

# 鹏华智投数字经济混合型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
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
<b>§4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
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	14
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
<b>§5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62

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 .....	62
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 .....	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
7.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>63</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	64
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>64</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>65</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	65
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 .....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
10.4 基金投资策略的改变 .....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
10.8 其他重大事件 .....	68
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>69</b>
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 .....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>70</b>
12.1 备查文件目录 .....	70
12.2 存放地点 .....	70
12.3 查阅方式 .....	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华智投数字经济混合	
基金主代码	020086	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 5 月 17 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	15,102,162.83 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	鹏华智投数字经济混合 A	鹏华智投数字经济混合 C
下属分级基金的交 易代码	020086	020087
报告期末下属分级 基金的份额总额	3,274,334.22 份	11,827,828.61 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以数量化投资方法为基础，在有效控制投资组合风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）数字经济主题界定</p> <p>数字经济是指“以使用数字化的知识和信息作为关键生产要素、以现代信息网络作为重要载体、以信息通信技术的有效使用作为效率提升和经济结构优化的重要推动力的一系列经济活动”，参照国家统计局发布的《数字经济及其核心产业统计分类（2021）》，本基金对数字经济的界定如下：</p> <p>1）数字产品制造业，主要包括从事计算机制造、通讯及雷达设备制造、数字媒体设备制造、智能设备制造、电子元器件及设备制造的企业；主要涉及电子行业中的半导体、元器件、光学光电子、消费电子、电子化学品行业，计算机行业中计算机设备行业，机械制造和电力设备行业中的专用设备、通用设备、零部件。</p> <p>2）数字产品服务业，主要包括从事涵盖计算机、软件及辅助设</p>

	<p>备、通讯设备、广播影视设备的数字产品批发、零售、租赁和维修的企业。</p> <p>3) 数字技术应用业，主要指从事软件开发，电信、广播电视和卫星传输服务，互联网相关服务及信息技术服务相关领域的行业；主要涉及计算机行业中的软件开发、计算机应用行业，传媒行业中的游戏、广告营销、影视院线、数字媒体、社交、出版及电视广播行业。</p> <p>4) 数字要素驱动业，主要指从事互联网平台、互联网批发零售、互联网金融、数字内容与媒体、信息基础设施建设、数字资源与产权交易相关领域的行业；主要涉及传媒行业中的互联网传媒行业，通信行业中的通信服务及通信设备行业。</p> <p>5) 数字化效率提升业：主要指被数字技术深度改造升级带来的产出增加和效率提升的传统行业，主要指从事智能农业、智能制造、智能交通、智慧物流、数字金融、数字商贸、数字社会、数字政府相关领域的行业；主要涉及汽车、交通运输、电力设备、公用事业、环保、医药生物、农林牧渔、机械设备、轻工制造、家用电器、建筑装饰、金融和服务于电子、通信、计算机及汽车行业的基础化工、有色金属等行业。</p> <p>如果未来由于技术进步、政策变化及商业模式发展等原因导致本基金数字经济主题相关行业的覆盖范围发生变动，基金管理人在履行适当程序后，可以根据实际情况对数字经济主题的界定进行调整。</p> <p>(2) 量化选股策略</p> <p>本基金将以数字经济主题相关的股票为股票池，并采用多因子选股策略构建股票投资组合。多因子选股策略的信息主要来自于基本面、预期数据、市场交易数据等，每一类信息代表一种选股逻辑。在不同的市场环境下，选股逻辑会有不同的侧重点。基于不同的选股逻辑，构建个股维度的多因子选股策略，包括价值、基本面、市场、成长、预期等，并对因子的有效性进行情景分析和动态监控，筛选出有效因子组合，构建股票资产组合。</p> <p>本基金在股票投资组合构建完成后，将根据个股价格波动、风险收益变化的实际情况，定期或不定期调整个股权重，以确保整个股票组合的风险处于可控范围内。</p> <p>(3) 港股通标的股票投资策略</p> <p>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：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；</li> <li>2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；</li> <li>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。</li> </ol> <p>3、存托凭证投资策略</p> <p>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>4、债券投资策略</p> <p>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、</p>
--	--

	<p>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。</p> <p>本基金可投资可转换债券及可交换债券，可转换债券及可交换债券兼具债权和股权双重属性，本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析综合开展投资决策，以增强本基金的收益。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果。</p> <p>6、资产支持证券的投资策略</p> <p>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。</p> <p>7、参与融资业务策略</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>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。</p>
业绩比较基准	中证数字经济主题指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中债综合财富（总值）指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期收益及预期风险高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	任航
	联系电话	0755-81395402	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4006788999	95599
传真		0755-82021126	010-68121816
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031

法定代表人	张纳沙	谷澍
-------	-----	----

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	鹏华智投数字经济混合 A	鹏华智投数字经济混合 C
本期已实现收益	696,677.82	6,286,105.11
本期利润	750,693.26	6,879,326.76
加权平均基金份 额本期利润	0.2697	0.2661
本期加权平均净 值利润率	18.94%	18.40%
本期基金份额净 值增长率	21.96%	21.61%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	1,860,532.21	6,595,089.25
期末可供分配基 金份额利润	0.5682	0.5576
期末基金资产净 值	5,134,866.43	18,422,917.86
期末基金份额净 值	1.5682	1.5576



3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	56.82%	55.76%

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

鹏华智投数字经济混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	8.29%	1.04%	3.96%	0.89%	4.33%	0.15%
过去三个月	7.81%	2.01%	-0.12%	1.34%	7.93%	0.67%
过去六个月	21.96%	1.86%	2.39%	1.47%	19.57%	0.39%
过去一年	57.73%	2.07%	37.71%	1.86%	20.02%	0.21%
自基金合同生效起至今	56.82%	1.95%	32.56%	1.77%	24.26%	0.18%

鹏华智投数字经济混合 C

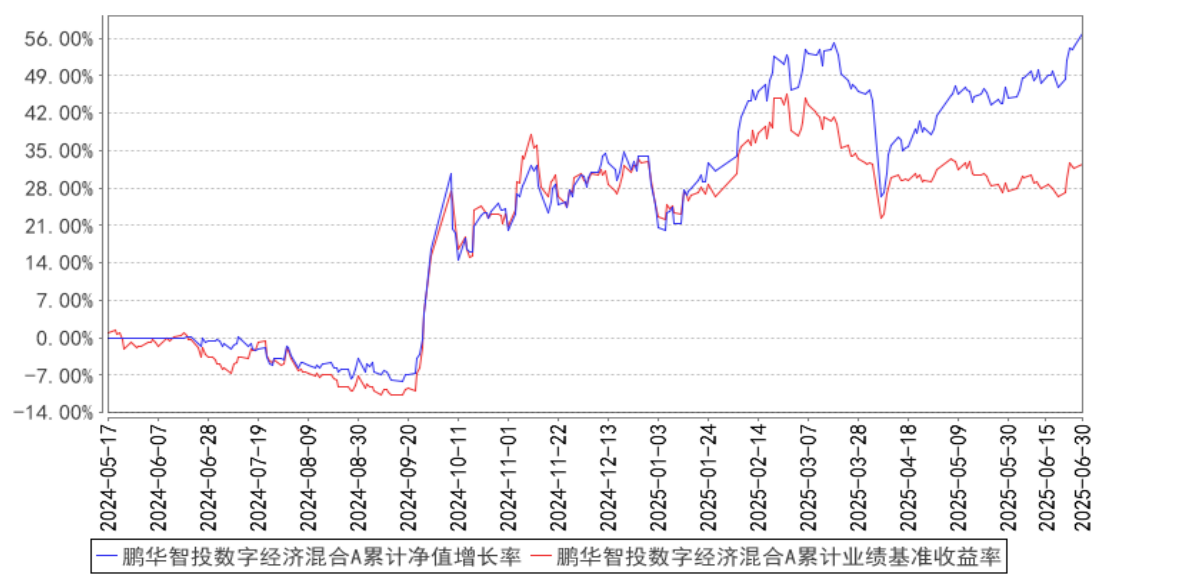
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	8.23%	1.04%	3.96%	0.89%	4.27%	0.15%
过去三个月	7.65%	2.01%	-0.12%	1.34%	7.77%	0.67%
过去六个月	21.61%	1.86%	2.39%	1.47%	19.22%	0.39%
过去一年	56.79%	2.06%	37.71%	1.86%	19.08%	0.20%
自基金合同生效	55.76%	1.95%	32.56%	1.77%	23.20%	0.18%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

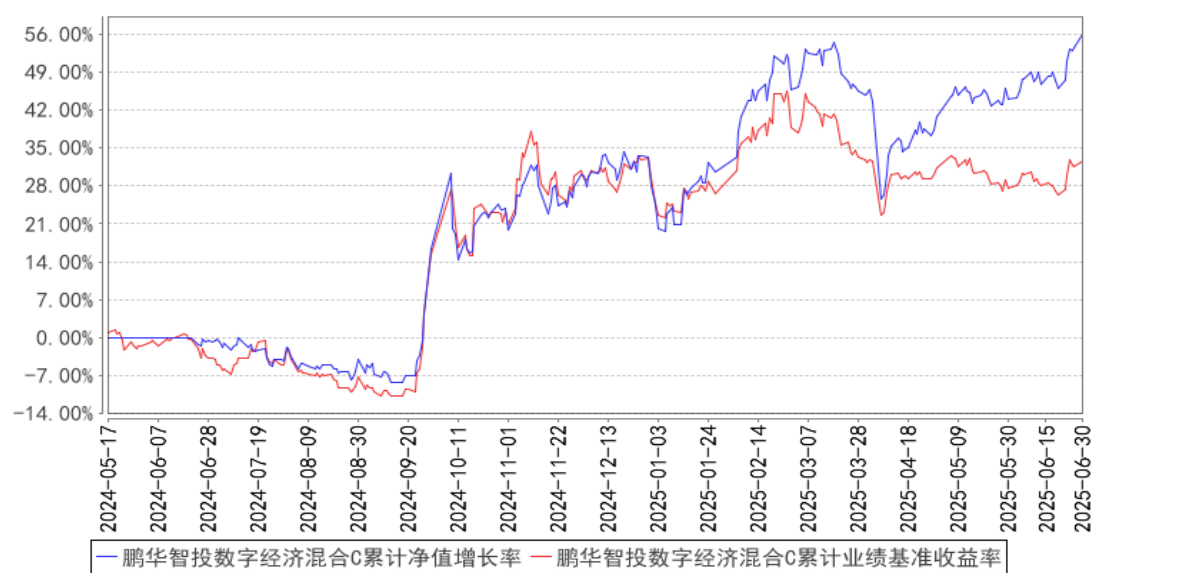
注：业绩比较基准=中证数字经济主题指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中债综合财富（总值）指数收益率×20%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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



注：1、本基金基金合同于 2024 年 05 月 17 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 12,513 亿元，359 只公募基金、12 只全国社保投资组合、8 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏俊杰	本基金的基金经理	2024-05-17	-	13 年	苏俊杰先生，国籍中国，理学硕士，13 年证券从业经验。曾任 MSCI INC. 分析师，华泰柏瑞基金管理有限公司专户投资经理，财通基金管理有限公司基金经理。2019 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部副总经理，现担任指数与量化投资部总经理/基金经理。2021 年 03 月至 2025 年 01 月担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理，2022 年 01 月至今担任鹏华中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 12 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华创业板指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，2023 年 02 月至今担任鹏

					华国证 2000 指数增强型证券投资基金基金经理，2023 年 06 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 08 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2023 年 09 月至 2024 年 10 月担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 09 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理，2024 年 01 月至 2025 年 06 月担任鹏华智投 800 混合型证券投资基金基金经理，2024 年 05 月至今担任鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金经理，2024 年 06 月至今担任鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 02 月至今担任鹏华沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金经理，2025 年 02 月至今担任鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，苏俊杰先生具备基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A 股上半年震荡走高，在经历了年初由 deepseek 带动的春季躁动行情之后，二季度开始市场的主线围绕对等关税和稳增长政策展开。当市场受到对等关税的影响出现了比较剧烈的波动时候，我们仍然坚持认为从中长期来看，关税无碍中国制造业的全球竞争力，A 股当前的配置价值依然很高，包括海外资金在内的增量资金有望持续增配中国权益资产，从而推动市场的持续上行；事后来，A 股在二季度初经历短暂下挫后稳步震荡上行，在过程中市场情绪和赚钱效应也得以逐步修复。

展望下半年，随着风险偏好回暖，国内流动性持续宽松，A 股下半年有望持续迎来增量资金入场，市场或延续结构性机会，我们仍然看好市场空间大、渗透率低的成长类主题投资，包括 AI 硬件及应用、人形机器人、半导体国产化、稳定币、脑机接口等数字经济相关的板块。

投资运作上，上半年本基金相对业绩比较基准超额收益明显，未来我们会继续通过量化模型综合基本面、量价、另类数据因子对数字经济产业链相关标的进行优选，力争取得超额收益。

##### 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 21.96%，同期业绩比较基准增长率为 2.39%；C 类份额净值增长率为 21.61%，同期业绩比较基准增长率为 2.39%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年下半年宏观经济预计仍然面临一系列挑战，一方面，美国对等关税政策对进出口贸易带来极大的不确定性，出口短期可能维持较高增速，但后期受关税上升影响易放缓；另一方面，国内有效需求仍然不足，价格仍然偏弱，需要重点关注政策的支持力度。预计政策会从需求和供给两个维度，双管齐下，通过反内卷出清行业过剩产能，提振价格，实现行业高质量发展，同时

在需求端继续加力各类政策补贴、基建等。

市场走势上，在政策共识、盈利回升和资金回流共振驱动下，A 股可能在 2025 年下半年迎来真正行情拐点。美联储降息预期不断增强，全球流动性共振宽松，叠加中美关系缓和，将吸引外资回流；赚钱效应的改善，将推动股市作为居民资产配置的新蓄水池；此外机构的中长期配置资金也会继续有序的进入到市场中来。随着市场成熟度提升，未来市场的波动率有望实现系统性的降低，A 股市场可能会进入真正意义上的慢牛，长牛。

#### 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，鹏华智投数字经济混合 A 期末可供分配利润为 1,860,532.21 元，期末基金份额净值 1.5682 元；鹏华智投数字经济混合 C 期末可供分配利润为 6,595,089.25 元，期末基金份额净值 1.5576 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2025 年 03 月 14 日至 2025 年 05 月 09 日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

本基金自 2024 年 12 月 26 日至 2025 年 02 月 13 日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——鹏华基金管理有限公司 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华智投数字经济混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,532,521.30	12,365,253.09
结算备付金		419,612.07	305,478.82
存出保证金		52,407.87	44,523.88

交易性金融资产	6.4.7.2	20,865,388.90	17,176,729.72
其中：股票投资		20,865,388.90	17,176,729.72
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		528,756.50	12,367,352.14
应收股利		-	-
应收申购款		269,035.85	76,365.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		25,667,722.49	42,335,703.00
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,908,574.28	23,695,400.60
应付管理人报酬		48,377.37	56,012.40
应付托管费		8,062.90	9,335.39
应付销售服务费		22,257.40	26,014.53
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	122,666.25	104,812.50
负债合计		2,109,938.20	23,891,575.42
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	15,102,162.83	14,388,682.50
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	8,455,621.46	4,055,445.08
净资产合计		23,557,784.29	18,444,127.58



负债和净资产总计		25,667,722.49	42,335,703.00
----------	--	---------------	---------------

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额为 15,102,162.83 份，其中鹏华智投数字经济混合 A 基金份额总额为 3,274,334.22 份，基金份额净值 1.5682 元；鹏华智投数字经济混合 C 基金份额总额为 11,827,828.61 份，基金份额净值 1.5576 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华智投数字经济混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 5 月 17 日（基 金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		8,068,997.79	-87,848.59
1. 利息收入		12,371.44	193,213.61
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,371.44	193,213.61
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）		7,166,563.91	31,414.95
其中：股票投资收益	6.4.7.14	6,778,745.08	-16,685.85
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	387,818.83	48,100.80
以摊余成本计量 的金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-” 号填列）	6.4.7.20	647,237.09	-431,657.10
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	242,825.35	119,179.95

减：二、营业总支出		438,977.77	417,688.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	236,077.67	262,625.47
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	39,346.28	43,770.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	106,263.51	101,164.77
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	57,290.31	10,127.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,630,020.02	-505,537.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,630,020.02	-505,537.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,630,020.02	-505,537.35

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华智投数字经济混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	14,388,682.50	-	4,055,445.08	18,444,127.58
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	14,388,682.50	-	4,055,445.08	18,444,127.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	713,480.33	-	4,400,176.38	5,113,656.71
（一）、综合收益总额	-	-	7,630,020.02	7,630,020.02
（二）、本期基金	713,480.33	-	-3,229,843.64	-2,516,363.31

份额交易产生的 净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	89,407,801.16	-	39,650,229.71	129,058,030.87
2. 基金赎 回款	-88,694,320.83	-	-42,880,073.35	-131,574,394.18
(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	15,102,162.83	-	8,455,621.46	23,557,784.29
项目	上年度可比期间 2024 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产	-	-	-	-
加：会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产	226,463,076.83	-	-	226,463,076.83
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	- 175,417,706.88	-	-320,887.21	-175,738,594.09
(一)、综合收益 总额	-	-	-505,537.35	-505,537.35
(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)	- 175,417,706.88	-	184,650.14	-175,233,056.74
其中：1. 基金申 购款	11,258.02	-	-15.04	11,242.98

2. 基金赎回款	- 175,428,964.90	-	184,665.18	-175,244,299.72
(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	51,045,369.95	-	-320,887.21	50,724,482.74

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：

<u>邓召明</u>	<u>聂连杰</u>	<u>郝文高</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华智投数字经济混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]2469 号《关于准予鹏华智投数字经济混合型证券投资基金注册的批复》准予，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 226,286,858.38 元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(24)第 00079 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金合同》于 2024 年 5 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 226,463,076.83 份基金份额，其中认购资金利息折合 176,218.45 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳

增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	3,532,521.30
等于：本金	3,531,957.03
加：应计利息	564.27
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	3,532,521.30

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		19,819,911.39	-	20,865,388.90	1,045,477.51
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		19,819,911.39	-	20,865,388.90	1,045,477.51

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.45
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	68,115.83
其中：交易所市场	68,115.83
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	54,547.97
合计	122,666.25



6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,053,224.97	3,053,224.97
本期申购	2,499,505.45	2,499,505.45
本期赎回（以“-”号填列）	-2,278,396.20	-2,278,396.20
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,274,334.22	3,274,334.22

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,335,457.53	11,335,457.53
本期申购	86,908,295.71	86,908,295.71
本期赎回（以“-”号填列）	-86,415,924.63	-86,415,924.63
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	11,827,828.61	11,827,828.61

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

鹏华智投数字经济混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,106,560.52	-1,234,086.67	872,473.85
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,106,560.52	-1,234,086.67	872,473.85
本期利润	696,677.82	54,015.44	750,693.26
本期基金份额交易产生的变动数	246,210.08	-8,844.98	237,365.10
其中：基金申购款	1,998,687.86	-801,885.32	1,196,802.54

基金赎回款	-1,752,477.78	793,040.34	-959,437.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,049,448.42	-1,188,916.21	1,860,532.21

鹏华智投数字经济混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,752,096.99	-4,569,125.76	3,182,971.23
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	7,752,096.99	-4,569,125.76	3,182,971.23
本期利润	6,286,105.11	593,221.65	6,879,326.76
本期基金份额交易产生的变动数	-3,159,323.79	-307,884.95	-3,467,208.74
其中：基金申购款	65,716,897.82	-27,263,470.65	38,453,427.17
基金赎回款	-68,876,221.61	26,955,585.70	-41,920,635.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,878,878.31	-4,283,789.06	6,595,089.25

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,892.71
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	374.09
其他	104.64
合计	12,371.44

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,778,745.08
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	6,778,745.08

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	157,558,560.80
减：卖出股票成本总额	150,540,778.61
减：交易费用	239,037.11
买卖股票差价收入	6,778,745.08

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	387,818.83
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	387,818.83

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	647,237.09
股票投资	647,237.09
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	647,237.09

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

基金赎回费收入	121,700.34
基金转换费收入	121,125.01
合计	242,825.35

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费用	2,735.07
存托服务费	7.27
合计	57,290.31

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 5 月 17 日（基金 合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	236,077.67	262,625.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	110,638.42	123,951.57
应支付基金管理人的净管理费	125,439.25	138,673.90

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 5 月 17 日（基金 合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	39,346.28	43,770.89

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

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		
	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		
	鹏华智投数字经济混合 A	鹏华智投数字经济混合 C	合计
国信证券	-	255.95	255.95
鹏华基金公司	-	1,487.39	1,487.39
中国农业银行	-	3,414.92	3,414.92
合计	-	5,158.26	5,158.26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华智投数字经济混合 A	鹏华智投数字经济混合 C	合计
鹏华基金公司	-	662.67	662.67
中国农业银行	-	41,231.61	41,231.61
合计	-	41,894.28	41,894.28

注：鹏华智投数字经济混合 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华智投数字经济混合 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.6%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.6%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年5月17日（基金合同生效日）至 2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3, 532, 521. 30	11, 892. 71	32, 012, 469. 07	84, 868. 24

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（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	900	25,607.65	34,245.00	-

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，包括境内依法发行或上市交易的股票（包含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

#### 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农业银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，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 2025 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金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上市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 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,532,521.30	-	-	-	3,532,521.30
结算备付金	419,612.07	-	-	-	419,612.07
存出保证金	52,407.87	-	-	-	52,407.87
交易性金融资产	-	-	-	20,865,388.90	20,865,388.90
应收申购款	-	-	-	269,035.85	269,035.85
应收清算款	-	-	-	528,756.50	528,756.50

资产总计	4,004,541.24	-	-	21,663,181.25	25,667,722.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,908,574.28	1,908,574.28
应付管理人报酬	-	-	-	48,377.37	48,377.37
应付托管费	-	-	-	8,062.90	8,062.90
应付销售服务费	-	-	-	22,257.40	22,257.40
其他负债	-	-	-	122,666.25	122,666.25
负债总计	-	-	-	2,109,938.20	2,109,938.20
利率敏感度缺口	4,004,541.24	-	-	19,553,243.05	23,557,784.29
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	12,365,253.09	-	-	-	12,365,253.09
结算备付金	305,478.82	-	-	-	305,478.82
存出保证金	44,523.88	-	-	-	44,523.88
交易性金融资产	-	-	-	17,176,729.72	17,176,729.72
应收申购款	-	-	-	76,365.35	76,365.35
应收清算款	-	-	-	12,367,352.14	12,367,352.14
资产总计	12,715,255.79	-	-	29,620,447.21	42,335,703.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	23,695,400.60	23,695,400.60
应付管理人报酬	-	-	-	56,012.40	56,012.40
应付托管费	-	-	-	9,335.39	9,335.39
应付销售服务费	-	-	-	26,014.53	26,014.53
其他负债	-	-	-	104,812.50	104,812.50
负债总计	-	-	-	23,891,575.42	23,891,575.42
利率敏感度缺口	12,715,255.79	-	-	5,728,871.79	18,444,127.58

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 60%-95%（其中，投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%），投资于本基金界定的数字经济主题相关股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	20,865,388.90	88.57	17,176,729.72	93.13
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	20,865,388.90	88.57	17,176,729.72	93.13

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	比较基准上涨 5%资产净值变动	1,505,695.78	－
	比较基准下降 5%资产净值变动	-1,505,695.78	－

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。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日
第一层次	20,831,143.90
第二层次	34,245.00
第三层次	—
合计	20,865,388.90

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

<p>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。</p> <p>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。</p>
--

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

<p>无。</p>
-----------

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

<p>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。</p>
--

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

<p>无。</p>
-----------

§ 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	20,865,388.90	81.29
	其中：股票	20,865,388.90	81.29
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	3,952,133.37	15.40
8	其他各项资产	850,200.22	3.31
9	合计	25,667,722.49	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：118,340.00 元，占净值比 0.50%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

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	-	-
C	制造业	13,390,693.97	56.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,124.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	535,137.00	2.27
G	交通运输、仓储和邮政业	191,580.00	0.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,522,945.15	23.44
J	金融业	193,198.00	0.82
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	475,625.00	2.02
M	科学研究和技术服务业	143,146.58	0.61
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	52,150.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	358,789.20	1.52
S	综合	-	-
	合计	20,865,388.90	88.57

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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	600998	九州通	54,400	279,616.00	1.19
2	688608	恒玄科技	600	208,788.00	0.89
3	000333	美的集团	2,800	202,160.00	0.86
4	688668	鼎通科技	2,836	177,136.56	0.75
5	301270	汉仪股份	3,400	162,044.00	0.69
6	603444	吉比特	500	150,975.00	0.64
7	600104	上汽集团	9,200	147,660.00	0.63
8	300030	阳普医疗	21,100	144,957.00	0.62
9	688015	交控科技	6,874	143,254.16	0.61
10	688162	巨一科技	5,222	142,247.28	0.60
11	688220	翱捷科技-U	1,800	140,940.00	0.60
12	688509	正元地信	32,602	139,862.58	0.59
13	300246	宝莱特	17,500	139,825.00	0.59
14	600986	浙文互联	17,100	139,707.00	0.59
15	002367	康力电梯	19,700	138,491.00	0.59
16	688328	深科达	6,108	138,346.20	0.59
17	301171	易点天下	5,100	136,323.00	0.58
18	300687	赛意信息	4,800	133,344.00	0.57
19	000404	长虹华意	18,500	131,350.00	0.56
20	688031	星环科技-U	2,800	130,564.00	0.55
21	300018	中元股份	16,400	130,380.00	0.55
22	300259	新天科技	36,700	130,285.00	0.55
23	002803	吉宏股份	9,100	129,766.00	0.55
24	688114	华大智造	2,000	129,660.00	0.55
25	603236	移远通信	1,500	128,700.00	0.55
26	002624	完美世界	8,000	121,360.00	0.52
27	688258	卓易信息	2,500	121,075.00	0.51
28	301221	光庭信息	2,300	119,531.00	0.51
29	300652	雷迪克	2,010	118,368.90	0.50
30	689009	九号公司-WD	2,000	118,340.00	0.50
31	300206	理邦仪器	9,800	117,796.00	0.50
32	300358	楚天科技	14,900	116,220.00	0.49
33	603766	隆鑫通用	9,100	116,116.00	0.49
34	688039	当虹科技	3,500	114,870.00	0.49
35	688111	金山办公	400	112,020.00	0.48
36	002841	视源股份	3,200	110,720.00	0.47
37	002010	传化智联	19,800	110,484.00	0.47
38	300662	科锐国际	3,700	109,927.00	0.47
39	002414	高德红外	10,600	108,650.00	0.46

40	688029	南微医学	1,600	108,080.00	0.46
41	301195	北路智控	3,000	107,400.00	0.46
42	300271	华宇软件	12,800	104,448.00	0.44
43	601766	中国中车	14,800	104,192.00	0.44
44	688128	中国电研	4,236	103,782.00	0.44
45	603380	易德龙	3,900	103,740.00	0.44
46	300454	深信服	1,100	103,598.00	0.44
47	002174	游族网络	8,500	103,105.00	0.44
48	603466	风语筑	10,200	102,918.00	0.44
49	688579	山大地纬	9,197	102,914.43	0.44
50	688286	敏芯股份	1,429	101,016.01	0.43
51	600690	海尔智家	4,000	99,120.00	0.42
52	300486	东杰智能	11,800	97,586.00	0.41
53	600745	闻泰科技	2,900	97,237.00	0.41
54	600055	万东医疗	5,500	95,040.00	0.40
55	301039	中集车辆	11,600	94,308.00	0.40
56	688508	芯朋微	1,688	94,224.16	0.40
57	688768	容知日新	2,100	93,219.00	0.40
58	300807	天迈科技	2,300	93,104.00	0.40
59	300562	乐心医疗	6,300	92,925.00	0.39
60	300400	劲拓股份	5,500	92,620.00	0.39
61	300627	华测导航	2,600	91,000.00	0.39
62	300279	和晶科技	13,100	90,783.00	0.39
63	300232	洲明科技	12,500	90,500.00	0.38
64	002668	TCL 智家	9,200	89,884.00	0.38
65	688400	凌云光	3,242	89,381.94	0.38
66	301002	崧盛股份	4,000	88,440.00	0.38
67	688079	美迪凯	8,760	87,950.40	0.37
68	002468	申通快递	8,200	87,658.00	0.37
69	301031	中熔电气	1,096	87,296.40	0.37
70	300048	合康新能	14,500	85,115.00	0.36
71	688168	安博通	1,200	85,044.00	0.36
72	688118	普元信息	3,800	84,930.00	0.36
73	688396	华润微	1,800	84,888.00	0.36
74	001266	宏英智能	3,200	84,640.00	0.36
75	688358	祥生医疗	2,800	83,020.00	0.35
76	002352	顺丰控股	1,700	82,892.00	0.35
77	603028	赛福天	11,200	82,096.00	0.35
78	600699	均胜电子	4,700	81,968.00	0.35
79	688778	厦钨新能	1,465	81,922.80	0.35
80	603189	网达软件	4,700	81,639.00	0.35
81	300496	中科创达	1,400	80,108.00	0.34
82	000050	深天马 A	9,400	80,088.00	0.34

83	300978	东箭科技	7,100	79,236.00	0.34
84	600288	大恒科技	7,700	79,156.00	0.34
85	600741	华域汽车	4,400	77,660.00	0.33
86	603171	税友股份	1,800	77,238.00	0.33
87	688588	凌志软件	5,292	77,104.44	0.33
88	688271	联影医疗	600	76,644.00	0.33
89	688590	新致软件	3,730	76,614.20	0.33
90	603990	麦迪科技	4,700	76,375.00	0.32
91	301338	凯格精机	1,600	76,336.00	0.32
92	002373	千方科技	8,200	76,260.00	0.32
93	300433	蓝思科技	3,400	75,820.00	0.32
94	300750	宁德时代	300	75,666.00	0.32
95	688093	世华科技	2,419	75,109.95	0.32
96	300113	顺网科技	3,800	75,088.00	0.32
97	300768	迪普科技	4,300	73,745.00	0.31
98	002380	科远智慧	3,000	73,350.00	0.31
99	601998	中信银行	8,600	73,100.00	0.31
100	301112	信邦智能	2,000	72,600.00	0.31
101	000725	京东方 A	18,100	72,219.00	0.31
102	600582	天地科技	12,000	71,880.00	0.31
103	688213	思特威-W	700	71,554.00	0.30
104	688326	经纬恒润-W	800	71,392.00	0.30
105	688070	纵横股份	1,476	71,290.80	0.30
106	600728	佳都科技	13,000	70,850.00	0.30
107	001283	豪鹏科技	1,300	70,785.00	0.30
108	002138	顺络电子	2,500	70,300.00	0.30
109	688082	盛美上海	600	68,364.00	0.29
110	688020	方邦股份	1,803	68,279.61	0.29
111	600415	小商品城	3,300	68,244.00	0.29
112	688095	福昕软件	1,000	67,910.00	0.29
113	688696	极米科技	592	67,701.12	0.29
114	002913	奥士康	2,300	67,643.00	0.29
115	002121	科陆电子	13,500	67,500.00	0.29
116	002396	星网锐捷	2,992	67,170.40	0.29
117	600480	凌云股份	5,510	67,056.70	0.28
118	002594	比亚迪	200	66,382.00	0.28
119	688001	华兴源创	2,600	65,702.00	0.28
120	688025	杰普特	900	64,350.00	0.27
121	002315	焦点科技	1,400	63,966.00	0.27
122	688330	宏力达	2,441	62,684.88	0.27
123	601799	星宇股份	500	62,500.00	0.27
124	301380	挖金客	1,700	62,356.00	0.26
125	603308	应流股份	2,700	62,316.00	0.26

126	688201	信安世纪	4,800	62,160.00	0.26
127	301185	鸥玛软件	3,173	62,095.61	0.26
128	603700	宁水集团	5,100	61,098.00	0.26
129	601900	南方传媒	3,900	60,996.00	0.26
130	688273	麦澜德	2,000	60,420.00	0.26
131	600183	生益科技	2,000	60,300.00	0.26
132	603660	苏州科达	8,300	60,009.00	0.25
133	600482	中国动力	2,600	59,982.00	0.25
134	688277	天智航-U	4,300	59,770.00	0.25
135	688661	和林微纳	1,480	58,859.60	0.25
136	002284	亚太股份	5,300	58,565.00	0.25
137	603611	诺力股份	2,700	58,158.00	0.25
138	688518	联赢激光	2,845	58,009.55	0.25
139	000157	中联重科	8,000	57,840.00	0.25
140	002405	四维图新	6,700	57,218.00	0.24
141	300866	安克创新	500	56,800.00	0.24
142	688035	德邦科技	1,392	56,543.04	0.24
143	002097	山河智能	6,800	56,236.00	0.24
144	002957	科瑞技术	3,400	55,896.00	0.24
145	002050	三花智控	2,100	55,398.00	0.24
146	002970	锐明技术	1,100	54,340.00	0.23
147	688636	智明达	1,600	54,064.00	0.23
148	688557	兰剑智能	1,800	53,874.00	0.23
149	002139	拓邦股份	3,900	53,859.00	0.23
150	300369	绿盟科技	6,900	53,613.00	0.23
151	601717	郑煤机	3,200	53,184.00	0.23
152	300222	科大智能	5,200	52,988.00	0.22
153	688002	睿创微纳	756	52,708.32	0.22
154	002410	广联达	3,900	52,299.00	0.22
155	300244	迪安诊断	3,500	52,150.00	0.22
156	002517	恺英网络	2,700	52,137.00	0.22
157	002090	金智科技	5,400	51,732.00	0.22
158	300682	朗新集团	2,200	51,700.00	0.22
159	688023	安恒信息	909	51,576.66	0.22
160	300078	思创医惠	13,000	50,570.00	0.21
161	000776	广发证券	3,000	50,430.00	0.21
162	688772	珠海冠宇	3,524	50,357.96	0.21
163	688173	希荻微	3,600	49,176.00	0.21
164	002384	东山精密	1,300	49,101.00	0.21
165	300324	旋极信息	11,200	48,720.00	0.21
166	002402	和而泰	2,100	48,657.00	0.21
167	002579	中京电子	3,200	48,480.00	0.21
168	688049	炬芯科技	800	48,400.00	0.21

169	300226	上海钢联	2,100	47,964.00	0.20
170	600869	远东股份	9,400	47,752.00	0.20
171	002008	大族激光	1,900	46,303.00	0.20
172	300812	易天股份	2,000	46,220.00	0.20
173	300017	网宿科技	4,300	46,096.00	0.20
174	000719	中原传媒	3,700	45,917.00	0.19
175	002906	华阳集团	1,400	45,514.00	0.19
176	603118	共进股份	4,000	45,080.00	0.19
177	001380	华纬科技	2,200	45,056.00	0.19
178	300322	硕贝德	3,000	44,850.00	0.19
179	688208	道通科技	1,464	44,798.40	0.19
180	603039	泛微网络	800	44,560.00	0.19
181	688343	云天励飞-U	900	44,478.00	0.19
182	002371	北方华创	100	44,221.00	0.19
183	300371	汇中股份	3,800	44,080.00	0.19
184	301312	智立方	1,100	43,670.00	0.19
185	002472	双环传动	1,300	43,537.00	0.18
186	002036	联创电子	4,000	43,240.00	0.18
187	601615	明阳智能	3,700	42,513.00	0.18
188	000338	潍柴动力	2,700	41,526.00	0.18
189	300579	数字认证	1,200	41,412.00	0.18
190	688097	博众精工	1,482	41,362.62	0.18
191	002025	航天电器	800	41,128.00	0.17
192	603486	科沃斯	700	40,761.00	0.17
193	002556	辉隆股份	6,800	40,460.00	0.17
194	300605	恒锋信息	2,700	40,284.00	0.17
195	688088	虹软科技	832	40,144.00	0.17
196	300990	同飞股份	800	39,920.00	0.17
197	600487	亨通光电	2,600	39,780.00	0.17
198	601608	中信重工	9,100	39,767.00	0.17
199	300565	科信技术	3,100	39,308.00	0.17
200	300987	川网传媒	2,000	38,640.00	0.16
201	688312	燕麦科技	1,600	38,448.00	0.16
202	688365	光云科技	2,517	38,308.74	0.16
203	603788	宁波高发	2,400	38,088.00	0.16
204	688099	晶晨股份	536	38,061.36	0.16
205	300550	和仁科技	2,800	38,052.00	0.16
206	600366	宁波韵升	3,500	38,010.00	0.16
207	600391	航发科技	1,300	37,960.00	0.16
208	000988	华工科技	800	37,608.00	0.16
209	002111	威海广泰	3,500	37,555.00	0.16
210	688499	利元亨	900	37,449.00	0.16
211	601728	中国电信	4,800	37,200.00	0.16

212	002959	小熊电器	800	37,152.00	0.16
213	300666	江丰电子	500	37,050.00	0.16
214	301231	荣信文化	1,600	37,040.00	0.16
215	603596	伯特利	700	36,883.00	0.16
216	300604	长川科技	800	35,928.00	0.15
217	688777	中控技术	800	35,928.00	0.15
218	688552	航天南湖	900	35,919.00	0.15
219	688322	奥比中光-UW	600	35,406.00	0.15
220	300514	友讯达	2,500	35,200.00	0.15
221	603197	保隆科技	900	35,163.00	0.15
222	002400	省广集团	4,600	35,144.00	0.15
223	688191	智洋创新	1,474	35,051.72	0.15
224	688313	仕佳光子	900	34,245.00	0.15
225	000156	华数传媒	4,300	34,142.00	0.14
226	605365	立达信	2,300	33,879.00	0.14
227	601318	中国平安	600	33,288.00	0.14
228	002993	奥海科技	800	33,176.00	0.14
229	688327	云从科技-UW	2,400	33,096.00	0.14
230	000636	风华高科	2,400	32,976.00	0.14
231	688522	纳睿雷达	640	32,780.80	0.14
232	300925	法本信息	1,300	32,734.00	0.14
233	000821	京山轻机	2,800	32,452.00	0.14
234	603203	快克智能	1,300	32,331.00	0.14
235	300296	利亚德	5,300	32,330.00	0.14
236	300133	华策影视	4,300	32,293.00	0.14
237	300788	中信出版	1,000	32,080.00	0.14
238	603329	上海雅仕	2,840	31,950.00	0.14
239	688369	致远互联	1,200	31,668.00	0.13
240	600180	瑞茂通	7,100	31,524.00	0.13
241	000901	航天科技	2,500	31,075.00	0.13
242	600885	宏发股份	1,380	30,787.80	0.13
243	688229	博睿数据	600	30,570.00	0.13
244	688080	映翰通	600	30,534.00	0.13
245	600050	中国联通	5,700	30,438.00	0.13
246	603893	瑞芯微	200	30,372.00	0.13
247	300299	富春股份	3,900	29,952.00	0.13
248	300432	富临精工	2,280	29,799.60	0.13
249	601555	东吴证券	3,400	29,750.00	0.13
250	603656	泰禾智能	1,600	29,520.00	0.13
251	688141	杰华特	900	29,322.00	0.12
252	688200	华峰测控	200	28,840.00	0.12
253	688591	泰凌微	600	28,740.00	0.12
254	300882	万胜智能	1,600	28,704.00	0.12

255	688100	威胜信息	770	28,528.50	0.12
256	002558	巨人网络	1,200	28,260.00	0.12
257	688158	优刻得-W	1,241	28,071.42	0.12
258	688139	海尔生物	900	27,801.00	0.12
259	300150	世纪瑞尔	5,500	27,610.00	0.12
260	688798	艾为电子	400	27,280.00	0.12
261	300578	会畅通讯	1,300	27,261.00	0.12
262	601777	千里科技	3,200	27,168.00	0.12
263	688232	新点软件	900	27,036.00	0.11
264	002916	深南电路	250	26,952.50	0.11
265	688009	中国通号	5,181	26,630.34	0.11
266	301018	申菱环境	700	26,558.00	0.11
267	603855	华荣股份	1,200	26,556.00	0.11
268	002017	东信和平	1,430	26,354.90	0.11
269	688252	天德钰	1,078	26,281.64	0.11
270	300531	优博讯	1,100	26,059.00	0.11
271	601126	四方股份	1,600	26,032.00	0.11
272	002241	歌尔股份	1,100	25,652.00	0.11
273	300771	智莱科技	2,000	25,460.00	0.11
274	603901	永创智能	2,400	25,296.00	0.11
275	300365	恒华科技	3,800	25,042.00	0.11
276	002706	良信股份	2,800	24,948.00	0.11
277	688239	航宇科技	710	24,835.80	0.11
278	301389	隆扬电子	1,000	24,620.00	0.10
279	300515	三德科技	1,100	24,585.00	0.10
280	603533	掌阅科技	1,100	24,541.00	0.10
281	002212	天融信	3,000	23,100.00	0.10
282	600131	国网信通	1,300	23,010.00	0.10
283	688611	杭州柯林	700	22,841.00	0.10
284	000997	新大陆	700	22,666.00	0.10
285	600718	东软集团	2,300	22,425.00	0.10
286	603109	神驰机电	800	22,352.00	0.09
287	600826	兰生股份	2,700	22,140.00	0.09
288	600563	法拉电子	201	21,927.09	0.09
289	688420	美腾科技	900	21,456.00	0.09
290	600835	上海机电	1,000	21,250.00	0.09
291	603383	顶点软件	500	21,200.00	0.09
292	301025	读客文化	1,900	20,900.00	0.09
293	300623	捷捷微电	700	20,860.00	0.09
294	688290	景业智能	400	20,848.00	0.09
295	688362	甬矽电子	700	20,846.00	0.09
296	002023	海特高新	1,900	20,558.00	0.09
297	002975	博杰股份	600	20,508.00	0.09



298	688183	生益电子	400	20,480.00	0.09
299	300360	炬华科技	1,300	20,475.00	0.09
300	688561	奇安信-U	600	20,388.00	0.09
301	300770	新媒股份	500	19,995.00	0.08
302	300552	万集科技	700	19,488.00	0.08
303	300001	特锐德	800	19,176.00	0.08
304	605376	博迁新材	500	19,165.00	0.08
305	002368	太极股份	800	18,736.00	0.08
306	688620	安凯微	1,484	18,564.84	0.08
307	603679	华体科技	1,300	18,486.00	0.08
308	688244	永信至诚	700	18,424.00	0.08
309	002432	九安医疗	500	18,215.00	0.08
310	002587	奥拓电子	2,800	18,060.00	0.08
311	002362	汉王科技	800	17,936.00	0.08
312	600637	东方明珠	2,400	17,928.00	0.08
313	300145	南方泵业	5,100	17,850.00	0.08
314	300249	依米康	1,300	17,732.00	0.08
315	002837	英维克	590	17,528.90	0.07
316	688360	德马科技	940	17,437.00	0.07
317	002649	博彦科技	1,200	17,436.00	0.07
318	688288	鸿泉物联	600	17,406.00	0.07
319	300951	博硕科技	500	17,150.00	0.07
320	300183	东软载波	1,000	16,810.00	0.07
321	600570	恒生电子	500	16,770.00	0.07
322	688685	迈信林	300	16,755.00	0.07
323	600100	同方股份	2,300	16,652.00	0.07
324	301162	国能日新	320	16,537.60	0.07
325	002434	万里扬	2,200	16,126.00	0.07
326	002331	皖通科技	2,000	16,100.00	0.07
327	601607	上海医药	900	16,092.00	0.07
328	300252	金信诺	1,400	16,072.00	0.07
329	300177	中海达	1,400	16,044.00	0.07
330	000100	TCL 科技	3,700	16,021.00	0.07
331	603915	国茂股份	1,100	15,994.00	0.07
332	002273	水晶光电	800	15,976.00	0.07
333	001308	康冠科技	700	15,834.00	0.07
334	301078	孩子王	1,200	15,684.00	0.07
335	300424	航新科技	900	15,588.00	0.07
336	000829	天音控股	1,500	15,315.00	0.07
337	000521	长虹美菱	2,200	15,268.00	0.06
338	002161	远望谷	2,300	15,180.00	0.06
339	688292	浩瀚深度	771	14,834.04	0.06
340	600523	贵航股份	1,000	14,790.00	0.06

341	301052	果麦文化	359	14,647.20	0.06
342	002268	电科网安	800	14,632.00	0.06
343	300638	广和通	500	14,315.00	0.06
344	300079	数码视讯	2,400	14,040.00	0.06
345	002555	三七互娱	800	13,832.00	0.06
346	688207	格灵深瞳	900	13,590.00	0.06
347	301129	瑞纳智能	500	13,580.00	0.06
348	603232	格尔软件	800	13,560.00	0.06
349	301339	通行宝	780	13,361.40	0.06
350	600640	国脉文化	1,100	13,332.00	0.06
351	300870	欧陆通	100	12,650.00	0.05
352	600410	华胜天成	1,300	12,467.00	0.05
353	002073	软控股份	1,400	12,446.00	0.05
354	600066	宇通客车	500	12,430.00	0.05
355	603128	华贸物流	2,000	12,400.00	0.05
356	605196	华通线缆	700	12,327.00	0.05
357	000550	江铃汽车	600	12,198.00	0.05
358	300007	汉威科技	300	12,180.00	0.05
359	600850	电科数字	500	12,095.00	0.05
360	600592	龙溪股份	500	12,075.00	0.05
361	301536	星辰科技	200	12,060.00	0.05
362	000913	钱江摩托	800	12,000.00	0.05
363	600060	海信视像	500	11,510.00	0.05
364	300440	运达科技	1,100	11,495.00	0.05
365	002845	同兴达	800	11,440.00	0.05
366	601222	林洋能源	2,000	11,400.00	0.05
367	600057	厦门象屿	1,600	11,248.00	0.05
368	600633	浙数文化	800	11,072.00	0.05
369	301165	锐捷网络	180	11,062.80	0.05
370	688433	华曙高科	300	11,025.00	0.05
371	300061	旗天科技	800	11,000.00	0.05
372	002484	江海股份	500	10,245.00	0.04
373	000977	浪潮信息	200	10,176.00	0.04
374	603063	禾望电气	300	10,158.00	0.04
375	301110	青木科技	180	10,078.20	0.04
376	300533	冰川网络	300	10,023.00	0.04
377	002281	光迅科技	200	9,864.00	0.04
378	002583	海能达	800	9,848.00	0.04
379	001339	智微智能	200	9,666.00	0.04
380	603106	恒银科技	900	9,540.00	0.04
381	001314	亿道信息	200	9,450.00	0.04
382	300620	光库科技	200	9,422.00	0.04
383	300674	宇信科技	300	9,087.00	0.04

384	300101	振芯科技	400	9,052.00	0.04
385	300458	全志科技	220	8,731.80	0.04
386	300413	芒果超媒	400	8,728.00	0.04
387	002463	沪电股份	200	8,516.00	0.04
388	300964	本川智能	200	8,346.00	0.04
389	301169	零点有数	200	8,296.00	0.04
390	605333	沪光股份	300	8,235.00	0.03
391	300634	彩讯股份	300	8,130.00	0.03
392	300563	神宇股份	200	8,112.00	0.03
393	600418	江淮汽车	200	8,018.00	0.03
394	601949	中国出版	1,200	7,968.00	0.03
395	300077	国民技术	300	7,680.00	0.03
396	301321	翰博高新	500	7,645.00	0.03
397	600316	洪都航空	200	7,540.00	0.03
398	603583	捷昌驱动	200	7,304.00	0.03
399	300397	天和防务	500	7,255.00	0.03
400	603516	淳中科技	200	7,180.00	0.03
401	300546	雄帝科技	200	7,172.00	0.03
402	301128	强瑞技术	140	7,114.80	0.03
403	603613	国联股份	300	7,107.00	0.03
404	603160	汇顶科技	100	7,103.00	0.03
405	003019	宸展光电	200	7,006.00	0.03
406	300628	亿联网络	200	6,952.00	0.03
407	301138	华研精机	200	6,942.00	0.03
408	300872	天阳科技	300	6,918.00	0.03
409	603068	博通集成	200	6,900.00	0.03
410	002600	领益智造	800	6,872.00	0.03
411	300557	理工光科	250	6,750.00	0.03
412	600584	长电科技	200	6,738.00	0.03
413	000547	航天发展	800	6,720.00	0.03
414	002065	东华软件	700	6,720.00	0.03
415	300548	长芯博创	100	6,677.00	0.03
416	600517	国网英大	1,300	6,630.00	0.03
417	600556	天下秀	1,300	6,630.00	0.03
418	002938	鹏鼎控股	200	6,406.00	0.03
419	603015	弘讯科技	500	6,355.00	0.03
420	000503	国新健康	600	6,342.00	0.03
421	002870	香山股份	200	6,302.00	0.03
422	688609	九联科技	600	6,282.00	0.03
423	301368	丰立智能	100	6,183.00	0.03
424	601012	隆基绿能	400	6,008.00	0.03
425	688306	均普智能	600	5,904.00	0.03
426	300916	朗特智能	200	5,814.00	0.02

427	301011	华立科技	200	5,740.00	0.02
428	600990	四创电子	200	5,608.00	0.02
429	603416	信捷电气	100	5,607.00	0.02
430	000768	中航西飞	200	5,468.00	0.02
431	300996	普联软件	360	5,410.80	0.02
432	688051	佳华科技	217	5,401.13	0.02
433	300884	狄耐克	400	5,368.00	0.02
434	002063	远光软件	900	5,355.00	0.02
435	300253	卫宁健康	500	5,300.00	0.02
436	300377	赢时胜	200	5,190.00	0.02
437	000061	农产品	800	5,112.00	0.02
438	301013	利和兴	300	5,085.00	0.02
439	002876	三利谱	200	5,038.00	0.02
440	003028	振邦智能	160	4,961.60	0.02
441	002322	理工能科	400	4,840.00	0.02
442	300853	申昊科技	200	4,760.00	0.02
443	000524	岭南控股	400	4,700.00	0.02
444	002881	美格智能	100	4,640.00	0.02
445	300553	集智股份	110	4,557.30	0.02
446	002467	二六三	700	4,529.00	0.02
447	600125	铁龙物流	800	4,528.00	0.02
448	000651	格力电器	100	4,492.00	0.02
449	300840	酷特智能	200	4,460.00	0.02
450	300352	北信源	800	4,424.00	0.02
451	002708	光洋股份	400	4,412.00	0.02
452	300543	朗科智能	400	4,300.00	0.02
453	603648	畅联股份	400	4,296.00	0.02
454	300880	迦南智能	200	4,236.00	0.02
455	300790	宇瞳光学	200	4,182.00	0.02
456	002577	雷柏科技	200	4,144.00	0.02
457	600787	中储股份	700	4,102.00	0.02
458	002152	广电运通	300	4,032.00	0.02
459	601921	浙版传媒	500	4,030.00	0.02
460	301179	泽宇智能	260	3,967.60	0.02
461	300275	梅安森	300	3,966.00	0.02
462	300590	移为通信	300	3,903.00	0.02
463	002707	众信旅游	500	3,900.00	0.02
464	002655	共达电声	300	3,888.00	0.02
465	600038	中直股份	100	3,881.00	0.02
466	600707	彩虹股份	600	3,876.00	0.02
467	300507	苏奥传感	500	3,840.00	0.02
468	300680	隆盛科技	100	3,791.00	0.02
469	000034	神州数码	100	3,764.00	0.02

470	002539	云图控股	400	3,752.00	0.02
471	600271	航天信息	400	3,696.00	0.02
472	300378	鼎捷数智	100	3,660.00	0.02
473	300126	锐奇股份	500	3,630.00	0.02
474	300349	金卡智能	300	3,585.00	0.02
475	002093	国脉科技	300	3,549.00	0.02
476	000887	中鼎股份	200	3,518.00	0.01
477	600219	南山铝业	900	3,447.00	0.01
478	300408	三环集团	100	3,340.00	0.01
479	002937	兴瑞科技	200	3,324.00	0.01
480	603018	华设集团	400	3,284.00	0.01
481	600511	国药股份	100	2,916.00	0.01
482	300031	宝通科技	100	2,503.00	0.01
483	300542	新晨科技	100	2,374.00	0.01
484	002180	纳思达	100	2,294.00	0.01
485	300123	亚光科技	300	2,166.00	0.01
486	300040	九洲集团	300	2,124.00	0.01
487	000682	东方电子	200	2,048.00	0.01
488	603803	瑞斯康达	200	2,008.00	0.01
489	300532	今天国际	150	1,809.00	0.01
490	300270	中威电子	200	1,572.00	0.01
491	300168	万达信息	200	1,534.00	0.01
492	601231	环旭电子	100	1,463.00	0.01
493	601677	明泰铝业	100	1,242.00	0.01
494	000785	居然智家	400	1,220.00	0.01
495	300002	神州泰岳	100	1,180.00	0.01

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	600741	华域汽车	1,517,479.00	8.23
2	002352	顺丰控股	1,316,533.00	7.14
3	688668	鼎通科技	1,128,532.43	6.12
4	688039	当虹科技	1,092,144.96	5.92
5	300807	天迈科技	1,081,650.00	5.86
6	603766	隆鑫通用	988,423.00	5.36
7	688608	恒玄科技	983,735.85	5.33
8	300866	安克创新	979,474.00	5.31
9	300259	新天科技	963,318.00	5.22
10	688696	极米科技	959,186.31	5.20
11	600582	天地科技	909,967.00	4.93
12	688508	芯朋微	895,927.87	4.86

13	688288	鸿泉物联	891,254.56	4.83
14	000157	中联重科	887,910.00	4.81
15	600745	闻泰科技	858,142.00	4.65
16	002008	大族激光	850,011.00	4.61
17	301039	中集车辆	837,327.00	4.54
18	300476	胜宏科技	835,326.00	4.53
19	301185	鸥玛软件	832,317.48	4.51
20	601766	中国中车	830,914.00	4.51
21	600183	生益科技	818,990.00	4.44
22	688787	海天瑞声	814,646.26	4.42
23	688800	瑞可达	813,036.21	4.41
24	688208	道通科技	812,943.77	4.41
25	300750	宁德时代	792,978.00	4.30
26	688158	优刻得-W	791,717.15	4.29
27	002841	视源股份	789,611.00	4.28
28	000333	美的集团	778,254.00	4.22
29	688286	敏芯股份	772,452.41	4.19
30	600690	海尔智家	769,674.00	4.17
31	603656	泰禾智能	764,048.00	4.14
32	002594	比亚迪	760,838.00	4.13
33	000651	格力电器	756,918.00	4.10
34	688015	交控科技	755,120.47	4.09
35	688095	福昕软件	752,166.55	4.08
36	000338	潍柴动力	747,645.00	4.05
37	000550	江铃汽车	744,657.00	4.04
38	688031	星环科技-U	737,370.54	4.00
39	300987	川网传媒	736,357.00	3.99
40	688252	天德钰	731,631.27	3.97
41	002803	吉宏股份	731,419.00	3.97
42	000901	航天科技	717,339.00	3.89
43	002957	科瑞技术	712,215.00	3.86
44	688588	凌志软件	707,701.56	3.84
45	600050	中国联通	704,567.00	3.82
46	600835	上海机电	702,540.00	3.81
47	603015	弘讯科技	701,575.00	3.80
48	300502	新易盛	696,730.00	3.78
49	002970	锐明技术	694,079.00	3.76
50	002708	光洋股份	692,846.00	3.76
51	300432	富临精工	685,814.00	3.72
52	301205	联特科技	679,974.00	3.69
53	000725	京东方 A	677,564.00	3.67
54	301221	光庭信息	676,330.00	3.67
55	301002	崧盛股份	675,167.00	3.66

56	002916	深南电路	667,981.00	3.62
57	688509	正元地信	659,781.35	3.58
58	600066	宇通客车	652,541.00	3.54
59	002384	东山精密	651,944.00	3.53
60	601222	林洋能源	650,166.00	3.53
61	002468	申通快递	648,316.00	3.52
62	688557	兰剑智能	646,087.05	3.50
63	301218	华是科技	642,811.00	3.49
64	688330	宏力达	642,501.22	3.48
65	600180	瑞茂通	634,113.00	3.44
66	603329	上海雅仕	633,622.00	3.44
67	600060	海信视像	631,868.00	3.43
68	002668	TCL 智家	630,761.00	3.42
69	300662	科锐国际	626,115.00	3.39
70	000821	京山轻机	624,751.00	3.39
71	301052	果麦文化	624,214.93	3.38
72	688002	睿创微纳	621,529.88	3.37
73	601615	明阳智能	611,452.00	3.32
74	688685	迈信林	610,732.31	3.31
75	688360	德马科技	610,582.56	3.31
76	300101	振芯科技	605,785.00	3.28
77	000829	天音控股	602,771.00	3.27
78	300628	亿联网络	599,516.00	3.25
79	002097	山河智能	596,879.00	3.24
80	688201	信安世纪	596,558.20	3.23
81	300533	冰川网络	588,328.00	3.19
82	300604	长川科技	587,368.00	3.18
83	002241	歌尔股份	572,158.00	3.10
84	300546	雄帝科技	571,180.70	3.10
85	300562	乐心医疗	568,312.00	3.08
86	301025	读客文化	567,899.00	3.08
87	688118	普元信息	564,952.31	3.06
88	300666	江丰电子	564,857.00	3.06
89	300018	中元股份	563,712.00	3.06
90	688313	仕佳光子	560,098.90	3.04
91	688009	中国通号	559,657.86	3.03
92	603855	华荣股份	552,306.00	2.99
93	605365	立达信	544,810.00	2.95
94	601801	皖新传媒	543,491.00	2.95
95	002556	辉隆股份	541,714.00	2.94
96	002017	东信和平	541,347.30	2.94
97	688531	日联科技	540,757.52	2.93
98	300400	劲拓股份	539,479.00	2.92

99	300990	同飞股份	538,796.00	2.92
100	300030	阳普医疗	528,505.00	2.87
101	688035	德邦科技	527,732.81	2.86
102	600998	九州通	527,597.00	2.86
103	603788	宁波高发	526,058.00	2.85
104	300413	芒果超媒	521,880.00	2.83
105	002090	金智科技	520,997.03	2.82
106	001283	豪鹏科技	519,344.00	2.82
107	300031	宝通科技	518,918.00	2.81
108	603171	税友股份	518,854.00	2.81
109	688070	纵横股份	515,277.78	2.79
110	603128	华贸物流	514,705.00	2.79
111	301031	中熔电气	514,277.00	2.79
112	688183	生益电子	510,315.95	2.77
113	688018	乐鑫科技	509,869.97	2.76
114	600487	亨通光电	509,416.00	2.76
115	603039	泛微网络	502,749.00	2.73
116	688365	光云科技	498,143.50	2.70
117	000404	长虹华意	490,944.00	2.66
118	603118	共进股份	488,166.00	2.65
119	600104	上汽集团	482,014.00	2.61
120	688079	美迪凯	482,005.22	2.61
121	001266	宏英智能	477,888.00	2.59
122	688099	晶晨股份	477,836.54	2.59
123	300836	佰奥智能	477,141.00	2.59
124	300206	理邦仪器	472,940.00	2.56
125	601728	中国电信	470,472.00	2.55
126	603466	风语筑	465,638.00	2.52
127	300244	迪安诊断	464,659.00	2.52
128	300682	朗新集团	461,514.00	2.50
129	002367	康力电梯	459,464.00	2.49
130	688162	巨一科技	451,292.95	2.45
131	688100	威胜信息	449,660.34	2.44
132	002432	九安医疗	449,139.00	2.44
133	688229	博睿数据	445,429.90	2.42
134	688343	云天励飞-U	445,208.94	2.41
135	300514	友讯达	444,977.00	2.41
136	688499	利元亨	444,377.19	2.41
137	688020	方邦股份	444,342.94	2.41
138	301380	挖金客	444,298.00	2.41
139	603380	易德龙	442,417.00	2.40
140	688778	厦钨新能	440,417.20	2.39
141	688023	安恒信息	432,568.17	2.35



142	300366	创意信息	422,465.00	2.29
143	301231	荣信文化	421,085.00	2.28
144	300246	宝莱特	415,968.00	2.26
145	688772	珠海冠宇	412,815.52	2.24
146	301270	汉仪股份	411,770.00	2.23
147	002174	游族网络	411,285.00	2.23
148	002396	星网锐捷	411,058.00	2.23
149	301195	北路智控	408,060.00	2.21
150	300548	长芯博创	407,841.00	2.21
151	300222	科大智能	405,772.00	2.20
152	600885	宏发股份	400,930.00	2.17
153	300552	万集科技	400,369.00	2.17
154	688661	和林微纳	399,292.39	2.16
155	300365	恒华科技	398,768.00	2.16
156	688768	容知日新	397,468.58	2.15
157	688328	深科达	395,215.24	2.14
158	688256	寒武纪-U	393,442.00	2.13
159	300579	数字认证	391,060.00	2.12
160	300113	顺网科技	390,644.00	2.12
161	301338	凯格精机	390,258.00	2.12
162	688326	经纬恒润-W	386,341.06	2.09
163	300978	东箭科技	383,242.00	2.08
164	300378	鼎捷数智	382,825.00	2.08
165	688400	凌云光	382,797.07	2.08
166	688327	云从科技-UW	381,981.08	2.07
167	002517	恺英网络	381,060.00	2.07
168	300433	蓝思科技	380,534.00	2.06
169	300358	楚天科技	380,171.00	2.06
170	300486	东杰智能	380,164.00	2.06
171	600415	小商品城	379,782.00	2.06
172	300001	特锐德	378,097.00	2.05
173	688093	世华科技	377,710.34	2.05
174	688258	卓易信息	373,336.12	2.02
175	300951	博硕科技	371,013.00	2.01
176	603901	永创智能	370,248.00	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600741	华域汽车	1,460,320.00	7.92
2	300807	天迈科技	1,400,211.00	7.59
3	002352	顺丰控股	1,327,090.00	7.20

4	300476	胜宏科技	1,179,748.00	6.40
5	688668	鼎通科技	1,153,194.03	6.25
6	300866	安克创新	1,149,479.00	6.23
7	603766	隆鑫通用	1,121,228.00	6.08
8	688158	优刻得-W	1,066,283.24	5.78
9	688039	当虹科技	1,053,229.92	5.71
10	688288	鸿泉物联	1,038,001.46	5.63
11	688208	道通科技	978,254.49	5.30
12	601766	中国中车	973,873.00	5.28
13	688696	极米科技	935,076.78	5.07
14	000157	中联重科	922,731.00	5.00
15	688800	瑞可达	903,317.27	4.90
16	600745	闻泰科技	902,226.00	4.89
17	600183	生益科技	898,244.00	4.87
18	002008	大族激光	884,899.00	4.80
19	600066	宇通客车	879,370.00	4.77
20	600582	天地科技	878,897.00	4.77
21	688286	敏芯股份	874,391.67	4.74
22	688508	芯朋微	872,186.78	4.73
23	300259	新天科技	863,136.00	4.68
24	000725	京东方 A	861,957.00	4.67
25	688252	天德钰	853,089.21	4.63
26	000338	潍柴动力	826,447.00	4.48
27	600835	上海机电	825,317.00	4.47
28	300987	川网传媒	825,127.00	4.47
29	688608	恒玄科技	824,682.10	4.47
30	002970	锐明技术	805,459.00	4.37
31	688787	海天瑞声	801,748.00	4.35
32	300432	富临精工	797,593.00	4.32
33	600050	中国联通	782,900.00	4.24
34	688002	睿创微纳	780,112.57	4.23
35	300750	宁德时代	777,233.00	4.21
36	301185	鸥玛软件	774,745.00	4.20
37	603015	弘讯科技	769,911.00	4.17
38	301221	光庭信息	769,505.00	4.17
39	601222	林洋能源	766,523.00	4.16
40	000550	江铃汽车	762,895.00	4.14
41	002594	比亚迪	759,624.00	4.12
42	688015	交控科技	753,966.92	4.09
43	688685	迈信林	753,153.62	4.08
44	688009	中国通号	752,775.55	4.08
45	000651	格力电器	741,842.00	4.02
46	002916	深南电路	737,745.00	4.00

47	002708	光洋股份	734,833.00	3.98
48	002468	申通快递	732,680.00	3.97
49	301002	崧盛股份	732,411.00	3.97
50	603656	泰禾智能	731,948.00	3.97
51	301039	中集车辆	729,456.00	3.95
52	000901	航天科技	727,987.36	3.95
53	002841	视源股份	720,448.00	3.91
54	600690	海尔智家	714,811.00	3.88
55	603329	上海雅仕	704,835.00	3.82
56	301052	果麦文化	703,607.00	3.81
57	688095	福昕软件	696,526.19	3.78
58	002384	东山精密	696,510.00	3.78
59	002957	科瑞技术	686,003.00	3.72
60	688070	纵横股份	678,561.10	3.68
61	000821	京山轻机	674,410.00	3.66
62	688557	兰剑智能	672,790.40	3.65
63	688023	安恒信息	671,492.06	3.64
64	300031	宝通科技	668,251.00	3.62
65	600180	瑞茂通	663,648.00	3.60
66	688360	德马科技	653,221.68	3.54
67	688313	仕佳光子	653,101.30	3.54
68	688588	凌志软件	652,666.90	3.54
69	300502	新易盛	651,754.40	3.53
70	301205	联特科技	651,672.00	3.53
71	300101	振芯科技	650,030.00	3.52
72	300546	雄帝科技	649,756.00	3.52
73	300628	亿联网络	646,464.00	3.50
74	301218	华是科技	636,165.00	3.45
75	688330	宏力达	630,375.79	3.42
76	688531	日联科技	629,892.71	3.42
77	000333	美的集团	628,309.00	3.41
78	603855	华荣股份	622,164.00	3.37
79	300533	冰川网络	616,874.00	3.34
80	000829	天音控股	612,362.00	3.32
81	002432	九安医疗	611,685.00	3.32
82	600060	海信视像	609,786.00	3.31
83	688031	星环科技-U	604,715.95	3.28
84	002017	东信和平	604,524.00	3.28
85	688201	信安世纪	603,092.55	3.27
86	688183	生益电子	602,205.41	3.27
87	002803	吉宏股份	600,207.00	3.25
88	002097	山河智能	600,018.00	3.25
89	600487	亨通光电	591,371.00	3.21

90	688365	光云科技	585,170.97	3.17
91	002241	歌尔股份	582,929.00	3.16
92	300836	佰奥智能	581,915.00	3.16
93	601615	明阳智能	579,227.00	3.14
94	603788	宁波高发	578,399.00	3.14
95	688079	美迪凯	572,550.97	3.10
96	688018	乐鑫科技	569,631.01	3.09
97	002668	TCL 智家	565,762.00	3.07
98	300433	蓝思科技	564,228.00	3.06
99	688509	正元地信	563,812.05	3.06
100	301025	读客文化	563,688.00	3.06
101	300666	江丰电子	560,527.00	3.04
102	300682	朗新集团	560,187.00	3.04
103	002938	鹏鼎控股	558,461.00	3.03
104	688100	威胜信息	557,188.54	3.02
105	601801	皖新传媒	545,795.00	2.96
106	300604	长川科技	544,779.00	2.95
107	300030	阳普医疗	541,600.00	2.94
108	300548	长芯博创	536,465.00	2.91
109	002139	拓邦股份	529,765.00	2.87
110	605365	立达信	529,481.96	2.87
111	688139	海尔生物	528,340.59	2.86
112	688099	晶晨股份	522,585.21	2.83
113	300244	迪安诊断	520,483.00	2.82
114	002556	辉隆股份	509,297.00	2.76
115	603128	华贸物流	507,679.00	2.75
116	300113	顺网科技	506,592.00	2.75
117	300552	万集科技	505,468.00	2.74
118	300018	中元股份	500,533.00	2.71
119	688118	普元信息	498,487.58	2.70
120	300378	鼎捷数智	498,156.00	2.70
121	300413	芒果超媒	494,183.00	2.68
122	300990	同飞股份	492,232.00	2.67
123	688369	致远互联	490,674.36	2.66
124	688499	利元亨	488,160.88	2.65
125	002090	金智科技	487,256.00	2.64
126	601728	中国电信	484,965.00	2.63
127	603039	泛微网络	481,118.00	2.61
128	300662	科锐国际	480,771.00	2.61
129	688772	珠海冠宇	475,086.66	2.58
130	603171	税友股份	475,046.00	2.58
131	600563	法拉电子	474,368.00	2.57
132	301031	中熔电气	469,097.00	2.54

133	300562	乐心医疗	457,816.00	2.48
134	603118	共进股份	455,915.00	2.47
135	688035	德邦科技	454,141.15	2.46
136	601318	中国平安	446,528.00	2.42
137	300365	恒华科技	444,604.00	2.41
138	001283	豪鹏科技	439,853.00	2.38
139	002396	星网锐捷	439,833.00	2.38
140	605333	沪光股份	436,940.00	2.37
141	300400	劲拓股份	432,362.00	2.34
142	300001	特锐德	430,923.00	2.34
143	688326	经纬恒润-W	429,430.30	2.33
144	300366	创意信息	421,465.00	2.29
145	300579	数字认证	417,018.00	2.26
146	688579	山大地纬	416,496.67	2.26
147	300514	友讯达	415,683.00	2.25
148	002174	游族网络	414,719.00	2.25
149	688229	博睿数据	411,029.72	2.23
150	002093	国脉科技	410,154.00	2.22
151	688778	厦钨新能	409,809.46	2.22
152	603063	禾望电气	406,982.00	2.21
153	001266	宏英智能	405,190.00	2.20
154	688343	云天励飞-U	397,132.26	2.15
155	688020	方邦股份	397,041.13	2.15
156	300766	每日互动	393,598.00	2.13
157	600885	宏发股份	392,755.00	2.13
158	301380	挖金客	392,645.00	2.13
159	300454	深信服	392,039.00	2.13
160	301231	荣信文化	378,930.00	2.05
161	002517	恺英网络	376,296.00	2.04
162	300771	智莱科技	375,078.00	2.03
163	002410	广联达	374,318.00	2.03
164	688661	和林微纳	372,678.19	2.02
165	688256	寒武纪-U	371,696.00	2.02
166	300951	博硕科技	371,511.00	2.01
167	300369	绿盟科技	370,188.00	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	153,582,200.70
卖出股票收入（成交）总额	157,558,560.80

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，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	52,407.87
2	应收清算款	528,756.50
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	269,035.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	850,200.22

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 (%)
鹏华智投 数字经济 混合 A	242	13,530.31	0.00	0.00	3,274,334.22	100.00
鹏华智投 数字经济 混合 C	316	37,429.84	0.00	0.00	11,827,828.61	100.00
合计	558	27,064.81	0.00	0.00	15,102,162.83	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华智投数字经济混合 A	55,795.81	1.7040
	鹏华智投数字经济混合 C	10,013.95	0.0847
	合计	65,809.76	0.4358

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	鹏华智投数字经济混合 A	0~10
	鹏华智投数字经济混合 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏华智投数字经济混合 A	0~10
	鹏华智投数字经济混合 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	鹏华智投数字经济混合 A	鹏华智投数字经济混合 C
基金合同生效日（2024 年 5 月 17 日）基金份额总额	50,027,235.78	176,435,841.05
本报告期期初基金份额总额	3,053,224.97	11,335,457.53
本报告期基金总申购份额	2,499,505.45	86,908,295.71
减：本报告期基金总赎回份额	2,278,396.20	86,415,924.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-



本报告期末基金份额总额	3,274,334.22	11,827,828.61
-------------	--------------	---------------

§ 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：  无。  基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：  2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。  2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。  2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。
---

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

无。
----

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。
------------------------

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

			(%)		(%)	
申万宏源 证券	3	77,327,724. 64	24.85	34,863.69	24.85	—
中信建投 证券	1	57,082,639. 27	18.35	25,739.79	18.35	—
信达证券	1	48,718,819. 70	15.66	21,968.12	15.66	—
中金公司	1	38,527,828. 32	12.38	17,373.33	12.38	—
东方证券	1	34,547,616. 68	11.10	15,572.32	11.10	—
华泰证券	1	22,074,519. 62	7.09	9,956.16	7.10	—
汇丰前海 证券	1	15,388,390. 92	4.95	6,937.31	4.95	本 报 告 期 新 增
国金证券	1	9,614,523.6 1	3.09	4,335.09	3.09	—
浙商证券	1	5,798,111.7 1	1.86	2,613.65	1.86	—
中信证券	1	2,060,587.0 3	0.66	929.05	0.66	—
长江证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	1	—	—	—	—	—
东兴证券	1	—	—	—	—	本 报 告 期 减 少 一 个
光大证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	1	—	—	—	—	—
国投证券	1	—	—	—	—	—
海通证券	1	—	—	—	—	—
太平洋证 券	1	—	—	—	—	—
西南证券	1	—	—	—	—	—
银河证券	1	—	—	—	—	—

注：交易单元选择的标准和程序：

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

行；中国证监会或有权机关规定的其他条件等。

2. 选择程序如下：

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

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	-	-	-	-	-	-

国金证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 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	2025 年 01 月 04 日
2	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	2025 年 01 月 15 日
3	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金 2024 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	2025 年 01 月 21 日
4	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	2025 年 02 月 08 日

5	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金更新的招募说明书	《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	2025 年 03 月 05 日
6	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金（A 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 05 日
7	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金（C 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 05 日
8	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金 2024 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	2025 年 03 月 28 日
9	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	2025 年 04 月 12 日
10	鹏华智投数字经济混合型证券投资基金 2025 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	2025 年 04 月 21 日
11	关于鹏华智投数字经济混合型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的风险提示公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 26 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与招商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	2025 年 06 月 30 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）《鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华智投数字经济混合型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华智投数字经济混合型证券投资基金 2025 年中期报告》（原文）。

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日