

鹏华科技创新混合型证券投资基金

2023 年第 4 季度报告

2023 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 19 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 01 月 18 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 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称 | 鹏华科技创新混合 |
| 基金主代码 | 008811 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 1 月 15 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 186,454,961.98 份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，精选科技创新主题的优质企业进行投资，力求超额收益与长期资本增值。 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略 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。 2、股票投资策略 本基金通过发掘科技创新潮流，跟踪科技创新领域动向，投资于拥有长期成长性的企业。核心思路为：1）在产业层面，我们通过挖掘科技机遇，研判技术可研性、应用性，判断产业长期价值；2）把握企业核心技术能力，核心技术的特性为，具有不可复制性，是企业基于对产业、市场和用户的深刻洞察，以及环境长期孕育形成的，有独特的市场价值，能够解决重大的市场问题。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；3）具体到单一公司分析上，我们通过分析企业的核心竞争力、产业竞争格局和公司治理能力，综合判断公司基本面，同时结合企业 |

估值水平进行投资决策，深度研究和发掘成长期企业。

(1) 科技创新主题的定义 科技创新企业主要是指：坚持面向世界科技前沿、面向经济主战场、面向国家重大需求，符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业。本基金重点关注以下领域： 1) 新一代信息技术领域，主要包括半导体和集成电路、电子信息、下一代信息网络、人工智能、大数据、云计算、新兴软件、互联网、物联网和智能硬件等； 2) 高端装备领域，主要包括智能制造、航空航天、先进轨道交通、海洋工程装备及相关技术服务等； 3) 新材料领域，主要包括先进钢铁材料、先进有色金属材料、先进石化化工新材料、先进无机非金属材料、高性能复合材料、前沿新材料及相关技术服务等； 4) 新能源领域，主要包括先进核电、大型风电、高效光电光热、高效储能及相关技术服务等； 5) 节能环保领域，主要包括高效节能产品及设备、先进环保技术装备、先进环保产品、资源循环利用、新能源汽车整车、新能源汽车关键零部件、动力电池及相关技术服务等； 6) 生物医药领域，主要包括生物制品、高端化学药、高端医疗设备与器械及相关技术服务等； 7) 符合科创板定位的其他领域。

(2) 自下而上的个股选择 对于非科创板企业，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企业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续竞争优势。 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。

2) 定量分析 本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。本基金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、历史比较和成长性分析，确定具有上升基础的股价水平。

(3) 科创板股票投资策略 本基金投资于科创板中的相关企业。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，主动拥抱新经济。

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，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，选取具有明显成长性的优质赛道内的相关品种。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，我们将在以上相关领域内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。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，辅助投资决策。

（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将关注：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）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。

3、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。

（1）久期策略 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。

4、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。

5、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。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，基金管理人可相应调整，

| | |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 不需召开基金份额持有人大会。未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新。 |
| 业绩比较基准 | 中国战略新兴产业成份指数收益率×60%+中证沪港深互联网指数收益率×10%+中证综合债指数收益率×30% |
| 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 | 中国建设银行股份有限公司 |

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 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -4,508,242.38 |
| 2. 本期利润 | 11,963,074.98 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0632 |
| 4. 期末基金资产净值 | 232,023,657.53 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.2444 |

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

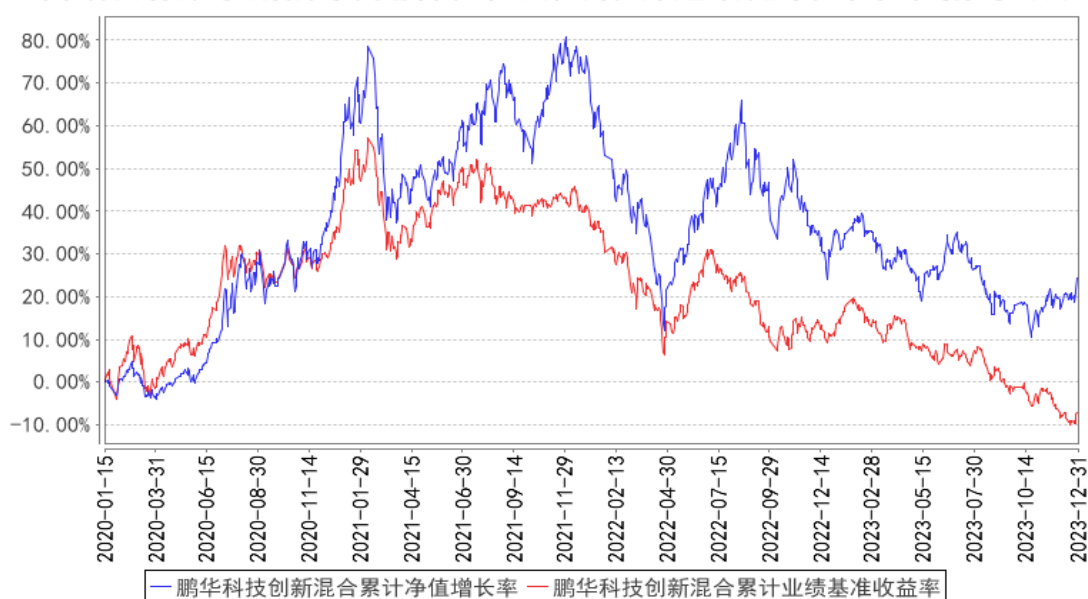
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 5.43% | 1.12% | -6.01% | 0.84% | 11.44% | 0.28% |
| 过去六个月 | -6.87% | 1.08% | -13.02% | 0.82% | 6.15% | 0.26% |
| 过去一年 | -5.01% | 1.08% | -16.10% | 0.80% | 11.09% | 0.28% |

| | | | | | | |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去三年 | -18.42% | 1.50% | -33.42% | 1.06% | 15.00% | 0.44% |
| 自基金合同 生效起至今 | 24.44% | 1.47% | -7.06% | 1.12% | 31.50% | 0.35% |

注：业绩比较基准=中国战略新兴产业成份指数收益率×60%+中证沪港深互联网指数收益率×10%+中证综合债指数收益率×30%

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

鹏华科技创新混合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 01 月 15 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 | | |
| 柳黎 | 基金经理 | 2020-08-29 | - | 7 年 | 柳黎先生，国籍中国，理学硕士，7 年证券从业经验。2016 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任研究部助理研究员、研究员、高级研究员，现担任研究部基金经理。2020 年 08 月至今担任鹏华科技创 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | | 新混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 11 月至今担任鹏华启航混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 11 月至今担任鹏华优质企业混合型证券投资基金基金经理, 柳黎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

四季度 A 股市场整体震荡触底，结构上延续轮动和切换：一方面，三季度表现靠前的顺周期、地产链，在短期经济数据的弱势验证下进入调整阶段；另一方面，随着联储降息预期加强和国产创新药出海顺利，医药在创新药带领下从反腐中走出，股价表现亮眼（虽然在年末遭遇波折）。电子行业股价表现也相对靠前，但相对于此前数年聚光灯下的半导体行业，更值得注意的是消费

电子在质疑中悄然发生的行业变化——以华为归来为节点，手机终端创新重启，产业链补库存动作明显，部分紧缺环节出现涨价；而以苹果 VisionPro 为代表的创新终端释放出更多乐观的产业信号，虽然一代产品定价、备货均显示当前对电子大盘拉动有限，但其硬件配置、空间计算能力和完善的开发者环境均显示这是一次重大的产业变革。

回顾过去一年历次季报、中报中的判断，我们基本做到了知行合一，在此也进一步更新我们的观点。

第一，我们在 7 月重要会议后对总量经济转向中性乐观，目前依然延续这一判断——政策层面在地产和化债两个方向均提出清晰的解决路线，而随着联储加息接近尾声、中美关系缓和，我们认为政策发力的窗口期愈发明确，“先立后破”迫在眉睫。但基于地产高光难再、外部环境的不确定性，我们无意单纯去博弈贝塔主导的地产链、顺周期品种，而是更加关注供给大幅出清或者有效优化的行业，或者具备提供差异化供给能力的企业，进而在宏观企稳时才能带来足够的业绩弹性，并且有效地规避“内卷”。这部分标的分散在电子、化工、机械等多个行业中，目前已部分体现在我们的持仓中。

第二，AIGC 具备坚实的产业基础，但本轮产业浪潮处在逆全球化中，思考需要升维；对核心算力、核心应用标的去做线性外推和单纯海外对标，实际上都有落空风险。但在视野之外的供应链层面，部分有竞争力的国内企业正在以前所未有的参与深度去参与到产业变革中，并将切实改善其盈利能力；此外，AIGC 有一定概率成为智能终端的新一代 killer-app，这值得我们对 PC、XR 甚至手机行业的变化格外关注，这将有机会带来稀缺的非线性增长机会。

第三，国内制造业升级、走出去正在发生，但我们也要修正观点——在复杂的地缘环境下，国内企业走出去的窗口也在逐步关闭；届时拥有海外产能、品牌美誉度且能充分享受全球需求红利的公司将更为稀缺，也更值得我们长期关注。

过去的一年市场一波三折，我们的组合表现也是。股票市场中投资者信心不足，常常被宏大叙事和路边传言扰动；而对微盘和量化策略的神化、对主动管理的质疑几乎到了钟摆的极值。我们坚信，即使是黄金年代也是带着记忆滤镜，而在极度悲观的时候更应选择乐观，没有什么“这次不一样”，周期的车轮始终滚滚向前，我们不能浪费任何一个危机。而在当前的估值水位和市场情绪下，我们在过去这个季度积极调整策略和持仓结构，以对波动更高的容忍性去寻找高赔率品种，我们坚信估值回归和价值发现的力量。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 5.43%，同期业绩比较基准增长率为-6.01%。

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 | 217,889,176.00 | 93.48 |
| | 其中：股票 | 217,889,176.00 | 93.48 |
| 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 | 15,082,991.38 | 6.47 |
| 8 | 其他资产 | 121,498.46 | 0.05 |
| 9 | 合计 | 233,093,665.84 | 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 16,473,049.67 元，占净值比 7.10%。

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 | 42,453.00 | 0.02 |
| C | 制造业 | 184,229,078.60 | 79.40 |
| 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 | - | - |
| 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 | 17,074,172.45 | 7.36 |
| 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 | 14,179.62 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 17,509.91 | 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 | 31,734.00 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 6,998.75 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 201,416,126.33 | 86.81 |

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 | - | - |
| 非日常生活消费品 | - | - |
| 日常消费品 | - | - |
| 医疗保健 | - | - |
| 信息技术 | 16,473,049.67 | 7.10 |
| 通信服务 | - | - |
| 房地产 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 合计 | 16,473,049.67 | 7.10 |

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 | 01415 | 高伟电子 | 736,000 | 15,373,841.06 | 6.63 |
| 2 | 600183 | 生益科技 | 828,600 | 15,171,666.00 | 6.54 |
| 3 | 300791 | 仙乐健康 | 296,800 | 10,287,088.00 | 4.43 |
| 4 | 300545 | 联得装备 | 283,800 | 9,805,290.00 | 4.23 |
| 5 | 300037 | 新宙邦 | 206,400 | 9,762,720.00 | 4.21 |
| 6 | 600150 | 中国船舶 | 329,220 | 9,692,236.80 | 4.18 |
| 7 | 301153 | 中科江南 | 109,886 | 8,600,777.22 | 3.71 |
| 8 | 688279 | 峰昭科技 | 66,341 | 8,366,926.92 | 3.61 |
| 9 | 603055 | 台华新材 | 673,700 | 8,111,348.00 | 3.50 |
| 10 | 301391 | 卡莱特 | 69,300 | 7,933,464.00 | 3.42 |

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：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

深圳新宙邦科技股份有限公司在报告编制日前一年内受到中华人民共和国浦东海事局的处罚。

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 | 68,236.56 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 7,900.01 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 45,361.89 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 121,498.46 |

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

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 191,725,200.95 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,600,724.56 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 6,870,963.53 |
| 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 | 186,454,961.98 |

§ 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) 《鹏华科技创新混合型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华科技创新混合型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华科技创新混合型证券投资基金 2023 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

2024 年 1 月 19 日