

鹏华上华一年持有期混合型证券投资基金 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	鹏华上华一年持有期混合
基金主代码	013353
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 28 日
报告期末基金份额总额	872,312,725.67 份
投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，合理配置债券等固定收益类资产和权益类资产，追求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、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、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、信用债投资策略、可转债投资策略及可交换债券投资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>（1）久期策略</p>

久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。

(2) 收益率曲线策略

收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。

(3) 骑乘策略

本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。

(4) 息差策略

本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。

(5) 个券选择策略

本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。

(6) 信用债投资策略

本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。其中，本基金投资信用债的评级范围为 AA 至 AAA，投资于各个信用等级信用债占信用债资产的比例如下：

信用等级 占比

AAA 50%-100%

AA+ 0%-50%

AA 0%-20%

本基金持有信用债期间，如果其评级下降、不再符合上述约定，应在评级报告发布之日起 3 个月内调整至符合约定。

(7) 可转债投资策略及可交换债券投资策略

1) 传统可转债投资策略

传统可转债即可转换公司债券，兼具债权和股权双重属性。债权属性是指投资者可以选择持有可转债到期，得到本金与利息收益；股权属性即股票期权属性，是指投资者可以在转股期间以约定的转股价格把可转债转换成股票。因此，可转债的价格由债权价格和期权价格两部分组成。

a. 个券选择策略。一方面，本基金将对所有可转债对应的标的股票进行深入研究，采用定性分析（行业地位、竞争优势、治理结构、市场开拓、创新能力等）与定量分析（P/B、P/E、PEG、DCF、DDM、NAV 等）相结合

的方式挑选成长性好且估值合理的正股；另一方面，本基金将深入研究分析可转债自身的信用评估。综上所述，本基金将结合可转债自身的信用评估和其正股的价值分析，作为选取个券的重要依据。

b. 条款价值发现策略。可转债一般均设有一些特殊条款，包括修正转股价条款、回售条款、赎回条款等，这些条款在特定环境下对可转债价值有着较大的影响。本基金将通过有效分析相关信息力争把握各项条款给可转债带来的可能的投资机会。

c. 套利策略。可转债可以按照约定的价格转换为股票，因此在日常交易运作过程中会出现可转债与标的股票之间的套利机会。当处于转股期内的可转债市价低于转股价值，即可转债的转换溢价率为负时，买入可转债的同时卖出标的股票可以获得套利价差；反之，买入标的股票的同时卖出可转债也可以获取反向套利价差。在日常交易运作中，本基金将密切关注可转债与标的股票之间价格之间的对比关系，择机实施套利策略，以增强本基金的收益。

2) 分离交易可转债投资策略

本基金在对这类债券基本情况进行研究的同时，将重点分析附权部分对债券估值的影响。对于分离交易可转债的债券部分将按照债券投资策略进行管理，权证部分将在可交易之日起不超过 3 个月的时间内卖出。

3) 可交换债券投资策略

可交换债券具有股性和债性，其中债性，即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息；而对于股性的分析则需关注目标公司的股票价值。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。

4) 可转债及可交换债券投资比例

本基金投资于可转换债券及可交换债券资产的比例不高于基金资产的 20%。

3、股票投资策略

本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的公司，构建股票投资组合。本基金将重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素等因素进行自上而下的行业遴选；同时结合对上市公司的竞争力分析、管理层分析等定性分析和对上市公司的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）等定量分析进行自下而上的个股精选。

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：

- 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；

	<p>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> <p>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。</p> <p>5、国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>6、股指期货投资策略 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>7、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。</p> <p>8、参与融资业务策略 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。 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	中证综合债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%（经汇率估值调整）
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，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	上海银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	鹏华上华一年持有期混合 A	鹏华上华一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	013353	013354
报告期末下属分级基金的份额总额	871,214,487.74 份	1,098,237.93 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

§ 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）	
	鹏华上华一年持有期混合 A	鹏华上华一年持有期混合 C
1. 本期已实现收益	-13,407,946.74	-17,247.25
2. 本期利润	-20,272,582.60	-25,513.14
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0212	-0.0228
4. 期末基金资产净值	856,814,853.66	1,067,127.26
5. 期末基金份额净值	0.9835	0.9717

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

鹏华上华一年持有期混合 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	-2.14%	0.16%	-0.32%	0.18%	-1.82%	-0.02%
过去六个月	-2.86%	0.20%	0.22%	0.17%	-3.08%	0.03%
过去一年	-2.47%	0.20%	2.78%	0.21%	-5.25%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-1.65%	0.19%	1.76%	0.22%	-3.41%	-0.03%

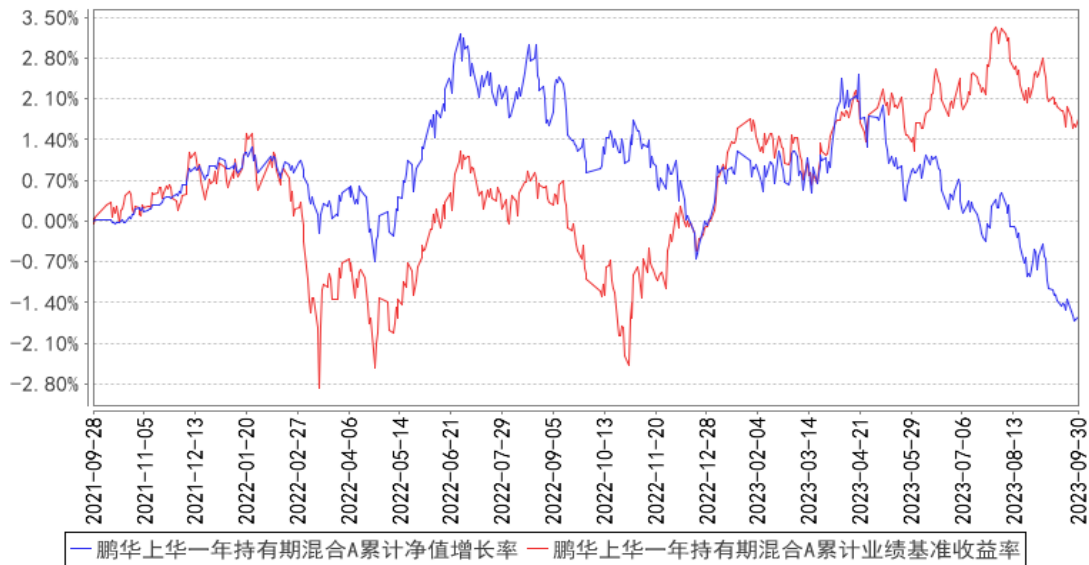
鹏华上华一年持有期混合 C

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	-2.28%	0.16%	-0.32%	0.18%	-1.96%	-0.02%
过去六个月	-3.16%	0.20%	0.22%	0.17%	-3.38%	0.03%
过去一年	-3.05%	0.20%	2.78%	0.21%	-5.83%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-2.83%	0.19%	1.76%	0.22%	-4.59%	-0.03%

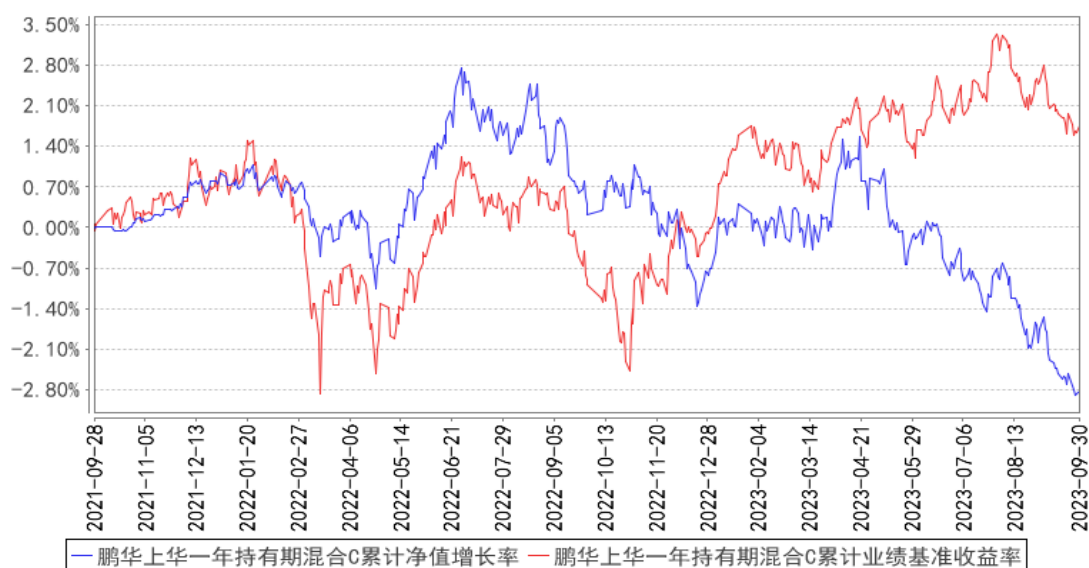
注：业绩比较基准=中证综合债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%
(经汇率估值调整)

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

鹏华上华一年持有期混合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



鹏华上华一年持有期混合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图



注：1、本基金基金合同于 2021 年 09 月 28 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		
汪坤	基金经理	2021-09-28	-	9 年	汪坤先生，国籍中国，金融学硕士，9 年证券从业经验。2014 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任固定收益部债券研究员、高级债券研究员，专户债券投资部投资经理，现担任混合资产投资部总经理助理/基金经理。2020 年 08 月至今担任鹏华招华一年持有期混合型证券投资基金基金经理，2021 年 01 月至 2023 年 04 月担任鹏华安享一年持有期混合型证券投资基金基金经理，2021 年 02 月至 2022 年 03 月担任鹏华安裕 5 个月持有期混合型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华宁华一年持有期混合型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华民丰盈和 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理，2021 年 04 月至

					今担任鹏华招润一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 09 月至今担任鹏华安诚混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 09 月至今担任鹏华上华一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 10 月至 2023 年 04 月担任鹏华安源 5 个月持有期混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 10 月至今担任鹏华安康一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 04 月至今担任鹏华悦享一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 汪坤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

三季度我们看到了宏观经济阶段性企稳，以及地产、化债方面的政策逐步出台，在商品端也看到了部分企业减缓去库的行为，长端利率品在上述背景下先下后上三季度整体震荡，短端多因素共振出现了一定的上行。展望四季度，我们认为政策预期仍在，尤其是财政端思路或出现一定的改变，对经济有正向作用；地产方面则仍未看到自发企稳，前期政策效果仍有待检验，仍然是宏观经济中较值得关注的方向；同时我们关注到离岸市场利率水平持续偏高，或对境内短端有一定干扰。预计利率投资者将在政策和现实间寻求平衡点，关注对明年的经济表述及增速目标。

权益方面，三季度权益市场表现偏弱，主要宽基指数收跌，上证指数下跌 2.9%，沪深 300 下跌 4%，创业板指下跌 9.5%。三季度由于美债收益率持续上升，以及二季度以来经济复苏斜率放缓、地产市场表现低迷，叠加北上资金持续流出，压制了国内股市。但是我们看到 7 月的政治局会议之后，国内稳增长以及活跃资本市场的政策不断出台，包括地产政策边际放松，地方政府再融资债开始发行，股票市场降低印花税，以及在资本市场规则方面持续进行政策协调，我们认为这些积极因素在持续累积，权益市场情绪后续或逐步好转。同时，我们看到产业层面，积极因素在持续增加，汽车销量保持较好的水平，新能源车渗透率持续提升，同时智能化水平明显提升，新能源车的下半场智能化的大幕已经徐徐拉开；华为 Mate60 回归，“遥遥领先”重回各个社交媒体，国内消费电子和半导体领域迎来重大变化，对整体产业和信心都有明显的提振；AI 浪潮继续在全球上演，国内大模型牌照发放，海外操作系统和办公软件的 AI 应用加速推进，人工智能助手成为了各家公司重点发展的方向，AI 未来几年有可能深刻改变我们的生活。而三季度压制全球股市的重要因素美债收益率在国庆期间突破 4.8%，美债期限利差大幅缩小，美债对于美国经济不衰退进行了充分的重定价，当前定价更加充分后，对国内股市的冲击大概率也会减小。我们看到政策、基本面、流动性都持续积极的变化，权益市场后续行情依然可以期待。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华上华一年持有期混合 A 份额净值增长率为-2.14%，同期业绩比较基准增长率为-0.32%，鹏华上华一年持有期混合 C 份额净值增长率为-2.28%，同期业绩比较基准增长率为-0.32%。

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	167,323,274.70	16.49
	其中：股票	167,323,274.70	16.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	818,581,269.95	80.67
	其中：债券	818,581,269.95	80.67
	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	-4,144.50	-0.00
	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	24,112,947.62	2.38
8	其他资产	4,731,369.43	0.47
9	合计	1,014,744,717.20	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 10,858,788.36 元，占净值比 1.27%。

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	13,339,800.00	1.55
C	制造业	70,979,821.44	8.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,563.97	0.00
E	建筑业	4,475,621.83	0.52
F	批发和零售业	2,535,811.30	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	3,179,214.60	0.37
H	住宿和餐饮业	2,737,942.00	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	85,571.74	0.01
J	金融业	45,261,354.00	5.28
K	房地产业	11,391,764.00	1.33
L	租赁和商务服务业	850,122.00	0.10
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	21,185.46	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,572,714.00	0.18

S	综合	-	-
	合计	156,464,486.34	18.24

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	-	-
金融	9,845,885.43	1.15
非日常生活消费品	1,012,902.93	0.12
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
信息技术	-	-
通信服务	-	-
房地产	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
合计	10,858,788.36	1.27

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	601288	农业银行	1,759,500	6,334,200.00	0.74
1	01288	农业银行	663,000	1,776,494.97	0.21
2	601398	工商银行	1,162,500	5,440,500.00	0.63
2	01398	工商银行	749,000	2,591,139.36	0.30
3	601318	中国平安	89,000	4,298,700.00	0.50
3	02318	中国平安	36,000	1,481,605.40	0.17
4	601939	建设银行	833,900	5,253,570.00	0.61
5	600266	城建发展	825,800	5,219,056.00	0.61
6	601601	中国太保	168,700	4,823,133.00	0.56
7	600030	中信证券	222,000	4,808,520.00	0.56
8	02628	中国人寿	357,000	3,996,645.70	0.47
9	601377	兴业证券	612,900	3,934,818.00	0.46
10	000786	北新建材	125,900	3,783,295.00	0.44

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	45,693,086.30	5.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	508,841,263.42	59.31

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	81,085,437.04	9.45
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	182,961,483.19	21.33
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	818,581,269.95	95.42

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	1928031	19广发银行永续债	600,000	60,995,606.56	7.11
2	2028051	20浦发银行永续债	500,000	53,789,109.59	6.27
3	019688	22国债23	450,000	45,693,086.30	5.33
4	2120110	21北京银行永续债02	400,000	41,827,040.00	4.88
5	2028003	20平安银行永续债01	400,000	41,379,824.66	4.82

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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：无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：无。

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

北京银行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北京外汇管理部、中国银行保险监督管理委员会北京监管局的处罚。

广发银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。

平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行的处罚。

中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行的处罚。

中信建投证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行的处罚。

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	498,886.75

2	应收证券清算款	4,205,698.68
3	应收股利	26,784.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,731,369.43

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	鹏华上华一年持有期混合 A	鹏华上华一年持有期混合 C
报告期期初基金份额总额	1,035,404,928.67	1,200,646.98
报告期期间基金总申购份额	236,770.05	-
减：报告期期间基金总赎回份额	164,427,210.98	102,409.05
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	871,214,487.74	1,098,237.93

§ 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）《鹏华上华一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华上华一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华上华一年持有期混合型证券投资基金 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