

鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数  
证券投资基金  
2023 年第 4 季度报告

2023 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 19 日

## § 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 01 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	1000ETF 增强
场内简称	1000 鹏华(扩位简称:1000ETF 增强)
基金主代码	560590
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 1 日
报告期末基金份额总额	19,710,000.00 份
投资目标	本基金在力求有效跟踪标的指数基础上，通过主动化投资管理，力争获取超越指数表现的投资收益。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金以中证 1000 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争获取超越指数表现的投资收益。</p> <p>指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子量化选股模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，力求实现超额收益。</p> <p>(1) 多因子量化选股模型</p> <p>本基金将以多因子量化选股模型构建股票组合。多因子模型针对个股构建价值、质量、动量、成长、一致预期等因子，通过量化方法处理因子与个股超额回报之间的特征关系，挑选出具有基本面逻辑支撑和统计意义有效的因子组合，进而得出具有稳定超额回报的股票组合。本基金对因子的有效性进行持续的跟踪，分析其变化规律，基金经理</p>

根据市场状况结合因子变化趋势,对模型使用的因子结构进行动态调整。

#### (2) 风险控制与调整

本基金在追求超额收益的同时,需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析,对组合跟踪效果进行预估,及时调整投资组合,力求将跟踪误差控制在目标范围内。本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 6.5%。

#### (3) 投资组合优化模型

本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。选股范围以标的指数成份股为主,也包括非成份股中与成份股相关性高,流动性好,基本面信息充足的股票。

#### (4) 存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的深入研究判断,进行存托凭证的投资。

### 2、债券投资策略

本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择。

本基金可投资可转换债券及可交换债券,可转换债券及可交换债券兼具债权和股权双重属性,本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析综合开展投资决策,以增强本基金的收益。

### 3、股指期货投资策略

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

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

### 4、资产支持证券的投资策略

本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理,并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略,严格遵守法律法规和基金合同的约定,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

### 5、融资及转融通投资策略

本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上,参与融资业务。

为更好地实现投资目标,在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下,本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上,合理确定出借证券的范围、期限和比

	例。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金在履行适当程序后可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时本基金具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

注：无。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	1,020,746.67
2. 本期利润	91,533.00
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0025
4. 期末基金资产净值	19,664,514.42
5. 期末基金份额净值	0.9977

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。

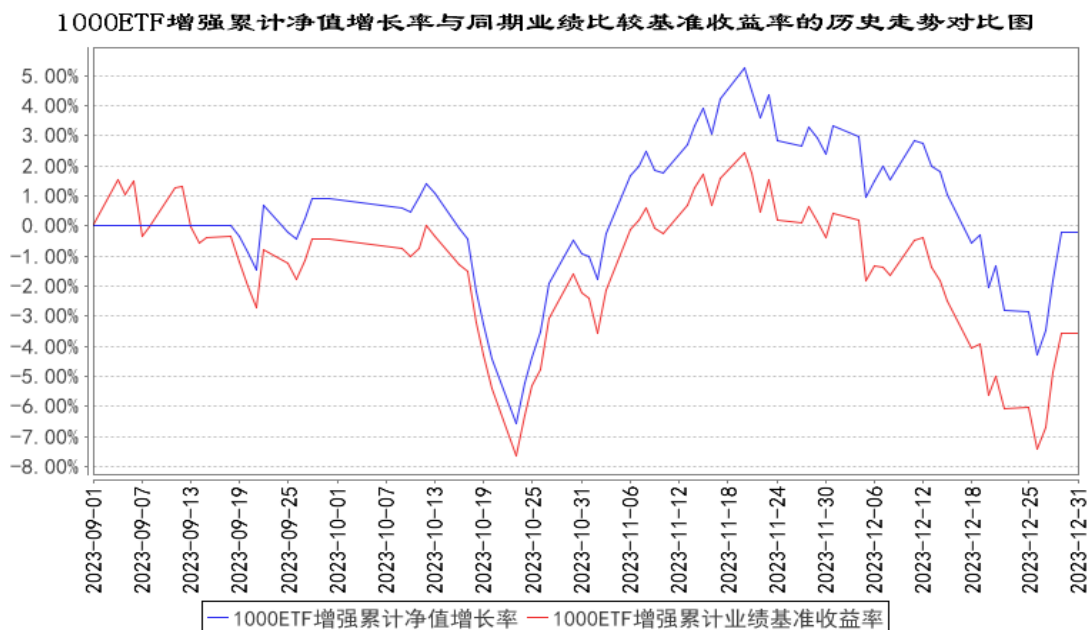
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	净值增长率 ①	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	-1.11%	1.03%	-3.15%	1.04%	2.04%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	-0.23%	0.93%	-3.56%	1.00%	3.33%	-0.07%

注：业绩比较基准=中证 1000 指数收益率

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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 2023 年 09 月 01 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定，于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗英宇	基金经理	2023-09-01	-	16 年	罗英宇先生，国籍中国，管理学硕士，16 年证券从业经验。曾任招商银行股份有限公司高级程序员，博时基金管理有限公司信息技术部高级程序员。2008 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任信息技术部系统分析员、总经理助理、副总经理、量化及衍生品投资部金融科技副总监，现担任量化及衍生品投资部基金经理。2020 年 12 月至今担任鹏华国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 12 月至 2022 年 03 月担任鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证

				券投资基金基金经理, 2020 年 12 月至 2022 年 01 月担任鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2021 年 01 月至 2022 年 08 月担任鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证高铁产业指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证移动互联网指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证信息技术指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 08 月至今担任鹏华国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2021 年 09 月至今担任鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 11 月至今担任鹏华中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中证工业互联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华中证传媒指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华中证车联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华中证传媒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, 罗英宇先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘寇斌权为本基金基金经理。
苏俊杰	基金经理	2023-09-01	-	11 年 苏俊杰先生, 国籍中国, 理学硕士, 11 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, 现担任量化及衍生品投资部总经理/基金经理。2021 年 03 月至今担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理, 2021 年 03 月至今担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今

				担任鹏华中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 12 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华创业板指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型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, 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 月至今担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 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, 苏俊杰先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘寇斌权为本基金基金经理。	
寇斌权	基金经理	2023-12-09	-	5 年	寇斌权先生, 国籍中国, 物理学博士, 5 年证券从业经验。2018 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任量化及衍生品投资部大数据分析研究助理、量化研究员、高级量化研究员、资深量化研究员, 现担任量化及衍生品投资部基金经理。2023 年 06 月至今担任鹏华弘华灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 09 月至今担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 09 月至今担任鹏华弘达灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 12 月至今担任鹏华畅享债券型证券投资基金基金经理, 2023

					年 12 月至今担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 寇斌权先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘寇斌权为本基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.2 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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年四季度股票市场整体下跌，投资者对经济预期的情绪较为悲观，海外投资者持续减持，相较而言，中小盘受到冲击较小。

展望一季度，市场当前在估值、情绪、资金等各个维度均处于历史低位状态，底部支撑较强，一季度仍有结构性上涨机会，但可能会出现叠加快速风格与行业轮动的震荡上行。

报告期内，本基金在控制相对中证 1000 指数跟踪误差的基础上，采用量化方法进行选股，力



争在中证 1000 指数收益率的基础上进行增强。量化选股模型侧重于不同预测收益来源、不同预测周期因子的动态配置，辅以稳健均衡的风格，平衡模型长期有效性和对短期市场环境波动的适应性，追求获取稳健的超额收益。

#### 4.5 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-1.11%，同期业绩比较基准增长率为-3.15%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自 2023 年 10 月 31 日至 2023 年 12 月 29 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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	18,069,226.42	91.36
	其中：股票	18,069,226.42	91.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,625,999.31	8.22
8	其他资产	82,970.19	0.42
9	合计	19,778,195.92	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 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	-	-
B	采矿业	489,623.00	2.49
C	制造业	9,395,848.50	47.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	324,378.00	1.65

E	建筑业	211,626.00	1.08
F	批发和零售业	130,666.00	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	177,072.00	0.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,150,496.95	16.02
J	金融业	427,386.00	2.17
K	房地产业	430,450.00	2.19
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	244,039.00	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	114,608.00	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	129,686.00	0.66
R	文化、体育和娱乐业	330,522.00	1.68
S	综合	-	-
	合计	15,556,401.45	79.11

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,915,519.97	9.74
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	-	-
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	103,881.00	0.53
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	155,800.00	0.79
M	科学研究和技术服务业	106,400.00	0.54
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	24,480.00	0.12
Q	卫生和社会工作	206,744.00	1.05
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,512,824.97	12.78

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	002436	兴森科技	20,500	301,965.00	1.54
2	603236	移远通信	4,600	247,250.00	1.26
3	002351	漫步者	12,800	226,176.00	1.15
4	601208	东材科技	18,200	225,316.00	1.15
5	603063	禾望电气	8,900	222,500.00	1.13
6	002782	可立克	15,700	220,585.00	1.12
7	002215	诺普信	26,700	220,542.00	1.12
8	600685	中船防务	8,500	217,175.00	1.10
9	002891	中宠股份	8,100	213,435.00	1.09
10	002063	远光软件	33,600	207,648.00	1.06

#### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	300502	新易盛	5,200	256,464.00	1.30
2	002044	美年健康	34,400	206,744.00	1.05
3	002664	信质集团	11,600	192,908.00	0.98
4	688425	铁建重工	46,501	184,608.97	0.94
5	603520	司太立	12,800	180,224.00	0.92

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

### 5.5 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债券投资明细

注：无。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：无。

### 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

注：无。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本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

深圳市禾望电气股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	82,970.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	82,970.19

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告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。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	91,710,000.00
报告期期间基金总申购份额	21,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	93,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	19,710,000.00

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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	
	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 (%)
机构投资者	20231110~20231114, 20231117~20231119, 20231128~20231128	3,250,500.00	6,362,500.00	6,667,700.00	2,945,300.00	14.94
	20231121~20231127, 20231129~20231231	3,427,000.00	27,534,100.00	25,761,000.00	5,200,100.00	26.38
产品特有风险						
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。						

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

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告》（原文）。

### 9.2 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。

### 9.3 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**

**2024 年 1 月 19 日**