

鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资
基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	53

8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	68
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	69
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	69
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12 投资组合报告附注	69
§ 9 基金份额持有人信息	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2 期末上市基金前十名持有人	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
9.4 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	71
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	71
§ 10 开放式基金份额变动	72
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	76
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 13 备查文件目录	77
13.1 备查文件目录	77
13.2 存放地点	77
13.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	鹏华中证 A500ETF
场内简称	A500(扩位简称:A500ETF 鹏华)
基金主代码	512020
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 21 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,772,012,667.00 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	2024 年 12 月 2 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。
投资策略	<p>本基金采取完全复制策略，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票投资组合进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p> <p>本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>(2) 股票投资组合的调整</p>

	<p>本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，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，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数同期增长率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。</p> <p>1) 定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。</p> <p>2) 不定期调整 根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整； 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数； 根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>2、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、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，力争增强本基金的收益。</p> <p>4、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，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。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。</p> <p>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</p>
--	--

	<p>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。</p> <p>6、融资及转融通投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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公告。</p>
业绩比较基准	中证 A500 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。同时本基金为交易型开放式指数基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	王小飞
	联系电话	0755-81395402	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788533	021-60637228
传真		0755-82021126	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		张纳沙	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

	殊普通合伙)	
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年 11 月 21 日（基金合同生效日）-2024 年 12 月 31 日
本期已实现收益	416,649,142.58	12,530,437.46
本期利润	741,359,178.53	-4,443,969.78
加权平均基金份额本期利润	0.2191	-0.0015
本期加权平均净值利润率	20.53%	-0.15%
本期基金份额净值增长率	24.58%	0.80%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末
期末可供分配利润	299,801,683.95	15,412,258.50
期末可供分配基金份额利润	0.1692	0.0041
期末基金资产净值	2,225,292,453.94	3,794,031,802.19
期末基金份额净值	1.2558	1.0080
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末
基金份额累计净值增长率	25.58%	0.80%

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

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

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

(4) 本基金合同于 2024 年 11 月 21 日生效，至 2024 年 12 月 31 日未满一年，故 2024 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

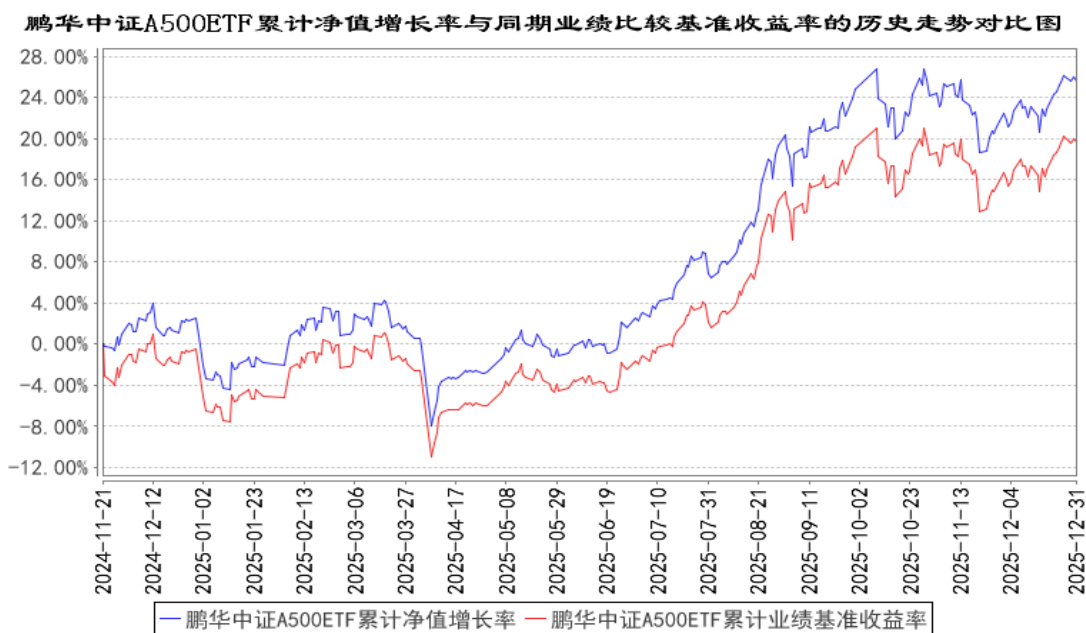
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.63%	1.03%	0.43%	1.05%	0.20%	-0.02%
过去六个月	22.70%	0.98%	21.86%	1.00%	0.84%	-0.02%
过去一年	24.58%	1.03%	22.43%	1.05%	2.15%	-0.02%
自基金合同生效起至今	25.58%	1.01%	19.66%	1.05%	5.92%	-0.04%

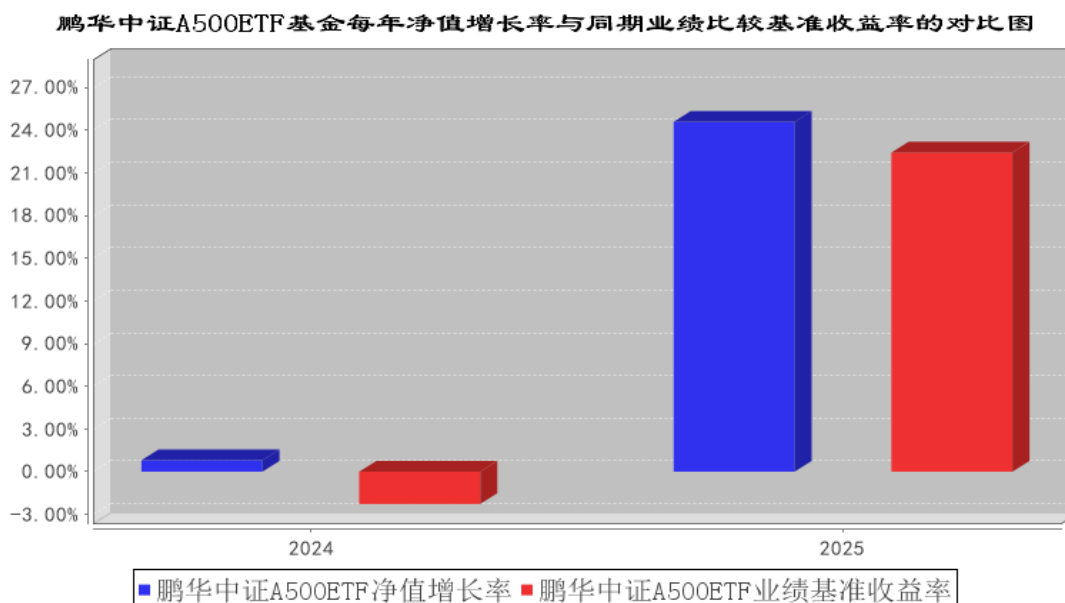
注：业绩比较基准=中证 A500 指数收益率。

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



注：1、本基金基金合同于 2024 年 11 月 21 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。

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



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于1998年12月22日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本15,000万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模为13,677亿元，公司管理着387只公募基金，20只社保基金、养老基金及划转资本组合。历经二十余年基金投资管理实践，公司在基金投资运作、风险控制等方面积累了丰富的经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
余展昌	本基金的基金经理	2024-11-21	-	8年	余展昌先生, 国籍中国, 金融硕士, 8 年证券从业经验。2017 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量化研究员、高级量化研究员, 2020 年 8 月至 2022 年 10 月担任量化及衍生品投资部投资经理, 现担任指数与量化投资部总经理助理/基金经理。2022 年 10 月至今担任鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 10 月至今担任鹏华中证 800 证券保险交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 10 月至今担任鹏华中证 800 证券保险指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 10 月至今担任鹏华中证全指证券公司指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 10 月至今担任鹏华中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 10 月至今担任鹏华中证银行指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2023 年 08 月至今担任鹏华创业板指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2023 年 08 月至今担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2024 年 04 月至今担任鹏华恒生中国央企交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金经理, 2024 年 11 月至今担任鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2024 年 12 月至今担任鹏华上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2024 年 12 月至 2025 年 01 月担任鹏华中证 A500 指数证券投资基金基金经理, 2025 年 01 月至今担任鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2025 年 01 月至 2025 年 03 月担任鹏华上证 180 指数发起式证券投资基金基金经理, 2025 年 01 月至今担任鹏华恒生港股通高股息率指数发起式证券投资基金基金经理, 2025 年 02 月至今担任鹏华上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2025 年 03 月至今担任鹏华恒生中国央企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 03 月至今担任鹏华上证 180 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 05 月至今担任鹏华上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 07 月至今担任鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 09 月至今担任鹏华标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理，余展昌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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理，不涉及基金经理薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原

则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。

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

在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、风控管理部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

作为宽基指数基金，本基金旨在为看好该宽基的投资者提供投资工具。本报告期内，本基金秉承指数基金的投资策略，力争跟踪指数的收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。跟踪误差的主要来源主要分为几个方面，包括成分股的调整、股票的分红、风险股票的处置、股票的打新等。为了进一步控制跟踪误差，鹏华基金建立了一套完备的 ETF 跟踪机制，事前对成分股的异动进行密切跟踪，及时调整，在交易环节采用算法交易等方式进一步减少交易冲击成本和摩擦，在仓位控制上，基金经理在紧密跟踪指数的基础上，也会针对客户申赎的情况做优化调整。

指数表现方面，中证 A500 指数在 2025 年的指数表现较优，主要源于 2025 年权益市场表现较好，在增量资金入市、中美贸易博弈取得进展、经济稳中有进的背景下，指数也实现稳步向上。A500 指数相对沪深 300 指数表现更优，主要源于其科技占比更高，而 2025 年三季度科技行情引领市场，走出来一轮估值修复的大行情，也使得 A500 指数表现优异。

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 24.58%，同期业绩比较基准增长率为 22.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济情况看，目前 1 月的 PMI 数据仍在荣枯线以下，虽有季节性因素，但也表明经济仍然存在内需疲软的问题。年初出台的结构性政策对实体经济的提振效应需要时间，预计 2 月份受到春节假期影响，制造业 PMI 可能继续在收缩区间以下。后续中国经济的走势将主要取决于出口增速、房地产市场走势以及稳增长政策的落地节奏与力度。

从证券市场角度看，2026 年元旦后，市场风险偏好明显有所提升，增量资金入市，热点频出，科技和周期是两大主线，受到了资金的青睐，市场的成交量也稳步上升。但同时，我们也看到监管层面出台了一系列举措降低市场交易拥挤带来的风险。周期板块在高位也对宏观变量更敏感，包括地缘政治格局变化、美联储的降息预期等等，市场不确定性有所提高。而一季度后会进入密集的年报和季报披露期，因为，宽基层面还是以稳为主，行业层面则围绕基本面情况对估值进行消

化。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

1、继续完善内部控制体系

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

2、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

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

3、开展以风险为导向的内部稽核

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 299,801,683.95 元，期末基金份额净值 1.2558 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(26)第 P02486 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表,包括 2024 年 12 月 31 日及 2025 年 12 月 31 日的资产负债表,2024 年 11 月 21 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间及 2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日及 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 11 月 21 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则,我们独立于鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估鹏华</p>

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	73,925,957.77	134,028,903.89
结算备付金		120,680.05	119,464.36
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,166,519,108.63	3,668,983,564.99
其中：股票投资		2,166,519,108.63	3,668,983,564.99
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		4,947,045.85	3,416,391.97
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		2,245,512,792.30	3,806,548,325.21
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
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		350,670.89	416,277.72
应付托管费		116,890.29	138,759.23
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	7.4.7.9	19,752,777.18	11,961,486.07
负债合计		20,220,338.36	12,516,523.02
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	1,772,012,667.00	3,764,012,667.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	453,279,786.94	30,019,135.19
净资产合计		2,225,292,453.94	3,794,031,802.19
负债和净资产总计		2,245,512,792.30	3,806,548,325.21

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2558 元，基金份额总额 1,772,012,667.00 份。

7.2 利润表

会计主体：鹏华中证 A500 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 11 月 21 日（基 金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		748,991,490.97	-3,762,496.55
1. 利息收入		118,301.50	972,638.74
其中：存款利息收入	7.4.7.13	118,301.50	972,638.74
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）		423,482,899.19	11,827,249.34
其中：股票投资收益	7.4.7.14	344,636,303.93	8,092,915.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券 投资收益	7.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	78,846,595.26	3,734,333.68
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	324,710,035.95	-16,974,407.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	680,254.33	412,022.61
减：二、营业总支出		7,632,312.44	681,473.23
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,456,364.42	490,027.10
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,818,788.03	163,342.36
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	357,159.99	28,103.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		741,359,178.53	-4,443,969.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		741,359,178.53	-4,443,969.78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		741,359,178.53	-4,443,969.78

7.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 A500 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	3,764,012,667.00	-	30,019,135.19	3,794,031,802.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,764,012,667.00	-	30,019,135.19	3,794,031,802.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-	-
	1,992,000,000.00	-	423,260,651.75	1,568,739,348.25
(一)、综合收益总额	-	-	741,359,178.53	741,359,178.53
(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)	-	-	-	-
	1,992,000,000.00	-	318,098,526.78	2,310,098,526.78
其中：1. 基金申购款	3,510,000,000.00	-	100,304,438.72	3,610,304,438.72
2. 基金赎回款	-	-	-	-
	5,502,000,000.00	-	418,402,965.50	5,920,402,965.50
(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	1,772,012,667.00	-	453,279,786.94	2,225,292,453.94
项目	上年度可比期间 2024年11月21日(基金合同生效日)至2024年12月31日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,000,012,667.00	-	-	2,000,012,667.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,764,000,000.00	-	30,019,135.19	1,794,019,135.19
(一)、综合收益总额	-	-	-4,443,969.78	-4,443,969.78
(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)	1,764,000,000.00	-	34,463,104.97	1,798,463,104.97
其中：1. 基金申购款	2,379,000,000.00	-	45,961,921.12	2,424,961,921.12
2. 基金赎回款	-615,000,000.00	-	-11,498,816.15	-626,498,816.15
(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	3,764,012,667.00	-	30,019,135.19	3,794,031,802.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华中证 A500 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[2024]1527 号《关于准予鹏华中证 A500 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 A500 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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,999,999,403.00 元(含募集股票市值),业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(24)第 00226 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,012,667.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 13,264.00 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 A500 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年度和 2024 年 11 月 21 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的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 12 月 31 日和 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度和 2024 年 11 月 21 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2025 年

01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日和 2024 年 11 月 21 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产的分类

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

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公

允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本

和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基

金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金可以进行收益分配。在符合有关基金收益分配条件的前提下，每次收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交

易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、

财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025] 4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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，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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税；自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2025年12月31日	2024年12月31日
活期存款	14,916,469.95	26,095,164.23
等于：本金	14,914,797.84	26,092,448.30
加：应计利息	1,672.11	2,715.93
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	59,009,487.82	107,933,739.66
等于：本金	59,008,914.56	107,930,926.55
加：应计利息	573.26	2,813.11
减：坏账准备	-	-
合计	73,925,957.77	134,028,903.89

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2025年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,858,783,479.92	-	2,166,519,108.63	307,735,628.71
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	1,858,783,479.92	-	2,166,519,108.63	307,735,628.71

项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,685,957,972.23	-	3,668,983,564.99	-16,974,407.24
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,685,957,972.23	-	3,668,983,564.99	-16,974,407.24

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31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	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	78,000.00	1,639.34
应退替代款	19,475,604.76	11,942,770.81
可退替代款	189,980.42	17,075.92
其他	9,192.00	-
合计	19,752,777.18	11,961,486.07

7.4.7.10 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,764,012,667.00	3,764,012,667.00
本期申购	3,510,000,000.00	3,510,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-5,502,000,000.00	-5,502,000,000.00
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	1,772,012,667.00	1,772,012,667.00

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。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,412,258.50	14,606,876.69	30,019,135.19
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	15,412,258.50	14,606,876.69	30,019,135.19
本期利润	416,649,142.58	324,710,035.95	741,359,178.53
本期基金份额交易产生的变动数	-132,259,717.13	-185,838,809.65	-318,098,526.78
其中：基金申购款	60,828,683.44	39,475,755.28	100,304,438.72
基金赎回款	-193,088,400.57	-225,314,564.93	-418,402,965.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	299,801,683.95	153,478,102.99	453,279,786.94

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2024年11月21日（基金合同生效日）至2024年12月31日
活期存款利息收入	59,972.92	41,742.55
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	57,112.89	13,416.39
结算备付金利息收入	1,215.69	119,464.36
其他	-	798,015.44

合计	118,301.50	972,638.74
----	------------	------------

注：1、其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

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

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年11月21日（基金合 同生效日）至2024年12月 31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	208,556,433.97	3,857,223.87
股票投资收益——赎回 差价收入	136,079,869.96	4,235,691.79
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	344,636,303.93	8,092,915.66

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年11月21日（基金 合同生效日）至2024年12月31 日
卖出股票成交总 额	3,260,670,685.00	420,049,478.34
减：卖出股票成本 总额	3,049,076,878.86	415,103,391.44
减：交易费用	3,037,372.17	1,088,863.03
买卖股票差价收 入	208,556,433.97	3,857,223.87

7.4.7.14.3 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12月31日	上年度可比期间 2024年11月21日（基金合 同生效日）至2024年12月 31日
赎回基金份额对价总	5,920,402,965.50	626,498,816.15

额		
减：现金支付赎回款总额	2,611,064,041.50	278,215,575.15
减：赎回股票成本总额	3,173,259,054.04	344,047,549.21
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	136,079,869.96	4,235,691.79

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年11月21日（基金合同 生效日）至2024年12月31日
股票投资产生的股利 收益	78,846,595.26	3,734,333.68
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	78,846,595.26	3,734,333.68

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2024年11月21日（基 金合同生效日）至2024年12 月31日
1. 交易性金融资产	324,710,035.95	-16,974,407.24
股票投资	324,710,035.95	-16,974,407.24
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	324,710,035.95	-16,974,407.24

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年11月21日（基金合同生效日）至2024年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	680,254.33	412,022.61
合计	680,254.33	412,022.61

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。

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年11月21日（基金合同生效日）至2024年12月31日
审计费用	58,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	9,159.99	1,064.43
登记结算费	150,000.00	25,000.00
IOPV 计算和发布费	20,000.00	1,639.34
其他	-	400.00
合计	357,159.99	28,103.77

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司（“Eurizon Capital SGR S.p.A.”）	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司（“鹏华资产”）	基金管理人的子公司
鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“鹏华中证 A500ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：1、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 11 月 21 日（基金 合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,456,364.42	490,027.10
其中：应支付销售机构的客户维护	381,961.91	104,798.54

费		
应支付基金管理人的净管理费	5,074,402.51	385,228.56

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 0.15%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 11 月 21 日（基金 合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,818,788.03	163,342.36

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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×0.05%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 11 月 21 日（基金 合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

基金合同生效日（2024 年 11 月 21 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	8,450,600.00	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	8,450,600.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.4769%	-

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
国信证券	799,900.00	0.05	29,999,962.00	0.80
鹏华中证 A500ETF联接	311,821,206.00	17.60	-	-

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 11 月 21 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	14,916,469.95	59,972.92	26,095,164.23	41,742.55

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
001221	悍高集团	2025年7月23日	6个月	新股流通受限	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
001285	瑞立科密	2025年9月23日	6个月	新股流通受限	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
001386	马可波罗	2025年10月15日	6个月	新股流通受限	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
301491	汉桑科技	2025年7月29日	6个月	新股流通受限	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301563	云汉芯城	2025年9月23日	6个月	新股流通受限	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301575	艾芬达	2025年9月3日	6个月	新股流通受限	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
301609	山大电力	2025年7月16日	6个月	新股流通受限	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301632	广东建科	2025年8月5日	6个月	新股流通受限	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
301656	联合动力	2025年9月17日	6个月	新股流通受限	12.48	25.46	7,395	92,289.60	188,276.70	-

301668	昊创瑞通	2025年9月15日	6个月	新股流通受限	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
603376	大明电子	2025年10月28日	6个月	新股流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688012	中微公司	2025年12月19日	重大事项	272.72	2026年1月5日	278.00	41,908	8,632,002.51	11,429,149.76	-
002049	紫光国微	2025年12月30日	重大事项	78.81	2026年1月15日	86.69	55,600	3,853,277.49	4,381,836.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金。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国内依法发行或上市交易的其他非成份股（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、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。

7.4.13.2 信用风险

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券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 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率

敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	73,925,957.77	-	-	-	73,925,957.77
结算备付金	120,680.05	-	-	-	120,680.05
交易性金融资产	-	-	-	-2,166,519,108.63	2,166,519,108.63
应收清算款	-	-	-	4,947,045.85	4,947,045.85
资产总计	74,046,637.82	-	-	-2,171,466,154.48	2,245,512,792.30
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	350,670.89	350,670.89
应付托管费	-	-	-	116,890.29	116,890.29
其他负债	-	-	-	19,752,777.18	19,752,777.18
负债总计	-	-	-	20,220,338.36	20,220,338.36
利率敏感度缺口	74,046,637.82	-	-	-2,151,245,816.12	2,225,292,453.94
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	134,028,903.89	-	-	-	134,028,903.89
结算备付金	119,464.36	-	-	-	119,464.36
交易性金融资产	-	-	-	-3,668,983,564.99	3,668,983,564.99
应收清算款	-	-	-	3,416,391.97	3,416,391.97
资产总计	134,148,368.25	-	-	-3,672,399,956.96	3,806,548,325.21
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	416,277.72	416,277.72
应付托管费	-	-	-	138,759.23	138,759.23
其他负债	-	-	-	11,961,486.07	11,961,486.07
负债总计	-	-	-	12,516,523.02	12,516,523.02
利率敏感度缺口	134,148,368.25	-	-	-3,659,883,433.94	3,794,031,802.19

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2025年12月31日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净

值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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：本基金投资于标的指数成份股（含存托凭证）和备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%，且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。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	2,166,519,108.63	97.36	3,668,983,564.99	96.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,166,519,108.63	97.36	3,668,983,564.99	96.70

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	108,961,445.01	-
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-108,961,445.01	-

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

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	2,150,401,282.26	3,663,907,182.99
第二层次	15,810,985.76	5,076,382.00
第三层次	306,840.61	-
合计	2,166,519,108.63	3,668,983,564.99

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	149,672.38	149,672.38
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	157,168.23	157,168.23
其中：计入损益的利得或损失	-	157,168.23	157,168.23

计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	306,840.61	306,840.61
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	157,168.23	157,168.23
项目	上年度可比期间 2024年11月21日（基金合同生效日）至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	306,840.61	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	19.20%-286.66%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,166,519,108.63	96.48
	其中：股票	2,166,519,108.63	96.48
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	74,046,637.82	3.30
8	其他各项资产	4,947,045.85	0.22
9	合计	2,245,512,792.30	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	10,986,224.58	0.49
B	采矿业	124,645,116.90	5.60
C	制造业	1,348,636,119.71	60.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,134,100.00	2.34

E	建筑业	31,778,046.95	1.43
F	批发和零售业	13,671,361.20	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	59,339,887.04	2.67
H	住宿和餐饮业	1,540,945.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	140,528,355.84	6.32
J	金融业	297,209,707.00	13.36
K	房地产业	18,087,927.00	0.81
L	租赁和商务服务业	24,605,271.80	1.11
M	科学研究和技术服务业	24,730,754.00	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	4,323,894.00	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,006,676.00	0.05
Q	卫生和社会工作	6,380,184.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	4,055,163.00	0.18
S	综合	2,552,534.00	0.11
	合计	2,166,212,268.02	97.35

8.2.2 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	276,600.63	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,705.90	0.00
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	-	-
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	15,534.08	0.00
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	306,840.61	0.01

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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	300750	宁德时代	193,640	71,116,226.40	3.20
2	600519	贵州茅台	44,861	61,781,671.98	2.78
3	601318	中国平安	794,200	54,323,280.00	2.44
4	300308	中际旭创	76,200	46,482,000.00	2.09
5	601899	紫金矿业	1,229,800	42,391,206.00	1.90
6	600036	招商银行	928,400	39,085,640.00	1.76
7	300502	新易盛	80,200	34,556,576.00	1.55
8	000333	美的集团	367,130	28,691,209.50	1.29
9	688256	寒武纪-U	20,159	27,326,532.45	1.23
10	601166	兴业银行	1,273,700	26,824,122.00	1.21
11	600900	长江电力	914,700	24,870,693.00	1.12
12	300059	东方财富	957,200	22,187,896.00	1.00
13	002475	立讯精密	383,700	21,759,627.00	0.98
14	600030	中信证券	738,200	21,193,722.00	0.95
15	600276	恒瑞医药	335,665	19,995,564.05	0.90
16	002594	比亚迪	200,500	19,592,860.00	0.88
17	601398	工商银行	2,433,400	19,296,862.00	0.87
18	300274	阳光电源	109,100	18,660,464.00	0.84
19	688981	中芯国际	146,185	17,955,903.55	0.81
20	603259	药明康德	191,400	17,348,496.00	0.78

21	601211	国泰海通	838,600	17,233,230.00	0.77
22	601288	农业银行	2,158,200	16,574,976.00	0.74
23	000858	五粮液	141,100	14,948,134.00	0.67
24	601328	交通银行	1,995,500	14,467,375.00	0.65
25	000651	格力电器	338,400	13,610,448.00	0.61
26	600887	伊利股份	469,700	13,433,420.00	0.60
27	688041	海光信息	58,895	13,216,626.95	0.59
28	603993	洛阳钼业	654,700	13,094,000.00	0.59
29	600000	浦发银行	1,003,700	12,486,028.00	0.56
30	300476	胜宏科技	43,400	12,480,972.00	0.56
31	002371	北方华创	26,535	12,181,687.80	0.55
32	000725	京东方 A	2,761,000	11,623,810.00	0.52
33	688012	中微公司	41,908	11,429,149.76	0.51
34	600150	中国船舶	341,723	11,365,706.98	0.51
35	601816	京沪高铁	2,206,700	11,364,505.00	0.51
36	601601	中国太保	252,200	10,569,702.00	0.47
37	603986	兆易创新	48,800	10,455,400.00	0.47
38	600309	万华化学	134,534	10,316,067.12	0.46
39	300124	汇川技术	135,600	10,214,748.00	0.46
40	002714	牧原股份	201,901	10,212,152.58	0.46
41	601088	中国神华	240,300	9,732,150.00	0.44
42	600031	三一重工	445,500	9,413,415.00	0.42
43	603019	中科曙光	109,800	9,403,272.00	0.42
44	000063	中兴通讯	248,100	9,388,104.00	0.42
45	688008	澜起科技	79,492	9,364,157.60	0.42
46	002050	三花智控	169,000	9,347,390.00	0.42
47	600111	北方稀土	197,000	9,085,640.00	0.41
48	002230	科大讯飞	176,000	8,851,040.00	0.40
49	601857	中国石油	843,700	8,782,917.00	0.39
50	600089	特变电工	378,100	8,401,382.00	0.38
51	000001	平安银行	735,300	8,389,773.00	0.38
52	601012	隆基绿能	459,580	8,364,356.00	0.38
53	603501	豪威集团	65,900	8,296,810.00	0.37
54	002415	海康威视	275,500	8,220,920.00	0.37
55	300760	迈瑞医疗	43,100	8,208,395.00	0.37
56	000425	徐工机械	705,200	8,166,216.00	0.37
57	600660	福耀玻璃	123,200	7,979,664.00	0.36
58	601668	中国建筑	1,555,300	7,978,689.00	0.36
59	002384	东山精密	92,900	7,863,985.00	0.35
60	603799	华友钴业	115,000	7,849,900.00	0.35
61	601127	赛力斯	62,900	7,608,384.00	0.34
62	601888	中国中免	78,400	7,413,504.00	0.33
63	600690	海尔智家	283,700	7,401,733.00	0.33

64	601728	中国电信	1,161,000	7,314,300.00	0.33
65	601600	中国铝业	592,900	7,245,238.00	0.33
66	600941	中国移动	71,400	7,214,970.00	0.32
67	002463	沪电股份	98,700	7,212,009.00	0.32
68	000338	潍柴动力	413,500	7,112,200.00	0.32
69	601919	中远海控	467,800	7,101,204.00	0.32
70	002352	顺丰控股	185,000	7,089,200.00	0.32
71	000100	TCL 科技	1,559,600	7,080,584.00	0.32
72	002028	思源电气	44,520	6,882,346.80	0.31
73	000792	盐湖股份	244,300	6,879,488.00	0.31
74	688111	金山办公	22,143	6,799,451.01	0.31
75	600418	江淮汽车	137,100	6,786,450.00	0.30
76	600028	中国石化	1,091,200	6,743,616.00	0.30
77	300033	同花顺	20,600	6,636,908.00	0.30
78	600406	国电南瑞	293,900	6,606,872.00	0.30
79	000988	华工科技	81,400	6,457,462.00	0.29
80	000568	泸州老窖	55,500	6,450,210.00	0.29
81	601225	陕西煤业	295,200	6,293,664.00	0.28
82	601766	中国中车	908,000	6,192,560.00	0.28
83	600183	生益科技	86,100	6,148,401.00	0.28
84	601988	中国银行	1,066,700	6,112,191.00	0.27
85	300394	天孚通信	29,690	6,027,960.70	0.27
86	002916	深南电路	25,579	5,941,745.91	0.27
87	688271	联影医疗	47,280	5,933,640.00	0.27
88	601628	中国人寿	129,200	5,878,600.00	0.26
89	300014	亿纬锂能	88,900	5,846,064.00	0.26
90	600050	中国联通	1,135,500	5,802,405.00	0.26
91	002027	分众传媒	759,400	5,596,778.00	0.25
92	002625	光启技术	114,400	5,578,144.00	0.25
93	000977	浪潮信息	83,300	5,547,780.00	0.25
94	002241	歌尔股份	192,900	5,542,017.00	0.25
95	600938	中国海油	183,300	5,531,994.00	0.25
96	600547	山东黄金	142,800	5,527,788.00	0.25
97	601985	中国核电	620,500	5,367,325.00	0.24
98	688072	拓荆科技	16,130	5,322,900.00	0.24
99	605499	东鹏饮料	19,900	5,321,061.00	0.24
100	600104	上汽集团	349,600	5,320,912.00	0.24
101	601689	拓普集团	68,100	5,255,958.00	0.24
102	600489	中金黄金	218,000	5,092,480.00	0.23
103	000408	藏格矿业	60,200	5,080,880.00	0.23
104	000807	云铝股份	154,500	5,073,780.00	0.23
105	002460	赣锋锂业	78,300	4,924,287.00	0.22
106	002709	天赐材料	106,100	4,915,613.00	0.22

107	600436	片仔癀	28,900	4,877,742.00	0.22
108	600019	宝钢股份	653,000	4,864,850.00	0.22
109	688521	芯原股份	35,195	4,820,659.15	0.22
110	300136	信维通信	77,600	4,811,200.00	0.22
111	603288	海天味业	129,500	4,794,090.00	0.22
112	002466	天齐锂业	84,000	4,651,920.00	0.21
113	601006	大秦铁路	900,800	4,648,128.00	0.21
114	600362	江西铜业	82,370	4,523,760.40	0.20
115	601658	邮储银行	827,700	4,510,965.00	0.20
116	300803	指南针	34,400	4,501,928.00	0.20
117	300408	三环集团	98,200	4,492,650.00	0.20
118	300433	蓝思科技	146,100	4,422,447.00	0.20
119	000625	长安汽车	370,900	4,398,874.00	0.20
120	002837	英维克	41,100	4,393,179.00	0.20
121	002049	紫光国微	55,600	4,381,836.00	0.20
122	600905	三峡能源	1,064,600	4,354,214.00	0.20
123	002558	巨人网络	99,400	4,303,026.00	0.19
124	002738	中矿资源	53,900	4,233,845.00	0.19
125	601390	中国中铁	769,000	4,160,290.00	0.19
126	600879	航天电子	192,300	4,099,836.00	0.18
127	600438	通威股份	198,200	4,067,064.00	0.18
128	600585	海螺水泥	184,400	4,030,984.00	0.18
129	601727	上海电气	468,100	4,030,341.00	0.18
130	600988	赤峰黄金	129,000	4,029,960.00	0.18
131	000538	云南白药	70,500	4,001,580.00	0.18
132	601100	恒立液压	36,200	3,978,742.00	0.18
133	600118	中国卫星	41,500	3,940,425.00	0.18
134	600584	长电科技	106,800	3,928,104.00	0.18
135	600010	宝钢股份	1,644,300	3,913,434.00	0.18
136	300015	爱尔眼科	355,800	3,906,684.00	0.18
137	600893	航发动力	97,400	3,898,922.00	0.18
138	002202	金风科技	186,600	3,806,640.00	0.17
139	600160	巨化股份	99,000	3,803,580.00	0.17
140	600115	中国东航	633,900	3,803,400.00	0.17
141	000426	兴业银锡	106,200	3,780,720.00	0.17
142	300450	先导智能	74,800	3,738,504.00	0.17
143	600760	中航沈飞	66,400	3,728,360.00	0.17
144	600580	卧龙电驱	74,500	3,657,950.00	0.16
145	600522	中天科技	201,000	3,642,120.00	0.16
146	688036	传音控股	55,034	3,641,049.44	0.16
147	000630	铜陵有色	605,300	3,637,853.00	0.16
148	000938	紫光股份	146,400	3,601,440.00	0.16
149	601168	西部矿业	129,400	3,576,616.00	0.16

150	688120	华海清科	23,670	3,552,393.60	0.16
151	600487	亨通光电	143,600	3,551,228.00	0.16
152	688002	睿创微纳	35,204	3,548,563.20	0.16
153	600346	恒力石化	156,900	3,534,957.00	0.16
154	600426	华鲁恒升	112,100	3,523,303.00	0.16
155	002074	国轩高科	88,600	3,465,146.00	0.16
156	600570	恒生电子	114,800	3,461,220.00	0.16
157	002920	德赛西威	28,545	3,433,963.50	0.15
158	300223	北京君正	32,300	3,425,092.00	0.15
159	600795	国电电力	672,600	3,389,904.00	0.15
160	002532	天山铝业	206,800	3,346,024.00	0.15
161	300442	润泽科技	63,100	3,331,680.00	0.15
162	300751	迈为股份	16,100	3,316,439.00	0.15
163	000933	神火股份	120,500	3,310,135.00	0.15
164	600029	南方航空	410,400	3,287,304.00	0.15
165	601669	中国电建	631,500	3,283,800.00	0.15
166	600048	保利发展	535,700	3,267,770.00	0.15
167	600989	宝丰能源	165,300	3,244,839.00	0.15
168	688122	西部超导	43,482	3,242,887.56	0.15
169	002179	中航光电	91,500	3,242,760.00	0.15
170	002156	通富微电	86,000	3,242,200.00	0.15
171	600415	小商品城	202,100	3,223,495.00	0.14
172	002340	格林美	384,100	3,211,076.00	0.14
173	000157	中联重科	371,300	3,204,319.00	0.14
174	600066	宇通客车	97,000	3,171,900.00	0.14
175	600176	中国巨石	184,600	3,156,660.00	0.14
176	000975	山金国际	129,400	3,148,302.00	0.14
177	600549	厦门钨业	76,200	3,128,772.00	0.14
178	601058	赛轮轮胎	191,500	3,098,470.00	0.14
179	002353	杰瑞股份	43,674	3,093,429.42	0.14
180	300058	蓝色光标	268,240	3,090,124.80	0.14
181	600096	云天化	92,000	3,073,720.00	0.14
182	600143	金发科技	156,600	3,059,964.00	0.14
183	000547	航天发展	92,200	3,043,522.00	0.14
184	300339	润和软件	61,115	3,025,192.50	0.14
185	688169	石头科技	19,819	3,013,677.14	0.14
186	002195	岩山科技	422,100	2,992,689.00	0.13
187	688126	沪硅产业	138,267	2,992,097.88	0.13
188	688777	中控技术	60,519	2,986,007.46	0.13
189	688235	百济神州-U	11,001	2,954,868.60	0.13
190	002001	新和成	116,900	2,944,711.00	0.13
191	002517	恺英网络	133,400	2,917,458.00	0.13
192	600009	上海机场	88,900	2,912,364.00	0.13

193	300207	欣旺达	111,300	2,910,495.00	0.13
194	601360	三六零	259,600	2,899,732.00	0.13
195	000661	长春高新	31,300	2,896,815.00	0.13
196	300418	昆仑万维	69,300	2,889,810.00	0.13
197	002131	利欧股份	511,500	2,884,860.00	0.13
198	603129	春风动力	10,300	2,870,404.00	0.13
199	002407	多氟多	83,800	2,841,658.00	0.13
200	688099	晶晨股份	32,215	2,810,114.45	0.13
201	002436	兴森科技	132,500	2,805,025.00	0.13
202	300454	深信服	24,200	2,786,872.00	0.13
203	002555	三七互娱	118,000	2,784,800.00	0.13
204	600219	南山铝业	516,200	2,777,156.00	0.12
205	300604	长川科技	27,400	2,775,894.00	0.12
206	002236	大华股份	143,800	2,723,572.00	0.12
207	000963	华东医药	68,900	2,718,105.00	0.12
208	688578	艾力斯	25,816	2,688,736.40	0.12
209	600885	宏发股份	88,360	2,686,144.00	0.12
210	688396	华润微	50,772	2,683,807.92	0.12
211	601186	中国铁建	349,900	2,683,733.00	0.12
212	601111	中国国航	283,300	2,654,521.00	0.12
213	002493	荣盛石化	226,500	2,652,315.00	0.12
214	002008	大族激光	63,700	2,623,803.00	0.12
215	002456	欧菲光	247,000	2,623,140.00	0.12
216	000768	中航西飞	103,300	2,621,754.00	0.12
217	000831	中国稀土	56,200	2,609,928.00	0.12
218	002938	鹏鼎控股	51,600	2,609,928.00	0.12
219	600895	张江高科	59,000	2,590,100.00	0.12
220	002273	水晶光电	103,100	2,589,872.00	0.12
221	600157	永泰能源	1,636,000	2,568,520.00	0.12
222	688608	恒玄科技	11,291	2,562,379.54	0.12
223	002252	上海莱士	404,100	2,561,994.00	0.12
224	688213	思特威-W	26,895	2,557,445.55	0.11
225	600673	东阳光	113,800	2,552,534.00	0.11
226	300724	捷佳伟创	26,700	2,552,520.00	0.11
227	688506	百利天恒	7,895	2,550,874.50	0.11
228	600745	闻泰科技	68,300	2,546,224.00	0.11
229	002601	龙佰集团	129,500	2,535,610.00	0.11
230	688047	龙芯中科	19,171	2,532,680.81	0.11
231	600839	四川长虹	278,100	2,530,710.00	0.11
232	600372	中航机载	186,300	2,500,146.00	0.11
233	300395	菲利华	24,900	2,497,470.00	0.11
234	600011	华能国际	330,000	2,461,800.00	0.11
235	600699	均胜电子	78,500	2,461,760.00	0.11

236	601877	正泰电器	87,800	2,448,742.00	0.11
237	002851	麦格米特	27,000	2,431,890.00	0.11
238	600886	国投电力	184,600	2,421,952.00	0.11
239	600741	华域汽车	120,700	2,414,000.00	0.11
240	000002	万科 A	517,600	2,406,840.00	0.11
241	600196	复星医药	90,700	2,402,643.00	0.11
242	300759	康龙化成	84,100	2,390,963.00	0.11
243	002130	沃尔核材	90,800	2,389,856.00	0.11
244	603659	璞泰来	87,200	2,384,048.00	0.11
245	002472	双环传动	49,900	2,365,759.00	0.11
246	688017	绿的谐波	12,270	2,357,067.00	0.11
247	300866	安克创新	20,600	2,356,434.00	0.11
248	002812	恩捷股份	41,500	2,350,560.00	0.11
249	001979	招商蛇口	270,300	2,335,392.00	0.10
250	603087	甘李药业	34,300	2,334,801.00	0.10
251	002648	卫星化学	131,000	2,316,080.00	0.10
252	301236	软通动力	48,800	2,314,584.00	0.10
253	600460	士兰微	81,300	2,309,733.00	0.10
254	002465	海格通信	145,100	2,285,325.00	0.10
255	600515	海南机场	426,200	2,271,646.00	0.10
256	300757	罗博特科	9,700	2,263,010.00	0.10
257	002422	科伦药业	76,900	2,257,015.00	0.10
258	600392	盛和资源	104,000	2,239,120.00	0.10
259	002281	光迅科技	32,000	2,238,400.00	0.10
260	601872	招商轮船	248,800	2,234,224.00	0.10
261	302132	中航成飞	28,200	2,227,800.00	0.10
262	300390	天华新能	40,600	2,217,166.00	0.10
263	601868	中国能建	943,200	2,216,520.00	0.10
264	000960	锡业股份	79,500	2,216,460.00	0.10
265	003816	中国广核	589,300	2,215,768.00	0.10
266	002138	顺络电子	62,000	2,202,860.00	0.10
267	300346	南大光电	51,280	2,199,912.00	0.10
268	601319	中国人保	245,400	2,196,330.00	0.10
269	600233	圆通速递	133,600	2,193,712.00	0.10
270	601800	中国交建	265,000	2,183,600.00	0.10
271	002128	电投能源	77,500	2,163,025.00	0.10
272	300054	鼎龙股份	57,200	2,150,720.00	0.10
273	002129	TCL 中环	249,175	2,135,429.75	0.10
274	000878	云南铜业	104,100	2,135,091.00	0.10
275	000301	东方盛虹	192,800	2,099,592.00	0.09
276	000786	北新建材	82,772	2,066,816.84	0.09
277	300896	爱美客	14,560	2,063,443.20	0.09
278	002078	太阳纸业	130,300	2,052,225.00	0.09

279	600141	兴发集团	58,800	2,033,304.00	0.09
280	002185	华天科技	185,100	2,030,547.00	0.09
281	002409	雅克科技	27,400	2,030,340.00	0.09
282	601633	长城汽车	89,300	2,020,859.00	0.09
283	601117	中国化学	268,315	2,020,411.95	0.09
284	600498	烽火通信	62,900	2,017,832.00	0.09
285	000066	中国长城	140,000	2,017,400.00	0.09
286	600352	浙江龙盛	188,800	2,012,608.00	0.09
287	600588	用友网络	151,000	2,002,260.00	0.09
288	601615	明阳智能	137,600	1,992,448.00	0.09
289	002497	雅化集团	80,200	1,984,950.00	0.09
290	600674	川投能源	141,400	1,965,460.00	0.09
291	688617	惠泰医疗	8,075	1,964,405.25	0.09
292	002595	豪迈科技	23,200	1,960,632.00	0.09
293	002414	高德红外	133,600	1,959,912.00	0.09
294	300017	网宿科技	190,100	1,948,525.00	0.09
295	300347	泰格医药	34,300	1,944,810.00	0.09
296	002294	信立泰	38,400	1,902,720.00	0.09
297	000617	中油资本	196,800	1,889,280.00	0.08
298	601021	春秋航空	31,700	1,886,150.00	0.08
299	600039	四川路桥	189,400	1,884,530.00	0.08
300	002271	东方雨虹	138,300	1,879,497.00	0.08
301	601233	桐昆股份	107,900	1,856,959.00	0.08
302	301358	湖南裕能	28,700	1,855,742.00	0.08
303	300037	新宙邦	35,200	1,844,480.00	0.08
304	300972	万辰集团	9,100	1,829,737.00	0.08
305	002444	巨星科技	53,700	1,826,874.00	0.08
306	300661	圣邦股份	26,400	1,812,096.00	0.08
307	300251	光线传媒	110,200	1,805,076.00	0.08
308	002085	万丰奥威	112,100	1,794,721.00	0.08
309	300438	鹏辉能源	33,700	1,793,514.00	0.08
310	603260	合盛硅业	34,000	1,791,800.00	0.08
311	603486	科沃斯	22,200	1,791,096.00	0.08
312	002821	凯莱英	19,200	1,784,256.00	0.08
313	300012	华测检测	131,100	1,776,405.00	0.08
314	300316	晶盛机电	47,700	1,752,975.00	0.08
315	688180	君实生物-U	51,294	1,752,203.04	0.08
316	300748	金力永磁	50,500	1,722,555.00	0.08
317	688065	凯赛生物	34,483	1,717,253.40	0.08
318	300567	精测电子	18,800	1,714,560.00	0.08
319	605117	德业股份	19,706	1,698,657.20	0.08
320	688005	容百科技	47,836	1,693,394.40	0.08
321	300782	卓胜微	20,780	1,693,154.40	0.08

322	601799	星宇股份	13,700	1,690,169.00	0.08
323	688223	晶科能源	298,953	1,686,094.92	0.08
324	601179	中国西电	185,000	1,683,500.00	0.08
325	300285	国瓷材料	61,200	1,677,492.00	0.08
326	600497	驰宏锌锗	229,100	1,674,721.00	0.08
327	600256	广汇能源	337,800	1,661,976.00	0.07
328	002459	晶澳科技	144,800	1,657,960.00	0.07
329	688472	阿特斯	111,058	1,655,874.78	0.07
330	688303	大全能源	61,533	1,650,315.06	0.07
331	300002	神州泰岳	143,000	1,647,360.00	0.07
332	688266	泽璟制药-U	17,717	1,642,365.90	0.07
333	002405	四维图新	182,200	1,641,622.00	0.07
334	002624	完美世界	99,800	1,635,722.00	0.07
335	300763	锦浪科技	22,900	1,635,289.00	0.07
336	300024	机器人	89,700	1,631,643.00	0.07
337	002223	鱼跃医疗	42,700	1,631,567.00	0.07
338	600085	同仁堂	50,500	1,629,130.00	0.07
339	002180	纳思达	80,176	1,621,158.72	0.07
340	600486	扬农化工	23,300	1,616,787.00	0.07
341	002410	广联达	128,300	1,614,014.00	0.07
342	300699	光威复材	40,800	1,609,968.00	0.07
343	600482	中国动力	77,700	1,608,390.00	0.07
344	300122	智飞生物	84,400	1,592,628.00	0.07
345	002064	华峰化学	144,700	1,591,700.00	0.07
346	601618	中国中冶	532,700	1,582,119.00	0.07
347	603979	金诚信	20,710	1,577,066.50	0.07
348	688599	天合光能	95,026	1,572,680.30	0.07
349	603605	珀莱雅	22,800	1,561,344.00	0.07
350	002065	东华软件	169,500	1,550,925.00	0.07
351	300073	当升科技	26,700	1,543,260.00	0.07
352	000034	神州数码	39,600	1,540,836.00	0.07
353	600803	新奥股份	73,900	1,534,164.00	0.07
354	600862	中航高科	64,900	1,533,587.00	0.07
355	002155	湖南黄金	71,960	1,517,636.40	0.07
356	001965	招商公路	150,500	1,517,040.00	0.07
357	600026	中远海能	129,400	1,511,392.00	0.07
358	300568	星源材质	98,800	1,506,700.00	0.07
359	688188	柏楚电子	11,043	1,500,633.27	0.07
360	000623	吉林敖东	76,500	1,494,045.00	0.07
361	300003	乐普医疗	93,300	1,475,073.00	0.07
362	002318	久立特材	50,600	1,464,870.00	0.07
363	603606	东方电缆	24,400	1,457,900.00	0.07
364	600637	东方明珠	147,800	1,455,830.00	0.07

365	600521	华海药业	85,300	1,447,541.00	0.07
366	600765	中航重机	75,400	1,444,664.00	0.06
367	300474	景嘉微	20,100	1,444,587.00	0.06
368	000932	华菱钢铁	255,200	1,434,224.00	0.06
369	300001	特锐德	55,600	1,427,808.00	0.06
370	002245	蔚蓝锂芯	80,100	1,425,780.00	0.06
371	000887	中鼎股份	60,700	1,408,847.00	0.06
372	605589	圣泉集团	49,700	1,406,510.00	0.06
373	000009	中国宝安	142,700	1,405,595.00	0.06
374	000683	博源化工	188,700	1,403,928.00	0.06
375	300919	中伟股份	30,000	1,389,900.00	0.06
376	600845	宝信软件	67,100	1,389,641.00	0.06
377	688166	博瑞医药	28,318	1,389,281.08	0.06
378	000999	华润三九	48,809	1,389,104.14	0.06
379	000423	东阿阿胶	28,300	1,388,964.00	0.06
380	300413	芒果超媒	56,600	1,382,172.00	0.06
381	000400	许继电气	53,300	1,370,343.00	0.06
382	601607	上海医药	76,600	1,368,076.00	0.06
383	600563	法拉电子	13,000	1,364,350.00	0.06
384	300496	中科创达	20,200	1,363,500.00	0.06
385	600332	白云山	52,200	1,343,628.00	0.06
386	300383	光环新网	107,400	1,343,574.00	0.06
387	300142	沃森生物	123,100	1,343,021.00	0.06
388	601238	广汽集团	164,300	1,340,688.00	0.06
389	000708	中信特钢	81,800	1,339,066.00	0.06
390	600177	雅戈尔	176,000	1,337,600.00	0.06
391	000039	中集集团	131,100	1,322,799.00	0.06
392	000830	鲁西化工	79,600	1,318,972.00	0.06
393	300627	华测导航	37,660	1,314,710.60	0.06
394	002025	航天电器	26,200	1,313,406.00	0.06
395	600704	物产中大	235,800	1,313,406.00	0.06
396	601677	明泰铝业	88,800	1,313,352.00	0.06
397	603596	伯特利	25,500	1,307,385.00	0.06
398	600161	天坛生物	79,600	1,300,664.00	0.06
399	002176	江特电机	133,200	1,297,368.00	0.06
400	000738	航发控制	60,400	1,287,124.00	0.06
401	300832	新产业	22,700	1,276,875.00	0.06
402	603568	伟明环保	50,100	1,271,538.00	0.06
403	300676	华大基因	28,000	1,270,080.00	0.06
404	002044	美年健康	240,000	1,267,200.00	0.06
405	600153	建发股份	136,400	1,261,700.00	0.06
406	002739	万达电影	111,300	1,259,916.00	0.06
407	002432	九安医疗	31,200	1,249,248.00	0.06

408	300253	卫宁健康	139,400	1,229,508.00	0.06
409	600208	衢州发展	316,700	1,225,629.00	0.06
410	002389	航天彩虹	51,100	1,225,378.00	0.06
411	002152	广电运通	88,700	1,224,947.00	0.06
412	600763	通策医疗	30,000	1,206,300.00	0.05
413	601567	三星医疗	52,100	1,199,342.00	0.05
414	300459	汤姆猫	261,100	1,198,449.00	0.05
415	601216	君正集团	247,700	1,193,914.00	0.05
416	600516	方大炭素	209,400	1,191,486.00	0.05
417	300628	亿联网络	33,400	1,190,710.00	0.05
418	300083	创世纪	129,100	1,189,011.00	0.05
419	603806	福斯特	84,800	1,183,808.00	0.05
420	000519	中兵红箭	64,800	1,180,008.00	0.05
421	300088	长信科技	194,400	1,178,064.00	0.05
422	300068	南都电源	75,500	1,173,270.00	0.05
423	300573	兴齐眼药	16,560	1,164,002.40	0.05
424	000733	振华科技	22,000	1,153,020.00	0.05
425	002756	永兴材料	21,200	1,150,100.00	0.05
426	002007	华兰生物	75,200	1,137,776.00	0.05
427	000415	渤海租赁	280,200	1,134,810.00	0.05
428	300558	贝达药业	24,200	1,129,898.00	0.05
429	600018	上港集团	207,100	1,122,482.00	0.05
430	600499	科达制造	80,000	1,109,600.00	0.05
431	002603	以岭药业	65,000	1,109,550.00	0.05
432	600398	海澜之家	181,600	1,098,680.00	0.05
433	000629	钒钛股份	354,100	1,097,710.00	0.05
434	600312	平高电气	62,800	1,089,580.00	0.05
435	600820	隧道股份	165,400	1,073,446.00	0.05
436	600170	上海建工	403,300	1,068,745.00	0.05
437	300118	东方日升	72,500	1,062,850.00	0.05
438	601018	宁波港	288,000	1,045,440.00	0.05
439	603650	彤程新材	23,600	1,041,704.00	0.05
440	603077	和邦生物	460,200	1,040,052.00	0.05
441	688009	中国通号	187,286	1,024,454.42	0.05
442	603885	吉祥航空	68,600	1,020,768.00	0.05
443	600166	福田汽车	348,200	1,016,744.00	0.05
444	688390	固德威	16,264	1,010,482.32	0.05
445	002607	中公教育	367,400	1,006,676.00	0.05
446	600998	九州通	195,210	999,475.20	0.04
447	601155	新城控股	71,500	997,425.00	0.04
448	300144	宋城演艺	120,900	990,171.00	0.04
449	002841	视源股份	24,900	986,787.00	0.04
450	603816	顾家家居	32,100	986,754.00	0.04

451	600008	首创环保	328,100	984,300.00	0.04
452	600529	山东药玻	48,400	964,612.00	0.04
453	603392	万泰生物	21,241	954,570.54	0.04
454	002145	钛能化学	194,700	954,030.00	0.04
455	600859	王府井	60,200	934,906.00	0.04
456	688063	派能科技	16,422	933,098.04	0.04
457	603939	益丰药房	42,900	931,788.00	0.04
458	603833	欧派家居	17,500	911,575.00	0.04
459	600316	洪都航空	26,100	911,151.00	0.04
460	600323	瀚蓝环境	31,700	906,620.00	0.04
461	002244	滨江集团	88,900	893,445.00	0.04
462	600667	太极实业	109,900	875,903.00	0.04
463	600038	中直股份	24,100	870,733.00	0.04
464	601000	唐山港	223,256	857,303.04	0.04
465	002312	川发龙蟒	78,300	855,819.00	0.04
466	601880	辽港股份	534,200	854,720.00	0.04
467	600816	建元信托	301,500	853,245.00	0.04
468	600535	天士力	56,400	849,948.00	0.04
469	002701	奥瑞金	141,400	841,330.00	0.04
470	002544	普天科技	24,000	827,760.00	0.04
471	600258	首旅酒店	49,000	820,750.00	0.04
472	601966	玲珑轮胎	54,900	797,697.00	0.04
473	002266	浙富控股	189,500	788,320.00	0.04
474	600004	白云机场	82,300	778,558.00	0.03
475	000998	隆平高科	82,700	774,072.00	0.03
476	000032	深桑达 A	39,600	766,260.00	0.03
477	002891	中宠股份	14,600	755,696.00	0.03
478	000069	华侨城 A	301,400	747,472.00	0.03
479	002120	韵达股份	108,600	731,964.00	0.03
480	601866	中远海发	287,900	725,508.00	0.03
481	300601	康泰生物	49,000	723,730.00	0.03
482	600655	豫园股份	141,000	723,330.00	0.03
483	600754	锦江酒店	28,500	720,195.00	0.03
484	000035	中国天楹	129,800	716,496.00	0.03
485	002091	江苏国泰	78,400	707,952.00	0.03
486	600325	华发股份	165,500	698,410.00	0.03
487	000818	航锦科技	35,400	683,220.00	0.03
488	600867	通化东宝	82,300	672,391.00	0.03
489	000967	盈峰环境	91,500	671,610.00	0.03
490	300070	碧水源	163,500	640,920.00	0.03
491	002292	奥飞娱乐	70,100	620,385.00	0.03
492	300457	赢合科技	22,000	612,700.00	0.03
493	300529	健帆生物	31,000	609,770.00	0.03

494	600511	国药股份	21,000	603,750.00	0.03
495	600864	哈投股份	89,300	592,059.00	0.03
496	002572	索菲亚	40,200	547,122.00	0.02
497	603899	晨光股份	20,200	546,612.00	0.02
498	600007	中国国贸	19,300	382,526.00	0.02
499	001914	招商积余	25,400	271,272.00	0.01

8.3.2 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	301656	联合动力	7,395	188,276.70	0.01
2	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
3	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
4	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
5	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
6	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
7	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
8	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
9	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
10	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
11	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	300750	宁德时代	146,248,525.00	3.85
2	000333	美的集团	67,881,986.20	1.79
3	000858	五粮液	52,417,366.95	1.38
4	300059	东方财富	50,811,526.14	1.34
5	002594	比亚迪	42,656,278.76	1.12
6	300308	中际旭创	38,184,846.40	1.01
7	002475	立讯精密	37,156,705.87	0.98
8	300760	迈瑞医疗	33,345,734.96	0.88
9	000651	格力电器	33,282,285.75	0.88
10	600519	贵州茅台	32,029,934.00	0.84
11	002371	北方华创	30,458,479.53	0.80
12	000725	京东方 A	26,601,929.00	0.70
13	300124	汇川技术	25,788,314.42	0.68
14	601211	国泰海通	22,669,776.76	0.60
15	002714	牧原股份	21,584,795.52	0.57
16	000063	中兴通讯	21,183,289.00	0.56
17	300274	阳光电源	21,156,874.80	0.56

18	300502	新易盛	20,553,055.00	0.54
19	000001	平安银行	19,266,494.00	0.51
20	002415	海康威视	18,209,134.00	0.48

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	226,018,284.86	5.96
2	000333	美的集团	100,073,999.96	2.64
3	300059	东方财富	77,306,396.33	2.04
4	000858	五粮液	74,498,069.38	1.96
5	002594	比亚迪	70,612,616.35	1.86
6	300308	中际旭创	61,093,214.67	1.61
7	002475	立讯精密	57,779,459.31	1.52
8	000651	格力电器	49,778,233.00	1.31
9	300760	迈瑞医疗	46,115,780.27	1.22
10	002371	北方华创	44,236,922.81	1.17
11	300502	新易盛	42,931,371.72	1.13
12	300124	汇川技术	41,892,822.71	1.10
13	000725	京东方 A	39,795,209.00	1.05
14	300274	阳光电源	36,594,453.48	0.96
15	002714	牧原股份	33,232,142.18	0.88
16	000063	中兴通讯	31,077,656.00	0.82
17	000001	平安银行	29,455,132.42	0.78
18	002415	海康威视	28,262,492.54	0.74
19	300476	胜宏科技	28,023,873.00	0.74
20	688256	寒武纪-U	26,904,746.86	0.71

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,395,315,139.87
卖出股票收入（成交）总额	3,260,670,685.00

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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，提高投资效率，从而更好的跟踪标的指数，实现投资目标。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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

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

兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	4,947,045.85
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	4,947,045.85

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301656	联合动力	188,276.70	0.01	新股流通受限
2	001386	马可波罗	30,129.78	0.00	新股流通受限
3	301632	广东建科	15,534.08	0.00	新股流通受限
4	301563	云汉芯城	14,705.90	0.00	新股流通受限
5	301491	汉桑科技	13,501.95	0.00	新股流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 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 (%)
4,987	355,326.38	1,595,056,886.00	90.01	176,955,781.00	9.99

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国建设银行股份有限公司-鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	311,821,206.00	17.60

9.2 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	新华人寿保险股份有限公司	385,797,660.00	21.77
2	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	100,776,568.00	5.69
3	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—个险分红	94,928,907.00	5.36
4	国华人寿保险股份有限公司—传统十三号	83,846,900.00	4.73
5	东方财富证券股份有限公司	81,162,900.00	4.58
6	中国人寿保险股份有限公司	81,128,869.00	4.58
7	中国国际金融股份有限公司	67,979,137.00	3.84
8	中信保诚人寿保险有限公司—成长先锋投资账户	67,000,000.00	3.78
9	中国平安人寿保险股份有限公司—寿险传统高一自主	51,599,600.00	2.91
10	中汇人寿保险股份有限公司—传统产品	50,044,500.00	2.82
-	中国建设银行股份有限公司—鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	311,821,206.00	17.60

注：持有人为场内持有人。

9.3 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。

9.4 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。

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

注：无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2024年11月21日) 基金份额总额	2,000,012,667.00
本报告期期初基金份额总额	3,764,012,667.00
本报告期基金总申购份额	3,510,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	5,502,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,772,012,667.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，经公司第六届董事会第三百次会议审议通过，聘任薛华先生担任公司财务负责人，任职日期自 2025 年 11 月 30 日起。

报告期内，公司副总经理高鹏先生不再兼任公司首席信息官。经公司第六届董事会第三百次会议审议通过，聘任聂连杰先生担任公司首席信息官，任职日期自 2025 年 11 月 30 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 58,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：无。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：无。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	4	5,640,996,932.55	100.00	1,048,801.83	100.00	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

2. 选择程序如下：

- (1) 基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；
- (2) 基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；

(3) 基金管理人定期对证券公司进行评价, 依据评价结果选择交易单元。

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
兴业证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华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	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 28 日
2	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 21 日
3	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 20 日
4	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 07 月 18 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国泰海通证券股份有限公司认购、申购 (含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 08 月 12 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 08 月 18 日
7	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证	《上海证券报》、基金	2025 年 08 月 28 日

	券投资基金 2025 年中期报告	管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加甬兴证券有限公司为申购赎回代理券商的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 09 月 11 日
9	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 09 月 22 日
10	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 09 月 29 日
11	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 10 月 10 日
12	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 10 月 10 日
13	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 10 月 27 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万和证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 11 月 10 日
15	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 11 月 19 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 11 月 24 日
17	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 11 月 26 日
18	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证	《上海证券报》、基金	2025 年 11 月 26 日

	券投资基金更新的招募说明书 (2025 年第 1 号)	管理人网站及/或中国 证监会基金电子披露网 站	
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下部 分基金增加民生证券股份有限公司 为申购赎回代理券商的公告	《上海证券报》、基金 管理人网站及/或中国 证监会基金电子披露网 站	2025 年 12 月 01 日
20	鹏华基金管理有限公司高级管理人 员变更公告	《上海证券报》、基金 管理人网站及/或中国 证监会基金电子披露网 站	2025 年 12 月 02 日
21	鹏华基金管理有限公司高级管理人 员变更公告	《上海证券报》、基金 管理人网站及/或中国 证监会基金电子披露网 站	2025 年 12 月 02 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下部 分基金增加世纪证券有限责任公司 为申购赎回代理券商的公告	《上海证券报》、基金 管理人网站及/或中国 证监会基金电子披露网 站	2025 年 12 月 05 日
23	鹏华基金管理有限公司关于调整旗 下公募基金风险等级评估方式与标 准相关事项的公告	《上海证券报》、基金 管理人网站及/或中国 证监会基金电子披露网 站	2025 年 12 月 18 日
24	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金 管理人网站及/或中国 证监会基金电子披露网 站	2025 年 12 月 30 日

注：无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者 类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份 额比例达到 或者超过 20% 的时间区间	期初 份额	申购 份额	赎回 份额	持有份额	份额 占比 (%)
机构	1	20250213~20 250310	738,512,6 32.00	313,781 ,436.00	971,165,1 99.00	81,128,869.00	4.58
	2	20250109~20 250114,2025 1021~202512 15,20251224 ~20251225,2	0.00	1,923,3 61,906. 00	1,611,540 ,700.00	311,821,206.0 0	17.60

		0251229~202 51230					
	3	20251230~20 251231	0.00	411,363 ,760.00	25,566,10 0.00	385,797,660.0 0	21.77
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份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告》（原文）。

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2026 年 3 月 30 日