,098	19,044,828.00	2.25
19	301511	德福科技	127,700	18,369,645.00	2.17
20	002938	鹏鼎控股	169,700	17,882,986.00	2.11
21	688809	强一股份	28,109	17,511,907.00	2.07
22	002008	大族激光	114,600	17,202,606.00	2.03
23	002080	中材科技	189,700	17,073,000.00	2.02
24	688025	杰普特	34,545	16,236,150.00	1.92
25	300408	三环集团	95,420	15,925,598.00	1.88
26	00992	联想集团	759,923	15,193,916.42	1.80
27	688981	中芯国际	89,132	14,155,944.24	1.67
28	688652	京仪装备	63,970	12,804,874.90	1.51
29	300776	帝尔激光	54,490	11,713,170.40	1.38
30	688037	芯源微	23,236	10,201,765.80	1.21
31	300604	长川科技	24,900	8,501,358.00	1.01
32	688143	长盈通	46,265	8,137,088.20	0.96
33	301217	铜冠铜箔	48,600	8,022,402.00	0.95
34	688361	中科飞测	10,304	4,430,720.00	0.52
35	688795	摩尔线程-U	2,805	1,898,816.70	0.22
36	688635	长进光子	1,271	558,941.82	0.07
37	301666	大普微-UW	915	423,946.95	0.05
38	001248	华润新能源	36,669	370,723.59	0.04
39	603459	红板科技	3,300	361,089.30	0.04
40	001399	惠科股份	10,282	349,585.91	0.04
41	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.03
42	301669	高特电子	5,455	217,413.57	0.03
43	688820	盛合晶微	970	137,245.30	0.02
44	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
45	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
46	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
47	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
48	01801	信达生物	367	25,373.12	0.00
49	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
50	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
51	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
52	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
53	00966	中国太平	1,000	15,651.27	0.00
54	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
55	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
56	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
57	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
58	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00

59	00700	腾讯控股	28	10,452.48	0.00
60	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
61	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
62	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
63	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
64	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
65	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
66	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
67	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002865	钧达股份	45,557,022.00	5.42
2	002756	永兴材料	40,680,689.38	4.84
3	688809	强一股份	32,445,075.33	3.86
4	600498	烽火通信	31,829,750.00	3.78
5	601615	明阳智能	31,341,911.32	3.73
6	601601	中国太保	31,093,845.00	3.70
7	688041	海光信息	30,825,006.56	3.66
8	002080	中材科技	30,460,823.00	3.62
9	688270	ST 臻镭	27,428,898.30	3.26
10	001203	大中矿业	27,405,664.19	3.26
11	00992	联想集团	27,093,834.04	3.22
12	688347	华虹宏力	26,627,760.08	3.17
13	601318	中国平安	24,877,583.00	2.96
14	688008	澜起科技	24,861,956.38	2.96
15	000688	国城矿业	24,561,677.00	2.92
16	600487	亨通光电	24,495,607.00	2.91
17	688167	炬光科技	24,358,515.61	2.90
18	300432	富临精工	24,149,159.40	2.87
19	301045	天禄科技	23,704,782.00	2.82
20	603067	振华股份	23,405,725.00	2.78
21	600183	生益科技	23,346,556.00	2.78
22	601100	恒立液压	23,185,247.00	2.76
23	688256	寒武纪	23,126,904.26	2.75
24	002428	云南锗业	23,068,234.00	2.74
25	300776	帝尔激光	22,846,341.52	2.72
26	688390	固德威	21,959,386.56	2.61
27	301358	湖南裕能	21,766,458.00	2.59
28	601869	长飞光纤	21,588,042.00	2.57
29	688387	信科移动-U	20,648,991.97	2.46
30	002384	东山精密	20,641,163.35	2.45

31	688361	中科飞测	20,249,429.14	2.41
32	605196	华通线缆	20,125,165.00	2.39
33	688981	中芯国际	19,683,762.42	2.34
34	688082	盛美上海	19,643,103.95	2.34
35	600105	永鼎股份	19,596,384.00	2.33
36	600391	航发科技	19,538,889.04	2.32
37	601872	招商轮船	19,429,196.00	2.31
38	688652	京仪装备	19,265,288.09	2.29
39	688200	华峰测控	19,130,250.12	2.27
40	002709	天赐材料	18,951,762.00	2.25
41	002637	赞宇科技	18,930,624.00	2.25
42	600188	兖矿能源	18,840,393.40	2.24
43	300819	聚杰微纤	18,589,688.50	2.21
44	600875	东方电气	18,008,594.00	2.14
45	002475	立讯精密	17,641,472.40	2.10
46	00966	中国太平	17,542,954.00	2.09
47	688375	国博电子	17,538,094.80	2.09
48	688025	杰普特	17,305,669.46	2.06
49	688409	富创精密	17,167,043.27	2.04

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	300750	宁德时代	83,757,556.49	9.96
2	00700	腾讯控股	72,313,558.58	8.60
3	600183	生益科技	60,255,716.44	7.16
4	002475	立讯精密	53,687,689.00	6.38
5	605117	德业股份	47,929,759.60	5.70
6	002294	信立泰	41,227,518.90	4.90
7	603876	鼎胜新材	40,285,291.90	4.79
8	002865	钧达股份	38,442,201.10	4.57
9	002756	永兴材料	35,940,210.03	4.27
10	600498	烽火通信	35,803,676.00	4.26
11	300308	中际旭创	35,613,614.00	4.23
12	688008	澜起科技	29,750,297.09	3.54
13	002345	潮宏基	29,134,232.00	3.46
14	688668	鼎通科技	28,001,555.91	3.33
15	002517	恺英网络	27,130,354.46	3.23
16	601601	中国太保	27,111,422.60	3.22
17	002938	鹏鼎控股	26,906,009.12	3.20
18	601231	环旭电子	26,393,756.70	3.14
19	01385	上海复旦	26,286,295.58	3.13
20	300438	鹏辉能源	25,906,602.60	3.08

21	301358	湖南裕能	24,953,258.00	2.97
22	688390	固德威	24,877,708.78	2.96
23	001203	大中矿业	24,341,508.00	2.89
24	300432	富临精工	24,002,958.92	2.85
25	002371	北方华创	23,409,845.95	2.78
26	02601	中国太保	23,175,373.63	2.76
27	301045	天禄科技	23,067,327.00	2.74
28	688167	炬光科技	23,012,261.18	2.74
29	688387	信科移动-U	21,804,781.94	2.59
30	601615	明阳智能	21,694,159.28	2.58
31	688270	ST 臻镭	21,660,376.83	2.58
32	002241	歌尔股份	21,611,823.35	2.57
33	001332	锡装股份	21,593,658.75	2.57
34	601318	中国平安	21,574,620.00	2.57
35	605196	华通线缆	21,235,180.00	2.52
36	603659	璞泰来	21,141,877.25	2.51
37	601872	招商轮船	20,920,916.89	2.49
38	603067	振华股份	20,897,285.38	2.48
39	300408	三环集团	20,774,349.00	2.47
40	000688	国城矿业	20,581,103.00	2.45
41	603507	振江股份	20,509,177.00	2.44
42	01347	华虹宏力	19,843,248.30	2.36
43	300274	阳光电源	19,345,185.00	2.30
44	300819	聚杰微纤	19,331,951.00	2.30
45	002709	天赐材料	19,138,571.00	2.28
46	601100	恒立液压	19,132,972.00	2.27
47	002648	卫星化学	18,247,636.81	2.17
48	688809	强一股份	18,033,284.92	2.14
49	00966	中国太平	17,818,513.12	2.12
50	002080	中材科技	17,553,311.00	2.09
51	688150	莱特光电	17,022,826.68	2.02
52	600188	兖矿能源	17,022,575.30	2.02
53	600875	东方电气	16,927,631.00	2.01
54	600176	中国巨石	16,877,794.82	2.01

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	2,206,621,392.10
卖出股票收入（成交）总额	2,544,725,081.49

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	463,897.52
2	应收清算款	14,265,209.96
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	539,957.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,269,064.67

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

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

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（%）
鹏华品质精选混合 A	7,016	95,790.10	12,370,446.06	1.84	659,692,916.37	98.16
鹏华品质精选混合 C	1,660	36,216.15	18,145,490.03	30.18	41,973,321.65	69.82
合计	8,676	84,391.68	30,515,936.09	4.17	701,666,238.02	95.83

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	99.58

注：无。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管	鹏华品质精选混合 A	716,379.42	0.1066

理人所有从业人员持有本基金	鹏华品质精选混合 C	5,589.11	0.0093
	合计	721,968.53	0.0986

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	鹏华品质精选混合 A	50~100
	鹏华品质精选混合 C	-
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏华品质精选混合 A	0~10
	鹏华品质精选混合 C	-
	合计	0~10

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华品质精选混合 A	鹏华品质精选混合 C
基金合同生效日（2021 年 9 月 28 日）基金份额总额	2,103,918,950.67	117,226,513.06
本报告期期初基金份额总额	1,050,622,055.97	55,804,033.07
本报告期基金总申购份额	19,230,994.45	33,248,222.73
减：本报告期基金总赎回份额	397,789,687.99	28,933,444.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	672,063,362.43	60,118,811.68

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

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

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
华创证券	1	1,357,561,621.79	28.59	612,122.47	28.34	-
东方证券	1	1,025,885,225.40	21.60	462,572.84	21.41	-
浙商证券	1	1,003,117,799.43	21.12	452,307.34	20.94	-
国联民生证券	1	641,920,228.56	13.52	296,182.29	13.71	-
长江证券	1	196,005,425.32	4.13	98,290.82	4.55	-
国信证券	2	114,487,047.00	2.41	51,622.32	2.39	-
招商证券	1	78,380,476.46	1.65	35,336.92	1.64	-
中信证券	1	73,706,243.00	1.55	33,234.43	1.54	-
华西证券	1	72,602,951.14	1.53	32,736.66	1.52	-
国泰海通证券	2	69,546,567.73	1.46	31,358.62	1.45	-
申万宏源证券	1	52,342,866.01	1.10	25,594.88	1.18	-
广发证券	3	31,946,651.34	0.67	14,404.72	0.67	-
天风证券	2	31,678,559.80	0.67	14,284.24	0.66	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

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

2.选择程序如下：

（1）基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；

（2）基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；

（3）基金管理人定期对证券公司进行评价，依据评价结果选择交易单元。

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
华创证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	220,246,000.00	100.00	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 17 日
2	鹏华品质精选混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 21 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 24 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 04 日
5	鹏华品质精选混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 06 日

6	鹏华品质精选混合型证券投资基金（A 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 11 日
7	鹏华品质精选混合型证券投资基金更新的招募说明书（2026 年第 1 号）	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 11 日
8	鹏华品质精选混合型证券投资基金（C 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 11 日
9	鹏华品质精选混合型证券投资基金 2025 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 30 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与海南有知有行基金销售有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 31 日
11	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 04 日
12	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 17 日
13	鹏华品质精选混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 21 日
14	鹏华基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 05 月 30 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 06 月 18 日
16	鹏华基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 06 月 24 日

注：无。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）《鹏华品质精选混合型证券投资基金基金合同》；

（二）《鹏华品质精选混合型证券投资基金托管协议》；

（三）《鹏华品质精选混合型证券投资基金 2026 年中期报告》（原文）。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日