

# 鹏华创新未来混合型证券投资基金(LOF)

## 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 24 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 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 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 鹏华创新未来混合（LOF）  |
| 场内简称       | 鹏华创新(扩位简称:鹏华创新未来 LOF)  |
| 基金主代码      | 501205   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2020 年 9 月 30 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 4,745,378,126.18 份   |
| 投资目标       | 本基金通过系统与深入的研究，精选创新未来主题相关证券进行投资，并在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和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通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、存托凭证、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>（1）创新未来主题界定</p> <p>本基金所界定的创新未来主题是指在中国经济结构转型及产业升级的进程中，以创新为动力及支撑，将创新增长作为不断提高企业核心竞争力、增强发展的动力、保持竞争优势，从而实现可持续发展的优质企业。本基金主要从两个方面进行考量：</p> |

1) 上市公司能够通过技术创新、产品创新、服务创新、商业模式创新或组织与制度创新等一种或多种创新形式,为公司带来先发优势,提高产品质量或提升服务水平、降低成本,或利用新技术、新模式、新组织方式等,对传统产业进行升级改造,从而提升长期竞争优势或盈利能力,在市场竞争中掌握主动权;

2) 上市公司在所属行业内所发挥的引领带头作用,以标杆形象积极推动产业结构升级,引领行业发展新方向。

本基金将对主题所涉及相关产业发展进行密切跟踪,随着市场环境的不变化,相关上市公司的范围也会发生相应改变,届时本基金将根据实际情况调整相关主题概念和投资范围的认定。

#### (2) 自上而下的行业遴选

本基金将综合考虑相关行业的发展空间、发展前景、行业壁垒、竞争格局、行业轮动等因素,以及国家产业政策对各行业的影响等,重点配置具备发展前景、竞争格局良好的行业。同时,本基金将根据宏观经济及证券市场环境的变化,及时对行业配置进行动态调整。

#### (3) 自下而上的个股选择

本基金在契合创新未来主题的基础上,通过定性和定量相结合的方法,寻找具备拥有创新能力、核心竞争力、公司治理良好、经营情况稳健、具备长期投资价值的公司。

##### 1) 定性分析

本基金通过以下三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:

第一,是创新能力分析。本基金将综合分析公司创新战略、创新管理能力、创新文化、通过创新引导、创造新的市场需求情况、研发人员背景情况、创新对公司竞争优势的影响等方面。

第二,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。

第三,是公司治理结构分析,通过着重考察公司的管理层以及管理制度,选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。

##### 2) 定量分析

本基金通过对公司定量的创新能力评估、经营及财务指标状况、估值水平的分析,挖掘优质的投资标的。

第一,创新能力评估。在企业研发和创新水平及发展前景方面,本基金将通过研发投入、创新对公司营业收入及利润贡献情况等方面的分析,选择具备创新能力的企业。

第二,经营及财务指标状况。通过对企业资产负债率、经营活动产生的现金流、利润增长率、净资产收益率等财务和经营指标分析,从中选取具有持续盈利能力的企业。

第三,估值水平分析。本基金根据公司的行业特性及公司本身的特点,选择合适的股票估值方法。可供选择的估值方法包括市盈率法、市净率法、市盈率—长期成长法、自由现金流贴现模型或股利贴现模型等。

#### (4) 港股通标的股票投资策略

本基金所投资港股通标的股票除适用上述个股投资策略外,本基

金投资港股通标的股票还需关注：

- 1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；
- 2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；
- 3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。

#### （5）科创板股票投资策略

设立科创板的目的是落实创新驱动和科技强国战略、推动高质量发展。因此，在适用上述个股投资策略的基础上，还需关注：

- 1) 在定性分析方面，本基金通过以下研究方法进行个股筛选：
  - 一是行业研判。科创板重点支持新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业上市，我们通过产业调研的方式跟踪各子行业的需求空间、发展阶段和增长速度，挑选具备远期成长性的优质子行业。

二是竞争力分析。我们关注该公司具备的核心技术，以及这种技术的成熟度、易用性和研发壁垒。核心技术开发投入大、周期长、具有研发和应用上的较大不确定性，同时也是企业的核心竞争力所在。

- 2) 在定量分析方面，传统的 PE、PB、DCF 等估值方法对于许多发展成熟、盈利稳定的高科技公司仍然是最好的估值方法，但对于一些业务模式特殊、业务扩张迅速但仍处亏损期的高科技公司而言，传统的估值方法已不再适用。因此，在科创板企业的定量分析中，本基金将采取特殊高科技企业估值方法进行定量分析，例如，对云计算相关企业采取 PS 估值方法进行估值，对高速成长的萌芽期企业采取 P/FCF 进行估值，对部分互联网公司采取 MAU（月活跃用户数量）和单用户价值量进行估值，对电子商务平台采取 GMV（网站成交金额）作为估值依据等。

综上，本基金将分析科创板相关企业所处产业的发展阶段、企业自身的发展阶段、当前商业模式以及相关业务指标进行综合估值，以辅助投资决策。

#### （6）战略配售策略

本基金将积极关注并深入分析和论证战略配售股票的投资机会，基于对宏观经济与行业发展、资本市场及科技创新发展趋势的深入分析和理解，结合未来市场走势判断，精选具有估值优势和成长空间的企业，以战略配售方式参与具有长期发展潜力的优质公司，分享公司成长及价值实现的红利，以追求基金资产的长期稳定增值。战略配售策略仅在封闭运作期内使用，且本基金剩余封闭运作期应长于战略配售股票的锁定期。

#### 3、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。

#### 4、债券投资策略

本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。

|        |   |
|--------|---|
|        | <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>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、融资及转融通投资策略</p> <p>本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。</p> <p>为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%(经汇率估值调整)+中证综合债指数收益率×20%  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金以战略配售为投资策略，需参与并接受发行人战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。  |
| 基金管理人  | 鹏华基金管理有限公司  |
| 基金托管人  | 上海浦东发展银行股份有限公司  |

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7月1日-2023年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | -259,349,951.55           |
| 2. 本期利润         | -616,101,127.42           |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1331                   |
| 4. 期末基金资产净值     | 2,045,688,878.58          |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.4311                    |

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

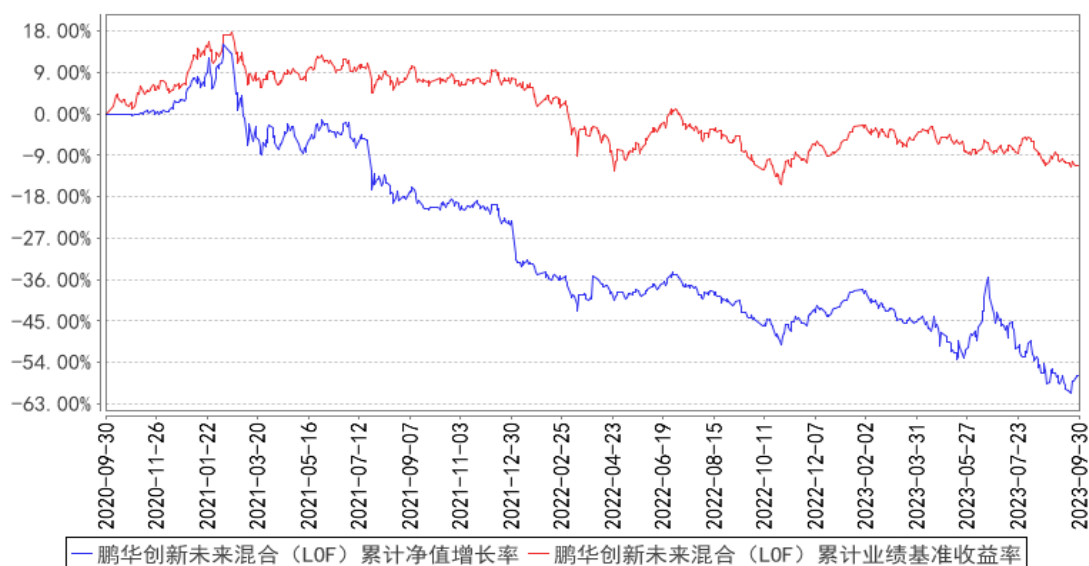
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | -24.04%    | 2.56%         | -3.45%         | 0.71%                 | -20.59% | 1.85% |
| 过去六个月          | -21.45%    | 2.71%         | -6.84%         | 0.68%                 | -14.61% | 2.03% |
| 过去一年           | -22.13%    | 2.11%         | -0.21%         | 0.77%                 | -21.92% | 1.34% |
| 过去三年           | -56.89%    | 1.53%         | -11.01%        | 0.87%                 | -45.88% | 0.66% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -56.89%    | 1.53%         | -11.09%        | 0.87%                 | -45.80% | 0.66% |

注：业绩比较基准=中证 800 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中证综合债指数收益率×20%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

鹏华创新未来混合（LOF）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2020年09月30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 |        |  |
| 闫思倩 | 基金经理 | 2023-03-25  | -    | 13年    | 闫思倩女士，国籍中国，工程硕士，13年证券从业经验。曾任华创证券分析师，中银国际证券业务经理，工银瑞信基金研究部基金经理。2022年1月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任权益投资三部总经理/投资总监/基金经理。2022年05月至今担任鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022年07月至今担任鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金基金经理，2023年03月至今担任鹏华创新未来混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2023年05月至今担任鹏华碳中和主题混合型证券投资基金基金经理，闫思倩女士具备基金从业资格。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

3 季度以来，股票市场处于磨底的过程中，7 月开始政策刺激很有诚意，化债与地产放松相信接下来都带来数据改善。市场在寻找政策底、市场底、以及经济底。外资的流出体现市场处于短期、中期、长期全面悲观的状态，这一次，对国内经济下滑的预期是全方面的，出口、地产、消费、人口增速、反腐、逆全球化等。但美国高利率以及高油价持续，软着陆之后，经济增速值得观察。而随着国内高端制程科技攻关突破，中美关系开始改善的迹象越来越明显，逆全球化的阻力预期有望修正，国内 4-5% 的经济增速仍是较高的增速，我们相信，随着悲观预期的充分体现，资本最终倾向于积极流入增长更高的国家。而对中国来讲，新的增长引擎，新旧动能转换成为更加中长期的事情。我们预期不再是消费、出口、投资，而是高端制造业与高科技创新。



创新未来基金的配置上，鉴于经济增速超预期空间不大，而华为 Mate60 新机超预期，中美关系有望缓解。更看好高端制造业与科技创新的机会，包括 AI 人工智能、新能源的新技术（钙钛矿等）、智能驾驶、机器人、高端制程突破、国产替代产业链、数据要素、卫星互联网等等。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华创新未来混合（LOF）份额净值增长率为-24.04%，同期业绩比较基准增长率为-3.45%。

#### 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              | 1,923,513,833.14 | 93.25        |
|    | 其中：股票             | 1,923,513,833.14 | 93.25        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 4,459,155.67     | 0.22         |
|    | 其中：债券             | 4,459,155.67     | 0.22         |
|    | 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      | 112,684,315.84   | 5.46         |
| 8  | 其他资产              | 22,030,822.99    | 1.07         |
| 9  | 合计                | 2,062,688,127.64 | 100.00       |

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 21,411,235.56 元，占净值比 1.05%。

### 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        | 539,049.00       | 0.03         |
| B  | 采矿业             | 99,271.88        | 0.00         |
| C  | 制造业             | 1,473,060,790.58 | 72.01        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应 | 346,371.73       | 0.02         |

|   | 业               |                  |       |
|---|-----------------|------------------|-------|
| E | 建筑业             | 115,179.14       | 0.01  |
| F | 批发和零售业          | 1,625,538.18     | 0.08  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 33,973.92        | 0.00  |
| H | 住宿和餐饮业          | -                | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 418,563,114.89   | 20.46 |
| J | 金融业             | 96,689.04        | 0.00  |
| 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      | 5,252,336.39     | 0.26  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 209,643.87       | 0.01  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -                | -     |
| P | 教育              | -                | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | 885,222.21       | 0.04  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 306,922.75       | 0.02  |
| S | 综合              | 968,494.00       | 0.05  |
|   | 合计              | 1,902,102,597.58 | 92.98 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）     | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|---------------|--------------|
| 原材料      | -             | -            |
| 能源       | 2,086.42      | 0.00         |
| 金融       | -             | -            |
| 非日常生活消费品 | 9,499,856.34  | 0.46         |
| 日常消费品    | 6,035.02      | 0.00         |
| 医疗保健     | 11,903,257.78 | 0.58         |
| 信息技术     | -             | -            |
| 通信服务     | -             | -            |
| 房地产      | -             | -            |
| 工业       | -             | -            |
| 公用事业     | -             | -            |
| 合计       | 21,411,235.56 | 1.05         |

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

### 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  | 601138 | 工业富联 | 6,321,800 | 124,539,460.00 | 6.09         |
| 2  | 688111 | 金山办公 | 326,889   | 121,210,441.20 | 5.93         |
| 3  | 300394 | 天孚通信 | 1,220,328 | 115,931,160.00 | 5.67         |
| 4  | 002230 | 科大讯飞 | 2,229,602 | 112,951,637.32 | 5.52         |

|    |        |       |           |                |      |
|----|--------|-------|-----------|----------------|------|
| 5  | 300308 | 中际旭创  | 929,365   | 107,620,467.00 | 5.26 |
| 6  | 300502 | 新易盛   | 2,328,365 | 107,104,790.00 | 5.24 |
| 7  | 688256 | 寒武纪-U | 707,338   | 87,674,545.10  | 4.29 |
| 8  | 688025 | 杰普特   | 988,354   | 73,741,091.94  | 3.60 |
| 9  | 300258 | 精锻科技  | 3,953,566 | 62,387,271.48  | 3.05 |
| 10 | 603662 | 柯力传感  | 1,900,400 | 61,363,916.00  | 3.00 |

#### 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） | 4,459,155.67 | 0.22         |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 4,459,155.67 | 0.22         |

#### 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  | 113661 | 福 22 转债 | 39,480 | 4,459,155.67 | 0.22         |

#### 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合

约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

## 5.10 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   | 1,120,600.59  |
| 2  | 应收证券清算款 | 20,147,473.89 |
| 3  | 应收股利    | 64.33         |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 762,684.18    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 22,030,822.99 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 113661 | 福 22 转债 | 4,459,155.67 | 0.22         |

### 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

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 4,499,427,630.34 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 571,743,811.97   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 325,793,316.13   |
| 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               | 4,745,378,126.18 |

## § 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）《鹏华创新未来混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- （二）《鹏华创新未来混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- （三）《鹏华创新未来混合型证券投资基金（LOF）2023 年第 3 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 10 月 24 日