

# 鹏安核心科技混合型发起式证券投资基金

## 2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 月 30 日

基金管理人:鹏安基金管理有限公司

基金托管人:上海农村商业银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 10 月 27 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海农村商业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年07月01日起至2026年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

|             |                                                                                               |               |
|-------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|
| 基金简称        | 鹏安核心科技混合发起式                                                                                   |               |
| 基金主代码       | 027074                                                                                        |               |
| 基金运作方式      | 开放式                                                                                           |               |
| 基金合同生效日     | 2026 年 06 月 02 日                                                                              |               |
| 报告期末基金份额总额  | 12,108,856.91 份                                                                               |               |
| 投资目标        | 本基金通过灵活运用多种投资策略，把握市场机会，在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益，力争实现基金资产的长期稳健增值。                          |               |
| 投资策略        | 1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券投资策略；5、可转债和可交债投资策略；6、衍生品投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、融资投资策略           |               |
| 业绩比较基准      | 中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%                                |               |
| 风险收益特征      | 本基金为混合型基金，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。本基金如投资港股通标的股票，还需承担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       | 鹏安基金管理有限公司                                                                                    |               |
| 基金托管人       | 上海农村商业银行股份有限公司                                                                                |               |
| 下属分级基金的基金简称 | 鹏安核心科技混合发起式 A                                                                                 | 鹏安核心科技混合发起式 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 027074                                                                                        | 027075        |

|                 |                                                                                               |                                                                                               |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 11,009,730.20 份                                                                               | 1,099,126.71 份                                                                                |
| 下属分级基金的风险收益特征   | 本基金为混合型基金，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。本基金如投资港股通标的股票，还需承担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。 | 本基金为混合型基金，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。本基金如投资港股通标的股票，还需承担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。 |

§ 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（2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日） |               |
|-----------------|----------------------------------------|---------------|
|                 | 鹏安核心科技混合发起式 A                          | 鹏安核心科技混合发起式 C |
| 1. 本期已实现收益      | -2,044,658.22                          | -206,620.70   |
| 2. 本期利润         | -5,528,019.03                          | -557,632.96   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.5021                                | -0.5033       |
| 4. 期末基金资产净值     | 7,962,256.52                           | 793,937.07    |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.7232                                 | 0.7223        |

注：1、本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或者交易基金的各项费用（例如基金申购、赎回、转换等费用），计入费用后实际利润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

鹏安核心科技混合发起式 A 净值表现

| 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          | -40.98%    | 3.73%         | -20.80%        | 2.19%                 | -20.18% | 1.54% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | -27.68%    | 3.61%         | -11.25%        | 2.20%                 | -16.43% | 1.41% |

注：本基金合同生效日为 2026 年 6 月 2 日。

鹏安核心科技混合发起式 C 净值表现

| 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 |
|----|------------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
|----|------------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|

|            |         |       |         | 准差④   |         |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去三个月      | -41.03% | 3.72% | -20.80% | 2.19% | -20.23% | 1.53% |
| 自基金合同生效起至今 | -27.77% | 3.61% | -11.25% | 2.20% | -16.52% | 1.41% |

注：本基金合同生效日为 2026 年 6 月 2 日。

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

鹏安核心科技混合发起式A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2026年06月02日-2026年09月30日)



鹏安核心科技混合发起式C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2026年06月02日-2026年09月30日)



§ 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<br>理期限 |          | 证<br>券<br>从<br>业<br>年<br>限 | 说明                                                                                                                                            |
|-----|----------------------|-----------------|----------|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                      | 任职日期            | 离任<br>日期 |                            |                                                                                                                                               |
| 蒋晓锋 | 本基金的基金经理、投资<br>部副总经理 | 2026-06-02      | -        | 18<br>年                    | 蒋晓锋先生，中国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中邮证券有限责任公司投资经理，国新国证基金管理有限公司权益投资部负责人、权益研究部负责人、基金经理。2025年3月加入鹏安基金管理有限公司，现任鹏安核心优选混合型发起式证券投资基金、鹏安核心科技混合型发起式证券投资基金基金经理。 |
| 花洁  | 本基金的基金经理             | 2026-06-02      | -        | 9 年                        | 花洁女士，中国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任职于深圳嘉石大岩私募证券基金管理有限公司、深圳前海博普资产管理有限公司，历任权益投资研究员、投资经理。2024年9月加入鹏安基金管理有限公司，曾任专户业务部投资经理，现任鹏安核心科技混合型发起式证券投资基金基金经理。        |

注：1. “任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“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的相关规定。

3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及有关规定，建立公司内部的公平交易管理制度体系，从研究分析、投资决策、交易执行、事后稽核等环节进行严格规范，通过系统和人工相结合的方式在投资管理活动各环节贯彻和执行公平交易管理制度，以确保公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，防范不公平交易和利益输送行为。

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司公平交易管理的相关制度等的有关规定，未发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发生本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% 的情形，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，在本轮 AI 产业周期发展过程中，全球科技资产出现市场价格表现与基本面情况显著分化的情形。统计区间为 6 月 30 日至 9 月 30 日收盘，纳斯达克综合指数上涨 2.47%、标普 500 上涨 2.03%、纳斯达克 100 上涨 0.44%，上述指数均于 9 月下旬创出阶段新高；费城半导体指数下跌 11.36%，韩国 KOSPI 指数下跌 19.33%，A 股创业板指下跌 27.80%、科创 50 下跌 30.70%。进入 10 月后相关指数回调幅度进一步扩大，科创 50 出现较大幅度调整。从产业数据来看，8 月规模以上电子信息制造业营业收入同比增速约 25%（1-8 月累计同比 20%，7 月单月同比 24.7%）；8 月全球半导体月度销售额同比大幅增长，环比增长 8%，GPU 租赁价格、存储合约价格环比延续上行，主要云厂商资本开支未见明显放缓，市场股价表现与产业经营数据出现明显分化。

我们分析，上述分化主要来自贴现率重定价、交易结构被动出清、市场对部分产业叙事产生担忧三方面因素叠加，共同带来高估值成长资产久期层面的收缩。企业盈利端并未出现趋势性下行，但前期市场上涨已经较多反映乐观预期。三季度宏观环境成为市场主要压制因素，美联储重启加息，长端美债收益率整体上行约 75-80 个基点，成为市场调整的重要诱因；韩国杠杆 ETF 交易踩踏、A 股 TMT 板块交易拥挤度处于历史高位、国内 IPO 带来的资金分流效应进一步放大市场波动；Meta 计划对外出租算力、部分云厂商自由现金流转负、中报业绩落地后市场解读为利好兑现，多重因素共同作用下，本轮回调幅度超出市场前期预期。从估值角度分析，三季度 A 股科技板块估值下行，一方面来源于股价调整，另一方面也包含盈利增长带来的影响。对于强周期行业，PE 快速回落既可能代表估值消化，也有可能是盈利景气见顶的信号，需要结合订单、产品价格、产能扩张等指标持续跟踪验证。从本基金跟踪的相关指标观察，结合当期盈利兑现水平以及 2026-2027 年订单能见度情况来看，市场悲观情绪阶段性释放，部分标的出现阶段性非理性下跌情形。

海外宏观层面，三季度美国经济呈现经济韧性较强、通胀水平偏高、就业保持温和的特征。美联储具备维持政策收紧的现实基础，降息的紧迫性有所减弱。9 月 16 日议息会议全票通过加息 25 个基点，为 2023 年 7 月之后首次加息；点阵图将 2026 年末利率中值由 3.8% 上调至 4.1%，2027 年利率中值维持 4.1%。对于成长风格特别是科技板块，上述变化带来贴现率曲线整体抬升，政策路径

不确定性有所增加。三季度美债收益率曲线近乎平行上移约 75-80 个基点(10 年期由 4.48%升至 5.29%、30 年期由 4.91%升至 5.64%)。9 月加息落地后的市场反弹建立在盈利预期上修的基础之上，这也是美股与 A 股 9 月行情出现分化的重要原因。但加息落地并未带动利率下行，10 年期美债收益率在 9 月 16 日-9 月 30 日再度上行 28 个基点，进一步压制全球市场风险偏好，科技板块整体承压。

国内宏观方面，三季度 GDP 同比增长 4.5%，较二季度小幅回升；PMI 由 7 月 49.2 回升至 9 月 50.1，重回扩张区间；工业增加值同比由 4.5%提升至 5.5%。价格端呈现结构性分化，CPI 同比由 0.5% 升至 0.9%，核心 CPI 为 1.0%，终端内需仍偏弱；PPI 同比由 3.5%快速上行至 5.0%，创 2022 年 6 月以来的较高涨幅，主要受上游资源品、AI 相关中间品涨价向工业领域传导带动。以美元计价口径，出口同比由 7 月 23.9%、8 月 24.9%提升至 9 月 36.3%，9 月出口规模 4471.8 亿美元，创历史单月新高，其中集成电路 9 月出口 449.51 亿美元，同比增长 136%。消费、信用修复相对偏弱，整体经济并未失速，但内需修复力度尚不足以支撑市场风险偏好全面扩张，外需、科技制造是当前阶段盈利支撑的主要线索。

落脚科技产业本身，三季度科技板块呈现企业盈利端景气延续、市场贴现端条件收紧的格局。产业层面仍可观察到长约锁定、产品涨价延续、订单预期上修、产能持续扩张等现象，海外科技巨头财报整体维持增长。但市场对业绩的考核标准有所抬升，在高基数环境下，业绩大幅超预期难度加大；同时能够验证 AI 商业化落地的跟踪指标相对有限，叠加大模型 ARR 统计口径、开源与闭源赛道竞争等扰动因素，市场整体情绪较为脆弱。综合以上宏观环境研判与产业跟踪情况，科技板块当期股价已经出现较大幅度调整，后续行情演绎的核心仍在于盈利兑现能力。四季度市场或更多体现为结构性业绩修复行情，不代表对市场收益的预测，系统性估值扩张的条件尚不充分。本基金将持续紧密跟踪产业基本面变化，投资配置将进一步向业绩确定性较强、现金流自给能力较好的产业链环节倾斜。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末鹏安核心科技混合发起式 A 基金份额净值为 0.7232 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-40.98%，同期业绩比较基准收益率为-20.80%；截至报告期末鹏安核心科技混合发起式 C 基金份额净值为 0.7223 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-41.03%，同期业绩比较基准收益率为-20.80%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用。

§ 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              | 8,130,998.82 | 92.11  |
|   | 其中：股票             | 8,130,998.82 | 92.11  |
| 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      | 696,262.98   | 7.89   |
| 8 | 其他资产              | 300.00       | 0.00   |
| 9 | 合计                | 8,827,561.80 | 100.00 |

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 819,361.89 元，占基金资产净值的比例为 9.36%。

## 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              | 5,813,084.52 | 66.39        |
| 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           | 750,876.00   | 8.58         |
| 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  | 747,676.41   | 8.54         |
| 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               | 7,311,636.93 | 83.50        |

**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（%） |
|------|------------|--------------|
| 信息技术 | 819,361.89 | 9.36         |
| 合计   | 819,361.89 | 9.36         |

**5.3 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  | 600460 | 士兰微  | 24,800 | 762,600.00 | 8.71         |
| 2  | 300475 | 香农芯创 | 4,900  | 750,876.00 | 8.58         |
| 3  | 688256 | 寒武纪  | 741    | 747,676.41 | 8.54         |
| 4  | 603986 | 兆易创新 | 2,100  | 743,190.00 | 8.49         |
| 5  | 00981  | 中芯国际 | 14,000 | 728,884.42 | 8.32         |
| 6  | 300604 | 长川科技 | 2,900  | 695,391.00 | 7.94         |
| 7  | 300408 | 三环集团 | 5,700  | 668,781.00 | 7.64         |
| 8  | 600176 | 中国巨石 | 15,800 | 622,678.00 | 7.11         |
| 9  | 688627 | 精智达  | 1,465  | 619,402.00 | 7.07         |
| 10 | 688347 | 华虹宏力 | 1,881  | 391,097.52 | 4.47         |
| 11 | 01347  | 华虹宏力 | 1,000  | 90,477.47  | 1.03         |

注：对于同时在 A+H 上市的股票，合并计算公允价值与排序，并按照不同股票分别披露。

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

注：本基金本报告期末未持有债券。

**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：本基金本报告期末未持有债券。

**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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**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：本基金本报告期末未持有贵金属。

**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：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

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受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金报告期内投资的前十名证券的发行主体，未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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)  |
|----|---------|--------|
| 1  | 存出保证金   | -      |
| 2  | 应收证券清算款 | -      |
| 3  | 应收股利    | -      |
| 4  | 应收利息    | -      |
| 5  | 应收申购款   | 300.00 |
| 6  | 其他应收款   | -      |
| 7  | 其他      | -      |
| 8  | 合计      | 300.00 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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，本报告中涉及比例计算的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

|                               | 鹏安核心科技混合发起式 A | 鹏安核心科技混合发起式 C |
|-------------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 11,011,006.11 | 1,111,165.44  |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 24,738.84     | 17,008.42     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 26,014.75     | 29,047.15     |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>（份额减少以“-”填列） | -             | -             |
| 报告期期末基金份额总额                   | 11,009,730.20 | 1,099,126.71  |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

单位：份

|                              | 鹏安核心科技混合发起式 A | 鹏安核心科技混合发起式 C |
|------------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额             | 10,020,000.00 | -             |
| 报告期期间买入/申购总份额                | -             | -             |
| 报告期期间卖出/赎回总份额                | -             | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额             | 10,020,000.00 | -             |
| 报告期期末持有的本基金份额<br>占基金总份额比例（%） | 82.75         | -             |

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件的有关规定支付。  
申购份额包括红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额；赎回份额包括转换出份额、因份额合并而减少的份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份额<br>承诺持有<br>期限 |
|-------------|---------------|----------------------|---------------|----------------------|--------------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,020,000.00 | 82.75%               | 10,020,000.00 | 82.75%               | 不少于三年              |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -                    | -             | -                    | -                  |
| 基金经理等人员     | -             | -                    | -             | -                    | -                  |

|         |               |        |               |        |       |
|---------|---------------|--------|---------------|--------|-------|
| 基金管理人股东 | -             | -      | -             | -      | -     |
| 其他      | -             | -      | -             | -      | -     |
| 合计      | 10,020,000.00 | 82.75% | 10,020,000.00 | 82.75% | 不少于三年 |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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    |        |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------|---------------|------|------|---------------|--------|
|                                                                                                                                    | 序号             | 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                                                                                                                                 | 1              | 20260701-20260930       | 10,020,000.00 | -    | -    | 10,020,000.00 | 82.75% |
| 产品特有风险                                                                                                                             |                |                         |               |      |      |               |        |
| 本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，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、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位；  
2、申购份额包含申购、定期定额投资、转换转入、红利再投资或者买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出或者卖出等业务减少的份额。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1. 中国证监会准予鹏安核心科技混合型发起式证券投资基金注册的文件
- 2. 《鹏安核心科技混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3. 《鹏安核心科技混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4. 法律意见书
- 5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6. 中国证监会规定的其他文件

10.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

### 10.3 查阅方式

上述文件可在鹏安基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到鹏安基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏安基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-814-2888

网址:<http://www.penganfunds.com>

鹏安基金管理有限公司  
二〇二六年十月二十七日