

鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	鹏华中证一带一路主题指数(LOF)
场内简称	带路LOF
基金主代码	160638
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月18日
报告期末基金份额总额	227,595,661.10份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。本基金力争基金份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

业绩比较基准	中证一带一路主题指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,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	
下属分级基金的基金简称	鹏华中证一带一路主题指数(LOF)A	鹏华中证一带一路主题指数(LOF)C
下属分级基金的场内简称	带路 LOF	-
下属分级基金的交易代码	160638	015677
报告期末下属分级基金的份额总额	214,803,329.49份	12,792,331.61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(2023年7月1日-2023年9月30日)	
	鹏华中证一带一路主题指数(LOF)A	鹏华中证一带一路主题指数(LOF)C
1. 本期已实现收益	4,379,696.53	398,631.06
2. 本期利润	-14,634,666.52	-1,809,826.37
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0680	-0.0667
4. 期末基金资产净值	363,839,941.25	13,355,404.30
5. 期末基金份额净值	1.694	1.044

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

鹏华中证一带一路主题指数(LOF)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	-3.91%	0.87%	-5.18%	0.89%	1.27%	-0.02%
过去六个月	-2.92%	0.91%	-5.35%	0.92%	2.43%	-0.01%
过去一年	7.56%	0.96%	4.55%	0.97%	3.01%	-0.01%
过去三年	35.96%	1.16%	21.90%	1.16%	14.06%	0.00%
过去五年	67.21%	1.26%	31.42%	1.26%	35.79%	0.00%
自基金合同生效起至今	-20.98%	1.52%	-29.73%	1.51%	8.75%	0.01%

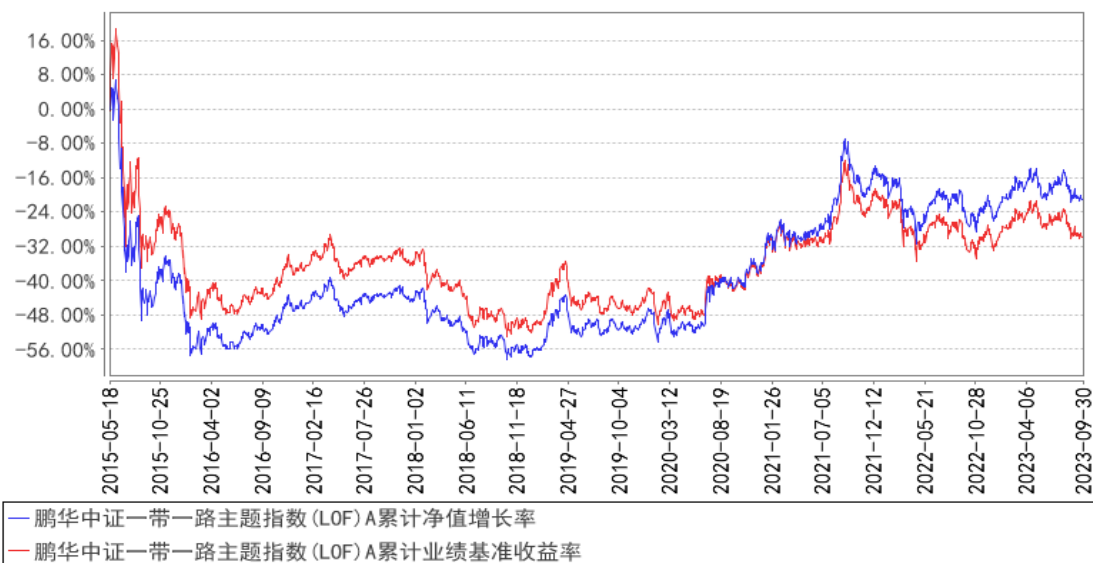
鹏华中证一带一路主题指数(LOF)C

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	-3.96%	0.87%	-5.18%	0.89%	1.22%	-0.02%
过去六个月	-3.06%	0.91%	-5.35%	0.92%	2.29%	-0.01%
过去一年	7.19%	0.96%	4.55%	0.97%	2.64%	-0.01%
自基金合同生效起至今	4.40%	0.99%	0.93%	1.00%	3.47%	-0.01%

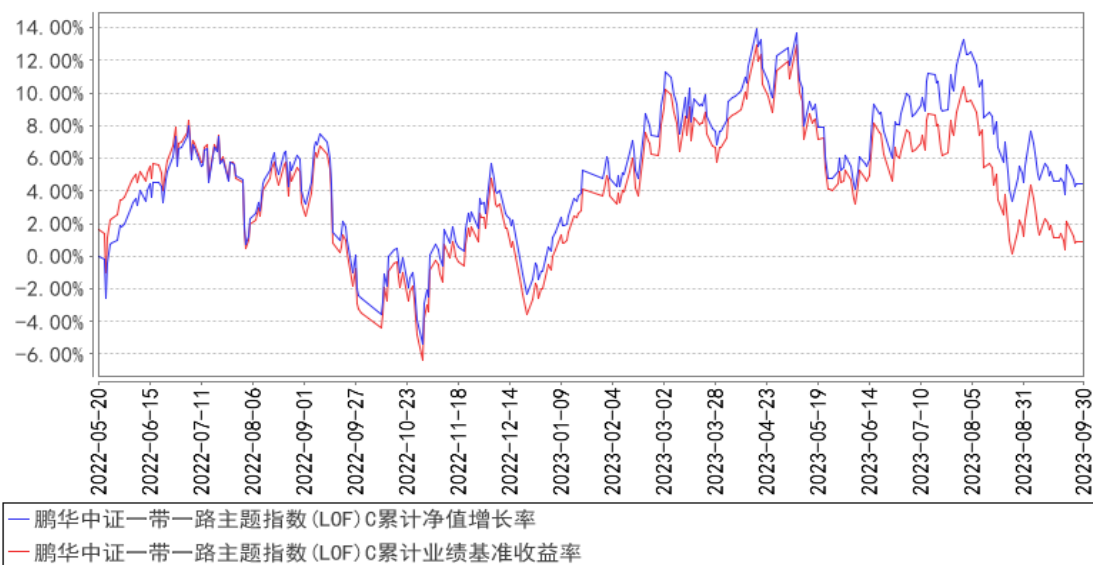
注：业绩比较基准=中证一带一路主题指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%

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

鹏华中证一带一路主题指数(LOF)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



鹏华中证一带一路主题指数(LOF)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2015年05月18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		

罗英宇	基金经理	2021-01-20	-	16年	<p>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，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，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指数型证券投资基金（LOF）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未发</p>
-----	------	------------	---	-----	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					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

报告期内，本产品采用完全复制的方法跟踪中证一带一路主题指数，努力将跟踪误差控制在合理范围。在此基础上，认真应对投资者日常申购、赎回和成份股调整等工作，并通过遵从严格的风险、合规管理流程，确保了本基金的安全运作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华中证一带一路主题指数（LOF）A 份额净值增长率为-3.91%，同期业绩比较基准增长率为-5.18%，鹏华中证一带一路主题指数（LOF）C 份额净值增长率为-3.96%，同期业绩比较基准增长率为-5.18%。

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	356,881,254.89	94.22
	其中：股票	356,881,254.89	94.22
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	20,904,752.12	5.52
8	其他资产	972,696.00	0.26
9	合计	378,758,703.01	100.00

注：报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 40,007,984.00 元，占基金资产净值比为 10.61%。

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	43,846,624.84	11.62
C	制造业	196,694,281.36	52.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,694,424.00	1.77
E	建筑业	56,186,331.46	14.90
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	28,930,299.31	7.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,398,211.81	2.76
J	金融业	1,202,920.00	0.32
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	10,098,941.00	2.68
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,446,425.20	0.38
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	355,498,458.98	94.25

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	1,108,887.47	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,224.19	0.00
F	批发和零售业	64,426.26	0.02
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	165,482.61	0.04
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	28,418.24	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	9,357.14	0.00
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	1,382,795.91	0.37

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	601857	中国石油	1,389,100	11,085,018.00	2.94
2	600028	中国石化	1,753,220	10,642,045.40	2.82
3	600089	特变电工	717,201	10,628,918.82	2.82
4	300308	中际旭创	91,200	10,560,960.00	2.80
5	601668	中国建筑	1,904,080	10,529,562.40	2.79
6	600406	国电南瑞	468,599	10,398,211.81	2.76
7	600031	三一重工	647,045	10,281,545.05	2.73
8	000063	中兴通讯	313,600	10,248,448.00	2.72
9	601899	紫金矿业	836,700	10,149,171.00	2.69
10	601888	中国中免	95,300	10,098,941.00	2.68

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	688539	高华科技	3,467	142,389.69	0.04
2	301559	中集环科	3,492	84,576.24	0.02
3	688657	浩辰软件	794	82,099.60	0.02
4	301487	盟固利	867	29,729.43	0.01
5	688249	晶合集成	1,765	29,246.05	0.01

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：本基金本报告期内未发生股指期货投资。

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

中国建筑股份有限公司在报告编制日前一年内受到衡水市交通运输局的处罚。

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	52,129.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	15,204.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	880,167.45
6	其他应收款	25,195.24
7	其他	-
8	合计	972,696.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601899	紫金矿业	3,117,410.00	0.83	转融通流通受限
2	601857	中国石油	2,186,520.00	0.58	转融通流通受限
3	600031	三一重工	1,477,770.00	0.39	转融通流通受限
4	600406	国电南瑞	1,375,780.00	0.36	转融通流通受限
5	000063	中兴通讯	669,940.00	0.18	转融通流通受限
6	300308	中际旭创	277,920.00	0.07	转融通流通受限

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688539	高华科技	142,389.69	0.04	新股流通受限
2	301559	中集环科	76,099.24	0.02	新股未上市
2	301559	中集环科	8,477.00	0.00	新股流通受限
3	688657	浩辰软件	73,827.60	0.02	新股未上市
3	688657	浩辰软件	8,272.00	0.00	新股流通受限
4	301487	盟固利	29,729.43	0.01	新股流通受限
5	688249	晶合集成	29,246.05	0.01	新股流通受限

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	鹏华中证一带一路主题指数 (LOF) A	鹏华中证一带一路主题指数 (LOF) C
报告期期初基金份额总额	217,732,904.22	36,282,784.63
报告期期间基金总申购份额	6,375,836.71	17,021,216.14
减：报告期期间基金总赎回份额	9,305,411.44	40,511,669.16
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	214,803,329.49	12,792,331.61

§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) 《鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- (二) 《鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(LOF)托管协议》；
- (三) 《鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(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

