

鹏华新能源精选混合型证券投资基金

2022 年第 4 季度报告

2022 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 1 月 20 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 01 月 19 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 2022 年 10 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 鹏华新能源精选混合 |
| 基金主代码 | 011956 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 7 月 21 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,363,198,103.85 份 |
| 投资目标 | 本基金在科学严谨的资产配置框架下，严格控制基金资产风险，力争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>本基金将通过跟踪考量宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘 A 股和港股的优质公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1) 自上而下地分析行业的成长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2) 自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的</p> |

个股。

(1) 新能源行业的定义

新能源是指煤炭、石油、常规天然气等已广泛使用的传统能源之外的各种能源形式，比如太阳能、风能、核能、地热能、锂电池、燃料电池、新能源汽车等。本基金投资的新能源行业界定如下：

1) 直接从事新能源产业相关的行业，包括但不限于：太阳能、风能、核能、水能、页岩气、绿色照明、生物质、天然气发电、地热、建筑节能、光伏建筑一体化、燃料乙醇、氢能、锂电池、固态电池、垃圾发电、节能照明、节能环保、储能、新能源汽车、汽车电子、智能汽车、智能电网、分布式离网系统等。投资标的涵盖新能源产业链的上下游企业，包括上游大能源类、大资源类、设备厂商类及下游运营商上市公司。

2) 受益于新能源产业发展的行业，包括但不限于：有潜力成为以上述新能源产业作为公司重要收入或利润来源或重要增长点的公司；与新能源产业相关的服务行业；投资于新能源产业相关的公司；因与新能源产业相关的产业结构升级、消费生活模式转变而受益的其他上市公司等。

未来如果基金管理人认为有更适当的新能源行业的划分标准，基金管理人在履行适当程序后有权对上述界定方法进行变更。

(2) 自上而下的行业遴选

本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。

(3) 自下而上的个股选择

本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。

1) 定性分析

本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司：

一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持

| | |
|--------|--|
| | <p>续竞争优势。</p> <p>另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。</p> <p>2) 定量分析</p> <p>本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。</p> <p>（4）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"> 1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司； 2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司； 3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。 <p>3、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、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>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。</p> <p>5、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>未来，如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可在履行适当程序后相应调整。</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 | <p>中证新能源产业指数收益率×70%+恒生能源行业指数收益率（经汇率估值调整）×15%+中证综合债指数收益率×15%</p> |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险</p> |

| | | |
|-----------------|---|------------------|
| | 水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 基金管理人 | 鹏华基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 鹏华新能源精选混合 A | 鹏华新能源精选混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 011956 | 011957 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 733,463,581.20 份 | 629,734,522.65 份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 风险收益特征同上 | 风险收益特征同上 |

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（2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|----------------|
| | 鹏华新能源精选混合 A | 鹏华新能源精选混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -30,352,387.87 | -27,698,714.09 |
| 2. 本期利润 | -31,244,305.73 | -44,060,892.42 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0423 | -0.0678 |
| 4. 期末基金资产净值 | 673,876,135.29 | 571,942,310.65 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9188 | 0.9082 |

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

鹏华新能源精选混合 A

| 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 | -4.51% | 1.83% | -4.75% | 1.40% | 0.24% | 0.43% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去六个月 | -12.80% | 1.97% | -17.97% | 1.39% | 5.17% | 0.58% |
| 过去一年 | -11.98% | 2.03% | -15.85% | 1.61% | 3.87% | 0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | -8.12% | 1.76% | -8.00% | 1.64% | -0.12% | 0.12% |

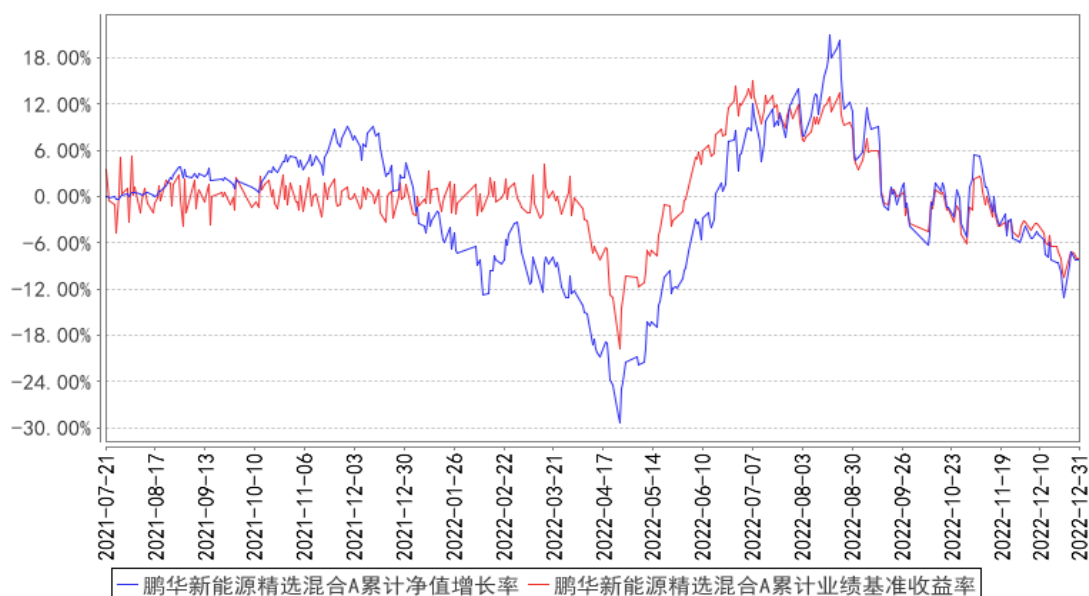
鹏华新能源精选混合 C

| 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 | -4.70% | 1.83% | -4.75% | 1.40% | 0.05% | 0.43% |
| 过去六个月 | -13.16% | 1.97% | -17.97% | 1.39% | 4.81% | 0.58% |
| 过去一年 | -12.69% | 2.03% | -15.85% | 1.61% | 3.16% | 0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | -9.18% | 1.76% | -8.00% | 1.64% | -1.18% | 0.12% |

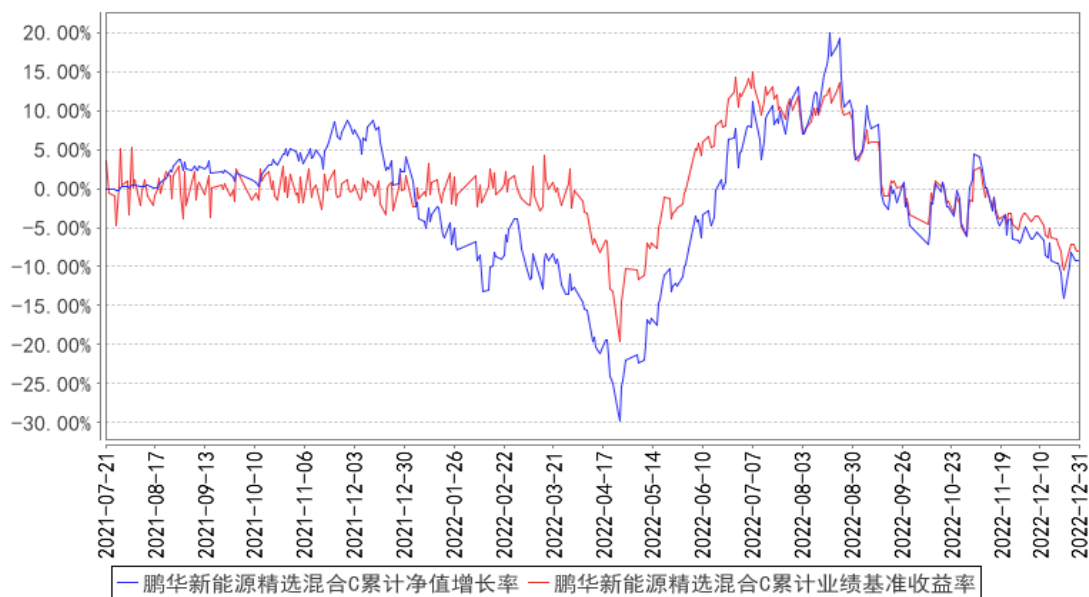
注：业绩比较基准=中证新能源产业指数收益率×70%+恒生能源行业指数收益率(经汇率估值调整)×15%+中证综合债指数收益率×15%

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

鹏华新能源精选混合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



鹏华新能源精选混合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 2021 年 07 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。

3.3 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 | | |
| 梁浩 | 基金经理 | 2021-07-21 | - | 14 年 | 梁浩先生，国籍中国，经济学博士，14 年证券从业经验。曾任职于信息产业部电信研究院，从事产业政策研究工作；2008 年 5 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任研究部高级研究员、基金经理助理、副总经理、董事总经理（MD），现担任公司副总裁，投资决策委员会成员。2011 年 07 月至今担任鹏华新兴产业混合型证券投资基金基金经理，2014 年 03 月至 2015 年 12 月担任鹏华环保产业股票型证券投资基金基金经理，2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任鹏华先进制造股票型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 03 月担任鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2016 年 01 月至 2017 年 03 月担 |

| | | | | | |
|-----|------|------------|---|-----|--|
| | | | | | 任鹏华健康环保灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 06 月至 2017 年 07 月担任鹏华医药科技股票型证券投资基金基金经理, 2017 年 10 月至今担任鹏华研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 06 月至 2021 年 01 月担任鹏华创新驱动混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 09 月至 2020 年 03 月担任鹏华研究驱动混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 05 月至 2021 年 01 月担任鹏华研究智选混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 12 月至 2021 年 01 月担任鹏华价值驱动混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 01 月至 2022 年 11 月担任鹏华科技创新混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 07 月至今担任鹏华新兴成长混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 10 月至今担任鹏华成长智选混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华汇智优选混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 07 月至今担任鹏华新能源精选混合型证券投资基金基金经理, 梁浩先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。 |
| 张宏钧 | 基金经理 | 2021-11-13 | - | 5 年 | 张宏钧先生, 国籍中国, 管理学博士, 5 年证券从业经验。2017 年 04 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任研究部研究员、高级研究员、资深研究员, 现担任研究部基金经理。2021 年 11 月至今担任鹏华新能源精选混合型证券投资基金基金经理, 张宏钧先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。 |

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遵规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定, 本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产, 在严格控制风险的

基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 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。

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

2022 年四季度，新能源板块继续震荡下行。我们认为市场风格变化是主要原因，而基本面的变化并不大，在我们此前预期之中。每年年末都是新能源板块波动较大的时候，市场对未来的主线容易产生分歧，又叠加当前面临的国际局势、疫情影响、经济发展等诸多不确定因素，报告期内板块内部没有形成清晰持续的方向。

报告期内，组合大的思路没有发生变化，继续采用“淡化大贝塔、寻找小贝塔和阿尔法”的选股思路和相对均衡的配置结构，仓位略有下降。新兴行业的核心驱动力是创新，创新要始终聚焦“新”的要素，这些新要素就是小贝塔或者阿尔法的来源。我们继续重点在以下三个小贝塔或阿尔法做布局和研究：供应链优化背景下的二供崛起、新能源相关材料的全面国产替代、加速兑现的新技术。与此同时，我们始终认为，包括新能源在内的很多新兴行业，其本质仍然是需求增速快的制造业，需求的增长不可能永远维持在超高水平，但具备强制造能力的企业有更大机会走的更远。因此，我们也在与新能源相关的优秀制造业公司中做了储备。

当前全球政治经济格局错综复杂，多重因素冲击之下，对新能源板块的分歧越来越大，而且我们发现，对待这一问题，产业和市场的认知在发生明显的偏移，我们未来要做的重点工作就是在这种偏移中寻找平衡点。对板块我们的观点没有变化，替代能源的经济性已经开始体现，从长远角度来看，能源安全不但不是替代能源的短板，相反，这是其重要优势。能源转型这个方向，未来仍然将持续涌现出可观的机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华新能源精选混合 A 份额净值增长率为-4.51%，同期业绩比较基准增长率为-4.75%，鹏华新能源精选混合 C 份额净值增长率为-4.70%，同期业绩比较基准增长率为-4.75%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 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 | 986,111,692.14 | 78.77 |
| | 其中：股票 | 986,111,692.14 | 78.77 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 3,782,725.86 | 0.30 |
| | 其中：债券 | 3,782,725.86 | 0.30 |
| | 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 | 239,164,769.60 | 19.10 |
| 8 | 其他资产 | 22,802,747.60 | 1.82 |
| 9 | 合计 | 1,251,861,935.20 | 100.00 |

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 | 936,280,661.64 | 75.15 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 28,042,696.00 | 2.25 |
| E | 建筑业 | 15,731,630.00 | 1.26 |
| 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 | 6,056,704.50 | 0.49 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| J | 金融业 | | |
| K | 房地产业 | | |
| L | 租赁和商务服务业 | | |
| M | 科学研究和技术服务业 | | |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | | |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | | |
| P | 教育 | | |
| Q | 卫生和社会工作 | | |
| R | 文化、体育和娱乐业 | | |
| S | 综合 | | |
| | 合计 | 986,111,692.14 | 79.15 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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 | 002011 | 盾安环境 | 5,524,600 | 72,537,998.00 | 5.82 |
| 2 | 002459 | 晶澳科技 | 1,020,900 | 61,345,881.00 | 4.92 |
| 3 | 300014 | 亿纬锂能 | 632,293 | 55,578,554.70 | 4.46 |
| 4 | 603806 | 福斯特 | 708,088 | 47,045,366.72 | 3.78 |
| 5 | 300750 | 宁德时代 | 119,420 | 46,982,216.40 | 3.77 |
| 6 | 600438 | 通威股份 | 1,206,630 | 46,551,785.40 | 3.74 |
| 7 | 688516 | 奥特维 | 214,246 | 43,063,446.00 | 3.46 |
| 8 | 601012 | 隆基绿能 | 1,004,880 | 42,466,228.80 | 3.41 |
| 9 | 300724 | 捷佳伟创 | 294,200 | 33,544,684.00 | 2.69 |
| 10 | 002851 | 麦格米特 | 1,225,800 | 31,821,768.00 | 2.55 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 3,782,725.86 | 0.30 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|--------------|------|
| 10 | 合计 | 3,782,725.86 | 0.30 |
|----|----|--------------|------|

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 113664 | 大元转债 | 23,720 | 2,372,561.48 | 0.19 |
| 2 | 113661 | 福 22 转债 | 11,200 | 1,410,164.38 | 0.11 |

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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金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投资组合仓位调整的交易成本，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

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。

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 | 416,709.09 |
| 2 | 应收证券清算款 | 21,177,674.28 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,208,364.23 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 22,802,747.60 |

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

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

| 项目 | 鹏华新能源精选混合 A | 鹏华新能源精选混合 C |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 746,657,253.15 | 510,437,248.97 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 37,732,533.05 | 306,199,006.39 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 50,926,205.00 | 186,901,732.71 |
| 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 | 733,463,581.20 | 629,734,522.65 |

§ 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

注：无。

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) 《鹏华新能源精选混合型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华新能源精选混合型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华新能源精选混合型证券投资基金 2022 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

2023 年 1 月 20 日