

鹏华创新未来混合型证券投资基金(LOF)

2024 年中期报告

2024 年 6 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

送出日期：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	9
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 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	58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58

7.8	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贵金属投资明细	58
7.9	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	58
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12	投资组合报告附注	58
§ 8	基金份额持有人信息	59
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2	期末上市基金前十名持有人	59
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	60
§ 9	开放式基金份额变动	60
§ 10	重大事件揭示	61
10.1	基金份额持有人大会决议	61
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	61
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4	基金投资策略的改变	61
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8	其他重大事件	63
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	64
11.1	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	64
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12	备查文件目录	65
12.1	备查文件目录	65
12.2	存放地点	65
12.3	查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华创新未来混合型证券投资基金 (LOF)
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
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
报告期末基金份额总额	4,622,246,490.39 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 1 月 21 日

2.2 基金产品说明

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> <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；</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	<p>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。</p> <p>（2）自上而下的行业遴选</p> <p>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。</p> <p>（3）自下而上的个股选择</p> <p>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。</p> <p>1) 定性分析</p> <p>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：</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>2) 定量分析</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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、市盈率一长期成长法、自由现金流贴现模型或股利贴现模型等。</p> <p>（4）港股通标的股票投资策略</p> <p>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：</p> <p>1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；</p> <p>2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；</p> <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>（5）科创板股票投资策略</p> <p>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：</p>
--	---

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>（6）战略配售策略</p> <p>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。</p> <p>3、存托凭证投资策略</p> <p>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>4、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>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</p>
--	--

	<p>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。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	朱萍
	联系电话	0755-81395402	021-31888888
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		4006788999	95528
传真		0755-82021126	021-63602540
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	上海市中山东一路 12 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		518048	200126
法定代表人		张纳沙	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-215,293,933.29
本期利润	-256,869,761.62
加权平均基金份额本期利润	-0.0547
本期加权平均净值利润率	-15.00%
本期基金份额净值增长率	-14.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-3,162,142,490.76
期末可供分配基金份额利润	-0.6841
期末基金资产净值	1,653,006,464.18
期末基金份额净值	0.3576
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-64.24%

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) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即6月30日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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

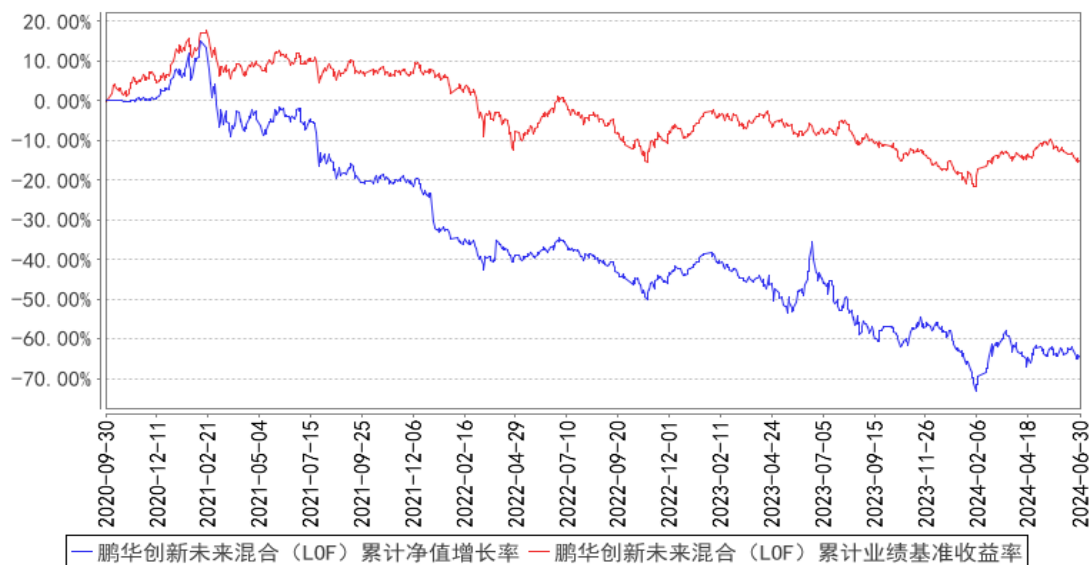
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.40%	1.79%	-2.95%	0.41%	0.55%	1.38%
过去三个月	-6.14%	2.11%	-1.14%	0.64%	-5.00%	1.47%

过去六个月	-14.74%	2.73%	0.15%	0.80%	-	14.89%	1.93%
过去一年	-36.99%	2.47%	-7.87%	0.74%	-	29.12%	1.73%
过去三年	-63.33%	1.85%	-23.90%	0.84%	-	39.43%	1.01%
自基金合同生效起至今	-64.24%	1.75%	-15.17%	0.84%	-	49.07%	0.91%

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份额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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有

限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司资产管理总规模达到 12,020 亿元（联接基金不折算，不含投顾），公司管理着 324 只公募基金、13 只全国社保投资组合、8 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	-	14 年	闫思倩女士，国籍中国，工程硕士，14 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。

4.1.3 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遵规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年创新未来基金表现不佳，整体回撤较大。一方面，大盘表现不佳；另一方面，市场风格更加偏向红利、高股息等资产，成长方向承压。成长行业很多，例如新能源、计算机等行业基本面业绩较差。该基金主要配置 AI 人工智能算力、机器人、新能源、汽车、TMT 等方向，其中低估值业绩好的算力表现相对较好，汽车和新能源表现不佳，后续更加注重对基本面超预期个股的配置。尤其重视人工智能、科技创新等机会的把握。

4.4.2 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-14.74%，同期业绩比较基准增长率为 0.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

10 年期国债收益率再创新低，进一步反映全社会长周期资产回报率下行的预期，政策持续发力，但成果需要进一步观察，高股息资产配置价值持续凸显。政策方面仍会持续支持，地产多地限购继续放松，这将利好顺周期与政策支持方向。但外围的不确定性，如美国大选和印尼出台 200% 的关税等，这些也进一步加重了市场对海外关税和出口的担忧。大盘不断缩量，增量资金有限，价值股还会继续相对占优。上半年基本面情况基本开始落地，关注下半年低估值业绩超预期个股。上半年低估值、红利是全市场主线，8 月以后市场风格可能有转换，随着美联储降息预期落地，国内经济企稳，科技与成长股或有机会。中长期来看，科技仍是经济转型的重点发力方向，也会有政策不断出台。全球也进入科技周期，AI 引领的全球科技市值/收入占比在不断上升，全球科技周期进入补库周期，成熟科技领域基本面出现拐点。国内处于新质生产力成为经济增长引擎的转型期，成长方向继续看好 AI 与科技相关的机会，例如 AI 算力、半导体、苹果产业链、ARVR、新能源新技术、无人驾驶、人形机器人、卫星互联网、低空经济等。新能源主产业链受产能过剩和出

口链贸易摩擦的影响，基本面仍存在不确定性，股价已经连续超跌 2 年或以上，大部分光伏和锂电上游公司今年 1 季度报表出现亏损，最差的时候正在发生。拉长周期看，电力需求增速将持续高于 GDP 增长，AI 的尽头是电力，在碳中和背景下，电力的尽头是新能源/清洁能源。中长期看，新能源与新型电力体系是全球发展的大趋势，新能源主产业链龙头将迎来底部机会。后续将加大电力设备与新能源龙头个股配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、风控管理部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为-3,162,142,490.76 元，期末基金份额净值 0.3576 元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对鹏华创新未来混

合型证券投资基金(LOF)的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对鹏华创新未来混合型证券投资基金(LOF)的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内,由鹏华基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华创新未来混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	107,066,512.87	111,966,076.03
结算备付金		15,021.34	2,227,126.17
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,550,003,676.51	1,804,598,773.12
其中：股票投资		1,545,804,768.67	1,800,440,885.54
基金投资		-	-
债券投资		4,198,907.84	4,157,887.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-

其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		71.41	-
应收申购款		1,049,546.24	775,631.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,658,134,828.37	1,919,567,606.59
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,503,049.83	2,979,869.94
应付管理人报酬		1,675,133.40	1,982,593.95
应付托管费		279,188.89	330,432.34
应付销售服务费		558,377.81	660,864.64
应付投资顾问费		-	-
应交税费		25.54	26.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	112,588.72	1,613,398.59
负债合计		5,128,364.19	7,567,185.85
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	4,622,246,490.39	4,558,580,078.90
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-2,969,240,026.21	-2,646,579,658.16
净资产合计		1,653,006,464.18	1,912,000,420.74
负债和净资产总计		1,658,134,828.37	1,919,567,606.59

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.3576 元，基金份额总额 4,622,246,490.39 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华创新未来混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
-----	-----	--	---

一、营业总收入		-241,493,884.90	-13,744,443.46
1. 利息收入		131,198.44	340,778.72
其中：存款利息收入	6.4.7.13	131,198.44	340,778.72
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-201,255,214.72	-1,059,401,396.41
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-206,657,999.53	-1,069,835,086.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	4,561.10	3,041.94
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	5,398,223.71	10,430,648.60
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-41,575,828.33	1,044,826,088.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,205,959.71	490,085.32
减：二、营业总支出		15,375,876.72	27,203,410.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,169,534.01	19,335,902.28
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,694,922.31	2,578,120.23
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,389,844.66	5,156,240.62
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		16.53	10.89
8. 其他费用	6.4.7.23	121,559.21	133,136.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-256,869,761.62	-40,947,854.20

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-256,869,761.62	-40,947,854.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-256,869,761.62	-40,947,854.20

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华创新未来混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,558,580,078.90	-	2,646,579,658.16	1,912,000,420.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,558,580,078.90	-	2,646,579,658.16	1,912,000,420.74
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	63,666,411.49	-	322,660,368.05	-258,993,956.56
（一）、综合收益总额	-	-	256,869,761.62	-256,869,761.62
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	63,666,411.49	-	-65,790,606.43	-2,124,194.94
其中：1. 基金申购款	1,174,554,862.30	-	749,142,429.92	425,412,432.38
2. 基金赎回	-	-	683,351,823.49	-427,536,627.32

回款	1,110,888,450. 81			
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,622,246,490. 39	-	2,969,240,026. 21	1,653,006,464.1 8
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,797,426,389. 02	-	2,034,160,850. 40	2,763,265,538.6 2
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,797,426,389. 02	-	2,034,160,850. 40	2,763,265,538.6 2
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 297,998,758.68	-	88,235,942.17	-209,762,816.51
(一)、综合收益总额	-	-	-40,947,854.20	-40,947,854.20
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	- 297,998,758.68	-	129,183,796.37	-168,814,962.31

其中：1. 基金申购款	356,639,304.34	-	- 162,230,732.60	194,408,571.74
2. 基金赎回款	- 654,638,063.02	-	- 291,414,528.97	-363,223,534.05
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,499,427,630. 34	-	- 1,945,924,908. 23	2,553,502,722.1 1

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

聂连杰

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华创新未来混合型证券投资基金(LOF)(原鹏华创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]2284 号《关于准予鹏华创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金注册的批复》准予,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,本基金合同生效后前 18 个月为封闭运作期。在封闭运作期内,本基金不接受基金份额的申购和赎回,亦不上市交易。封闭运作期届满后,本基金转为开放式基金,基金名称调整为“鹏华创新未来混合型证券投资基金”,并开放申购和赎回。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 11,999,977,794.26 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)

第 0876 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 12,000,285,420.02 份基金份额,其中认购资金利息折合 307,625.76 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据基金管理人于 2022 年 3 月 28 日发布的《鹏华基金管理有限公司关于鹏华创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金封闭运作期届满相关安排的公告》,本基金封闭运作期于 2022 年 3 月 29 日届满,自 2022 年 3 月 30 日起自动转为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为“鹏华创新未来混合型证券投资基金(LOF)”。经与基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,《鹏华创新未来混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于 2022 年 3 月 30 日生效,《鹏华创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》同时失效。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华创新未来混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得

税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	17,205,617.80
等于：本金	17,203,971.89
加：应计利息	1,645.91
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	89,860,895.07
等于：本金	89,857,045.32
加：应计利息	3,849.75
减：坏账准备	-
合计	107,066,512.87

注：本期末其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,553,871,532.92	-	1,545,804,768.67	-8,066,764.25	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,948,000.00	5,737.04	4,198,907.84	245,170.80
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,948,000.00	5,737.04	4,198,907.84	245,170.80
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,557,819,532.92	5,737.04	1,550,003,676.51	-7,821,593.45	

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,809.52
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,398.38
其他	1,380.82
合计	112,588.72

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,558,580,078.90	4,558,580,078.90
本期申购	1,174,554,862.30	1,174,554,862.30
本期赎回（以“-”号填列）	-1,110,888,450.81	-1,110,888,450.81
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,622,246,490.39	4,622,246,490.39

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,908,505,566.17	261,925,908.01	- 2,646,579,658.16
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-2,908,505,566.17	261,925,908.01	- 2,646,579,658.16
本期利润	-215,293,933.29	-41,575,828.33	-256,869,761.62
本期基金份额交易产生的变动数	-38,342,991.30	-27,447,615.13	-65,790,606.43
其中：基金申购款	-766,761,202.52	17,618,772.60	-749,142,429.92
基金赎回款	728,418,211.22	-45,066,387.73	683,351,823.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,162,142,490.76	192,902,464.55	- 2,969,240,026.21

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	38,780.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	86,041.36
结算备付金利息收入	737.37
其他	5,639.03
合计	131,198.44

注：1、其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

2、本期其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-206,657,999.53
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-206,657,999.53

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	2,080,877,580.40
减：卖出股票成本总额	2,283,176,995.99
减：交易费用	4,358,583.94
买卖股票差价收入	-206,657,999.53

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	4,561.10
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	4,561.10

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,398,223.71
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	5,398,223.71

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-41,575,828.33
股票投资	-41,612,149.93
债券投资	36,321.60
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-41,575,828.33

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	1,205,959.71
合计	1,205,959.71

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	3,013.26
账户维护费	9,000.00
证券组合费	147.57
合计	121,559.21

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金托管人
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国信证券	4,109,167,553.65	100.00	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国信证券	3,041,363.18	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国信证券	-	-	-	-

注：（1）佣金的计算公式

上海/深圳证券交易所的交易佣金=股票买(卖)成交金额×佣金比率-买(卖)经手费-买(卖)证管费等由券商承担的费用

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

（2）本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和约定的佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为鹏华基金公司提供研究服务以及其他研究支持。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	10,169,534.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,498,460.97	9,190,452.10
应支付基金管理人的净管理费	5,671,073.04	10,145,450.18

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为1.20%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.20%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,694,922.31	2,578,120.23

注：支付基金托管人上海浦东发展银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	鹏华创新未来混合（LOF）
鹏华基金公司	333,139.21
合计	333,139.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	鹏华创新未来混合（LOF）
鹏华基金公司	254,667.03
合计	254,667.03

注：支付基金销售机构的销售服务费年费率为 0.4%，逐日计提，按月支付，日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.4% ÷ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国信证券	89,860,895.07	86,041.36	-	-
上海浦东发展银行	17,205,617.80	38,780.68	198,454,031.59	272,202.56

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国信证券	603325	博隆技术	网下申购	660	47,823.60
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	2,618	104,144.04
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	688562	航天软件	网下申购	7,254	91,980.72

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证	成	受限	流	认购	期末	数量	期末	期末估值总额	备

代码	券名称	功 认 购 日	期	通 受 限 类 型	价 格	估 值 单 价	（单 位： 股）	成本总额		注
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	雪祺电气于2024年6月3日每10股送3股
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
30150	华	202	6个月	新	28.0	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-

2	阳智能	4 年 1 月 26 日		股 流 通 受 限	1						
30153 6	星宸科技	202 4 年 3 月 20 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	16.1 6	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-	
30153 8	骏鼎达	202 4 年 3 月 13 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	55.8 2	91.24	150	5,972.74	13,686.00	骏 鼎 达 于 202 4 年 5 月 22 日 每 10 股 送 4 股	
30153 9	宏鑫科技	202 4 年 4 月 3 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	10.6 4	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-	
30156 5	中仑新材	202 4 年 6 月 13 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	11.8 8	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-	
30156 6	达利凯普	202 3 年 12 月 22 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-	
30158	爱	202	6 个月	新	44.9	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-	

0	迪特	4年 6月 19日		股 流 通 受 限	5						
301587	中瑞股份	2024年 3月 27日	6个月	新 股 流 通 受 限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-	
301588	美新科技	2024年 3月 6日	6个月	新 股 流 通 受 限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-	
301591	肯特股份	2024年 2月 20日	6个月	新 股 流 通 受 限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-	
601033	永兴股份	2024年 1月 11日	6个月	新 股 流 通 受 限	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-	
601689	拓普集团	2024年 1月 30日	6个月	非 公 开 发 行 流 通 受 限	57.88	52.23	691,085	39,999,999.80	36,095,369.55	-	
603082	北自科技	2024年 1月 23日	6个月	新 股 流 通 受 限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-	

603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股流通	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

		日		受限						
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
--------	------	------------	-----	--------	-------	-------	-------	-----------	-----------	---

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起约定限售期内不得转让。

3、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括境内依法发行或上市交易的股票（包含主板、中小板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其

他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可依据法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行上海浦东发展银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。下列表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	4,198,907.84	4,157,887.58
未评级	-	-
合计	4,198,907.84	4,157,887.58

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时或于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的

部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2024 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据

质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	107,066,512.87	-	-	-	107,066,512.87
结算备付金	15,021.34	-	-	-	15,021.34
交易性金融资产	-	4,198,907.84	-	1,545,804,768.67	1,550,003,676.51
应收股利	-	-	-	71.41	71.41
应收申购款	-	-	-	1,049,546.24	1,049,546.24
资产总计	107,081,534.21	4,198,907.84	-	1,546,854,386.32	1,658,134,828.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,503,049.83	2,503,049.83
应付管理人报酬	-	-	-	1,675,133.40	1,675,133.40
应付托管费	-	-	-	279,188.89	279,188.89
应付销售服务费	-	-	-	558,377.81	558,377.81
应交税费	-	-	-	25.54	25.54
其他负债	-	-	-	112,588.72	112,588.72
负债总计	-	-	-	5,128,364.19	5,128,364.19
利率敏感度缺口	107,081,534.21	4,198,907.84	-	-1,541,726,022.13	1,653,006,464.18
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	111,966,076.03	-	-	-	111,966,076.03
结算备付金	2,227,126.17	-	-	-	2,227,126.17
交易性金融资产	-	4,157,887.58	-1,800,440,885.54	-	1,804,598,773.12
应收申购款	-	-	-	775,631.27	775,631.27
资产总计	114,193,202.20	4,157,887.58	-1,801,216,516.81	-	1,919,567,606.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,979,869.94	2,979,869.94
应付管理人报酬	-	-	-	1,982,593.95	1,982,593.95
应付托管费	-	-	-	330,432.34	330,432.34
应付销售服务费	-	-	-	660,864.64	660,864.64
应交税费	-	-	-	26.39	26.39
其他负债	-	-	-	1,613,398.59	1,613,398.59
负债总计	-	-	-	7,567,185.85	7,567,185.85
利率敏感度缺口	114,193,202.20	4,157,887.58	-1,793,649,330.96	-	1,912,000,420.74

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.25%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	11,368.12	-	11,368.12
资产合计	-	11,368.12	-	11,368.12
以外币计价的负债				

负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	11,368.12	-	11,368.12
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	10,030,847.23	-	10,030,847.23
资产合计	-	10,030,847.23	-	10,030,847.23
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	10,030,847.23	-	10,030,847.23

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	人民币升值 5%	568.41	501,542.36
	人民币贬值 5%	-568.41	-501,542.36

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券投资品种，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证

券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 60%—95%（其中，投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%），投资于创新未来相关的证券占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,545,804,768.67	93.51	1,800,440,885.54	94.17
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	4,198,907.84	0.25	4,157,887.58	0.22
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,550,003,676.51	93.76	1,804,598,773.12	94.39

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动		123,388,667.52
比较基准下降 5% 资产净值变动		-123,388,667.52	-104,538,623.00

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	1,513,597,632.22
第二层次	45,611.11
第三层次	36,360,433.18
合计	1,550,003,676.51

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易

不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,545,804,768.67	93.23
	其中：股票	1,545,804,768.67	93.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,198,907.84	0.25
	其中：债券	4,198,907.84	0.25
	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	107,081,534.21	6.46
8	其他各项资产	1,049,617.65	0.06
9	合计	1,658,134,828.37	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 11,368.12 元，占净值比 0.00%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,852,578.00	0.11
B	采矿业	82,313.19	0.00
C	制造业	1,372,909,245.92	83.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	455,842.35	0.03
E	建筑业	96,337.38	0.01
F	批发和零售业	1,081,587.93	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	28,147.86	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	164,013,192.64	9.92
J	金融业	79,973.88	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	24,081.24	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,068,237.38	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	276,428.13	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	475,274.65	0.03
R	文化、体育和娱乐业	3,350,160.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	1,545,793,400.55	93.51

7.2.2 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	-	-
金融	-	-
能源	3,373.27	0.00
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	7,994.85	0.00
医疗保健	-	-
信息技术	-	-
通信服务	-	-
房地产	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
合计	11,368.12	0.00

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	688256	寒武纪-U	782,427	155,444,772.09	9.40
2	600418	江淮汽车	8,196,475	129,832,164.00	7.85
3	002384	东山精密	5,630,484	116,551,018.80	7.05
4	601138	工业富联	4,056,100	111,137,140.00	6.72
5	603009	北特科技	5,728,400	102,710,212.00	6.21
6	300502	新易盛	640,221	67,575,326.55	4.09
7	688017	绿的谐波	731,052	60,019,369.20	3.63
8	300308	中际旭创	387,560	53,436,772.80	3.23
9	002600	领益智造	6,794,911	48,379,766.32	2.93
10	600584	长电科技	1,473,100	46,712,001.00	2.83
11	300757	罗博特科	497,980	43,498,553.00	2.63
12	603667	五洲新春	2,240,170	36,738,788.00	2.22
13	601689	拓普集团	694,445	36,275,499.15	2.19
14	603728	鸣志电器	884,740	35,593,090.20	2.15
15	300580	贝斯特	2,392,591	35,171,087.70	2.13
16	688577	浙海德曼	864,172	34,497,746.24	2.09
17	688160	步科股份	849,432	33,968,785.68	2.05
18	300476	胜宏科技	950,700	30,669,582.00	1.86
19	002463	沪电股份	821,900	29,999,350.00	1.81
20	603662	柯力传感	1,219,650	28,466,631.00	1.72
21	603920	世运电路	1,393,100	27,499,794.00	1.66
22	688320	禾川科技	943,916	23,163,698.64	1.40
23	000977	浪潮信息	612,181	22,265,022.97	1.35
24	688629	华丰科技	731,836	19,291,196.96	1.17
25	301368	丰立智能	408,598	18,828,195.84	1.14
26	003021	兆威机电	331,860	15,315,339.00	0.93
27	002281	光迅科技	408,100	15,250,697.00	0.92
28	002896	中大力德	546,200	15,238,980.00	0.92
29	603228	景旺电子	416,947	13,258,914.60	0.80
30	002475	立讯精密	332,500	13,070,575.00	0.79
31	600183	生益科技	561,200	11,818,872.00	0.71
32	688498	源杰科技	89,213	11,686,010.87	0.71
33	002938	鹏鼎控股	284,000	11,291,840.00	0.68
34	603986	兆易创新	93,300	8,921,346.00	0.54
35	300394	天孚通信	89,260	7,892,369.20	0.48
36	002241	歌尔股份	367,800	7,175,778.00	0.43
37	000938	紫光股份	221,200	4,943,820.00	0.30
38	301413	安培龙	117,150	4,844,152.50	0.29
39	002851	麦格米特	146,000	3,772,640.00	0.23
40	002975	博杰股份	118,100	3,528,828.00	0.21
41	688205	德科立	118,772	3,421,821.32	0.21
42	300182	捷成股份	899,800	3,338,258.00	0.20
43	300418	昆仑万维	96,600	3,114,384.00	0.19

44	300620	光库科技	74,655	2,745,810.90	0.17
45	688183	生益电子	85,868	1,664,121.84	0.10
46	300461	田中精机	70,200	1,565,460.00	0.09
47	600975	新五丰	218,100	1,541,967.00	0.09
48	300570	太辰光	46,500	1,518,690.00	0.09
49	688582	芯动联科	48,990	1,379,558.40	0.08
50	688609	九联科技	150,358	1,326,157.56	0.08
51	301205	联特科技	17,100	1,073,025.00	0.06
52	688052	纳芯微	8,526	876,302.28	0.05
53	600212	绿能慧充	136,600	852,384.00	0.05
54	688039	当虹科技	28,452	733,777.08	0.04
55	603533	掌阅科技	35,800	668,386.00	0.04
56	301550	斯菱股份	13,400	641,994.00	0.04
57	002517	恺英网络	65,700	627,435.00	0.04
58	300459	汤姆猫	180,900	613,251.00	0.04
59	688563	航材股份	10,768	569,411.84	0.03
60	688469	芯联集成-U	137,994	546,456.24	0.03
61	001286	陕西能源	37,667	434,300.51	0.03
62	603296	华勤技术	7,687	424,553.01	0.03
63	688692	达梦数据	1,745	382,889.35	0.02
64	688548	广钢气体	40,476	369,545.88	0.02
65	301291	明阳电气	12,054	362,222.70	0.02
66	688073	毕得医药	11,204	333,655.12	0.02
67	301267	华夏眼科	15,078	312,416.16	0.02
68	300972	万辰集团	14,700	310,611.00	0.02
69	688146	中船特气	10,101	301,514.85	0.02
70	688525	佰维存储	4,614	295,988.10	0.02
71	300850	新强联	19,392	291,267.84	0.02
72	688549	中巨芯-U	42,933	289,797.75	0.02
73	601061	中信金属	40,154	275,857.98	0.02
74	688352	颀中科技	23,609	269,378.69	0.02
75	688114	华大智造	5,336	252,979.76	0.02
76	688105	诺唯赞	12,355	247,223.55	0.01
77	688531	日联科技	5,017	231,584.72	0.01
78	001287	中电港	13,860	229,105.80	0.01
79	301487	盟固利	8,662	223,999.32	0.01
80	301486	致尚科技	4,820	203,934.20	0.01
81	601033	永兴股份	12,577	203,332.29	0.01
82	301511	德福科技	13,738	202,772.88	0.01
83	688543	国科军工	4,913	201,776.91	0.01
84	688709	成都华微	10,448	201,301.51	0.01
85	688539	高华科技	7,468	200,963.88	0.01
86	301559	中集环科	13,144	191,508.08	0.01

87	301348	蓝箭电子	6,124	186,108.36	0.01
88	688570	天玛智控	8,837	180,186.43	0.01
89	301371	敷尔佳	5,637	175,085.22	0.01
90	301565	中仑新材	7,103	174,381.42	0.01
91	301303	真兰仪表	14,804	170,542.08	0.01
92	301536	星辰科技	4,809	167,218.27	0.01
93	688253	英诺特	4,364	166,312.04	0.01
94	301293	三博脑科	4,321	162,858.49	0.01
95	688652	京仪装备	4,157	162,497.13	0.01
96	601096	宏盛华源	39,171	160,209.39	0.01
97	688486	龙迅股份	2,793	160,038.90	0.01
98	688507	索辰科技	3,231	157,026.60	0.01
99	301262	海看股份	6,917	155,978.35	0.01
100	301508	中机认检	4,186	154,714.56	0.01
101	301580	爱迪特	2,018	153,513.06	0.01
102	301538	骏鼎达	1,492	150,945.76	0.01
103	301345	涛涛车业	2,652	146,125.20	0.01
104	301421	波长光电	3,315	143,307.45	0.01
105	688334	西高院	8,879	142,951.90	0.01
106	688584	上海合晶	8,659	141,955.59	0.01
107	688502	茂莱光学	1,509	140,352.09	0.01
108	688373	盟科药业-U	31,886	138,704.10	0.01
109	301370	国科恒泰	12,395	134,733.65	0.01
110	688591	泰凌微	6,806	133,057.30	0.01
111	301381	赛维时代	5,710	129,788.30	0.01
112	688691	灿芯股份	2,461	128,948.97	0.01
113	301392	汇成真空	2,189	128,899.54	0.01
114	301172	君逸数码	4,376	128,566.88	0.01
115	301488	豪恩汽电	2,618	125,925.80	0.01
116	301558	三态股份	14,578	122,309.42	0.01
117	300904	威力传动	3,037	121,388.89	0.01
118	301439	泓淋电力	9,486	120,187.62	0.01
119	301141	中科磁业	3,664	118,164.00	0.01
120	688478	晶升股份	4,013	116,858.56	0.01
121	603341	龙旗科技	2,978	115,638.42	0.01
122	688612	威迈斯	4,218	112,072.26	0.01
123	688581	安杰思	2,281	111,609.33	0.01
124	688496	清越科技	12,000	110,880.00	0.01
125	688562	航天软件	7,254	110,768.58	0.01
126	301251	威尔高	3,207	110,417.01	0.01
127	301510	固高科技	3,957	109,806.75	0.01
128	301317	鑫磊股份	6,936	107,785.44	0.01
129	301507	民生健康	8,509	107,383.58	0.01

130	301456	盘古智能	4,061	105,951.49	0.01
131	301548	崇德科技	1,959	103,983.72	0.01
132	688627	精智达	2,212	102,681.04	0.01
133	301322	绿通科技	5,467	102,615.59	0.01
134	300491	通合科技	7,100	101,956.00	0.01
135	301517	陕西华达	1,841	99,414.00	0.01
136	301332	德尔玛	11,211	99,105.24	0.01
137	301566	达利凯普	5,755	97,662.35	0.01
138	001389	广合科技	2,219	97,078.01	0.01
139	301320	豪江智能	6,416	96,368.32	0.01
140	301382	蜂助手	5,304	95,949.36	0.01
141	688593	新相微	9,584	95,840.00	0.01
142	301539	宏鑫科技	3,607	92,654.66	0.01
143	301489	思泉新材	1,278	90,201.24	0.01
144	301408	华人健康	8,784	89,860.32	0.01
145	301587	中瑞股份	3,056	89,267.06	0.01
146	301376	致欧科技	4,192	88,744.64	0.01
147	301329	信音电子	4,577	88,473.41	0.01
148	301591	肯特股份	2,184	88,113.42	0.01
149	688433	华曙高科	4,171	87,007.06	0.01
150	301357	北方长龙	2,660	85,864.80	0.01
151	301499	维科精密	3,709	84,305.57	0.01
152	301399	英特科技	4,241	83,462.88	0.01
153	688653	康希通信	6,478	83,436.64	0.01
154	688458	美芯晟	3,088	82,758.40	0.01
155	688620	安凯微	10,157	82,677.98	0.01
156	688443	智翔金泰-U	2,756	81,963.44	0.00
157	301202	朗威股份	3,060	81,885.60	0.00
158	688602	康鹏科技	10,653	81,708.51	0.00
159	601059	信达证券	5,628	79,973.88	0.00
160	301500	飞南资源	4,550	79,397.50	0.00
161	603135	中重科技	6,273	78,600.69	0.00
162	301386	未来电器	3,776	78,314.24	0.00
163	301568	思泰克	2,456	78,149.92	0.00
164	601065	江盐集团	8,748	75,845.16	0.00
165	301281	科源制药	3,366	75,566.70	0.00
166	301418	协昌科技	1,886	75,440.00	0.00
167	301315	威士顿	2,253	73,425.27	0.00
168	301261	恒工精密	1,973	73,139.11	0.00
169	301519	舜禹股份	4,414	73,095.84	0.00
170	688603	天承科技	1,391	72,624.11	0.00
171	301292	海科新源	5,824	72,042.88	0.00
172	301323	新莱福	2,277	71,907.66	0.00

173	601133	柏诚股份	6,632	70,896.08	0.00
174	688719	爱科赛博	2,714	70,753.98	0.00
175	688530	欧莱新材	3,437	69,099.55	0.00
176	688646	逸飞激光	2,190	68,349.90	0.00
177	688435	英方软件	2,728	68,090.88	0.00
178	301518	长华化学	3,850	66,720.50	0.00
179	301272	英华特	1,729	66,704.82	0.00
180	688648	中邮科技	3,025	66,066.00	0.00
181	301520	万邦医药	1,596	66,042.48	0.00
182	301428	世纪恒通	2,289	65,694.30	0.00
183	301170	锡南科技	2,496	65,020.80	0.00
184	301337	亚华电子	2,318	63,930.44	0.00
185	688472	阿特斯	6,261	63,736.98	0.00
186	688693	锆威特	1,773	63,686.16	0.00
187	301358	湖南裕能	2,023	63,643.58	0.00
188	301555	惠柏新材	2,235	63,317.55	0.00
189	301528	多浦乐	1,478	63,317.52	0.00
190	688695	中创股份	1,856	63,082.50	0.00
191	301373	凌玮科技	2,764	63,019.20	0.00
192	688573	信宇人	2,844	60,804.72	0.00
193	301578	辰奕智能	1,527	60,423.39	0.00
194	301295	美硕科技	3,004	59,809.64	0.00
195	301529	福赛科技	1,816	59,582.96	0.00
196	301588	美新科技	2,568	59,238.22	0.00
197	688429	时创能源	3,452	58,476.88	0.00
198	301505	苏州规划	1,934	58,020.00	0.00
199	301360	荣旗科技	1,340	57,955.00	0.00
200	301325	曼恩斯特	1,363	57,818.46	0.00
201	301533	威马农机	2,243	57,622.67	0.00
202	688716	中研股份	2,668	56,561.60	0.00
203	603193	润本股份	3,022	55,574.58	0.00
204	301355	南王科技	5,624	53,934.16	0.00
205	301502	华阳智能	1,375	53,673.83	0.00
206	688479	友车科技	3,318	52,723.02	0.00
207	688651	盛邦安全	1,778	52,006.50	0.00
208	603119	浙江荣泰	2,929	51,901.88	0.00
209	688307	中润光学	2,455	50,793.95	0.00
210	603381	永臻股份	1,778	49,273.14	0.00
211	688203	海正生材	5,761	48,968.50	0.00
212	301157	华塑科技	1,498	48,834.80	0.00
213	001378	德冠新材	2,044	48,769.84	0.00
214	603107	上海汽配	2,920	46,398.80	0.00
215	301301	川宁生物	3,574	45,675.72	0.00

216	603325	博隆技术	660	45,347.28	0.00
217	600925	苏能股份	8,960	45,248.00	0.00
218	301515	港通医疗	2,294	43,907.16	0.00
219	603344	星德胜	1,813	42,892.99	0.00
220	603062	麦加芯彩	1,258	41,778.18	0.00
221	688526	科前生物	2,802	41,161.38	0.00
222	001359	平安电工	1,833	40,513.63	0.00
223	603125	常青科技	2,314	39,823.94	0.00
224	688361	中科飞测	831	39,306.30	0.00
225	603270	金帝股份	1,943	38,549.12	0.00
226	001328	登康口腔	1,445	36,558.50	0.00
227	001326	联域股份	986	35,357.96	0.00
228	603312	西典新能	1,296	33,263.00	0.00
229	603004	鼎龙科技	1,948	33,018.60	0.00
230	603273	天元智能	1,772	32,516.20	0.00
231	603082	北自科技	1,070	32,276.55	0.00
232	603075	热威股份	1,812	31,981.80	0.00
233	301095	广立微	740	30,428.80	0.00
234	301498	乖宝宠物	554	29,805.20	0.00
235	001379	腾达科技	2,128	29,183.34	0.00
236	001282	三联锻造	1,045	28,956.95	0.00
237	603375	盛景微	714	28,339.56	0.00
238	603281	江瀚新材	1,208	27,119.60	0.00
239	001387	雪祺电气	1,729	26,756.25	0.00
240	603276	恒兴新材	1,737	24,213.78	0.00
241	603373	安邦护卫	876	24,081.24	0.00
242	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
243	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
244	301297	富乐德	1,015	20,614.65	0.00
245	001311	多利科技	844	20,407.92	0.00
246	603137	恒尚节能	1,935	19,737.00	0.00
247	603172	万丰股份	1,220	19,715.20	0.00
248	001314	亿道信息	508	19,522.44	0.00
249	301367	怡和嘉业	312	19,406.40	0.00
250	001367	海森药业	813	18,975.42	0.00
251	001337	四川黄金	795	18,451.95	0.00
252	001324	长青科技	1,131	18,322.20	0.00
253	301339	通行宝	913	18,159.57	0.00
254	301327	华宝新能	315	18,049.50	0.00
255	301132	满坤科技	468	17,872.92	0.00
256	601022	宁波远洋	1,983	17,490.06	0.00
257	301311	昆船智能	832	15,292.16	0.00
258	301207	华兰疫苗	853	15,072.51	0.00

259	301361	众智科技	517	15,044.70	0.00
260	001376	百通能源	804	14,970.48	0.00
261	301285	鸿日达	565	14,740.85	0.00
262	301171	易点天下	985	14,479.50	0.00
263	601121	宝地矿业	2,532	14,407.08	0.00
264	301377	鼎泰高科	770	13,513.50	0.00
265	301058	中粮科工	1,386	13,125.42	0.00
266	301363	美好医疗	445	12,905.00	0.00
267	603173	福斯达	588	12,765.48	0.00
268	603153	上海建科	740	12,513.40	0.00
269	301101	明月镜片	556	12,421.04	0.00
270	301277	新天地	921	11,954.58	0.00
271	001330	博纳影业	2,200	11,902.00	0.00
272	301338	凯格精机	360	11,566.80	0.00
273	603122	合富中国	2,198	11,187.82	0.00
274	301318	维海德	402	11,042.94	0.00
275	603190	亚通精工	470	10,791.20	0.00
276	603162	海通发展	1,146	10,657.80	0.00
277	301328	维峰电子	286	10,556.26	0.00
278	301152	天力锂能	433	10,430.97	0.00
279	301151	冠龙节能	703	10,348.16	0.00
280	301282	金禄电子	434	10,320.52	0.00
281	301306	西测测试	255	9,868.50	0.00
282	301115	建科股份	685	9,507.80	0.00
283	001313	粤海饲料	1,232	9,264.64	0.00
284	603057	紫燕食品	549	8,410.68	0.00
285	301419	阿莱德	330	8,193.90	0.00
286	301359	东南电子	328	8,003.20	0.00
287	06969	思摩尔国际	925	7,994.85	0.00
288	603282	亚光股份	457	7,705.02	0.00
289	301296	新巨丰	1,042	7,512.82	0.00
290	001278	一彬科技	473	7,478.13	0.00
291	301349	信德新材	270	7,462.80	0.00
292	301220	亚香股份	285	7,273.20	0.00
293	301388	欣灵电气	292	7,215.32	0.00
294	001366	播恩集团	645	7,159.50	0.00
295	001306	夏厦精密	131	7,072.69	0.00
296	001333	光华股份	426	7,029.00	0.00
297	001368	通达创智	351	6,862.05	0.00
298	301283	聚胶股份	235	6,666.95	0.00
299	603291	联合水务	536	6,571.36	0.00
300	301290	东星医疗	330	6,570.30	0.00
301	301265	华新环保	819	6,478.29	0.00

302	301045	天禄科技	335	6,385.10	0.00
303	301276	嘉曼服饰	303	6,350.88	0.00
304	301233	盛帮股份	158	6,007.16	0.00
305	301309	万得凯	228	5,827.68	0.00
306	301046	能辉科技	290	5,704.30	0.00
307	301161	唯万密封	346	5,373.38	0.00
308	301062	上海艾录	523	5,339.83	0.00
309	301316	慧博云通	359	5,270.12	0.00
310	301270	汉仪股份	210	5,067.30	0.00
311	301313	凡拓数创	247	5,026.45	0.00
312	301319	唯特偶	167	5,015.01	0.00
313	603065	宿迁联盛	581	4,340.07	0.00
314	601699	潞安环能	232	4,206.16	0.00
315	00883	中国海洋石油	165	3,373.27	0.00
316	600438	通威股份	79	1,509.69	0.00
317	301398	星源卓镁	34	1,378.70	0.00
318	002261	拓维信息	100	1,107.00	0.00
319	002230	科大讯飞	9	386.55	0.00
320	301020	密封科技	21	332.22	0.00
321	000568	泸州老窖	1	143.49	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601138	工业富联	108,055,477.32	5.65
2	002384	东山精密	107,587,358.93	5.63
3	000625	长安汽车	91,933,282.54	4.81
4	600418	江淮汽车	88,091,950.47	4.61
5	300394	天孚通信	87,429,423.40	4.57
6	603009	北特科技	81,726,089.16	4.27
7	000977	浪潮信息	67,882,490.80	3.55
8	688017	绿的谐波	58,786,072.42	3.07
9	300502	新易盛	54,851,894.00	2.87
10	688577	浙海德曼	52,987,689.98	2.77
11	300308	中际旭创	50,720,029.00	2.65
12	603728	鸣志电器	46,338,659.00	2.42
13	600584	长电科技	46,051,306.76	2.41
14	300580	贝斯特	45,804,644.00	2.40
15	002600	领益智造	43,337,626.60	2.27
16	688256	寒武纪-U	41,936,919.77	2.19
17	601689	拓普集团	39,999,999.80	2.09
18	300809	华辰装备	37,424,967.98	1.96

19	002975	博杰股份	36,729,264.32	1.92
20	300418	昆仑万维	34,780,946.74	1.82

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000625	长安汽车	142,147,785.02	7.43
2	300394	天孚通信	113,327,140.86	5.93
3	600418	江淮汽车	90,148,682.28	4.71
4	300580	贝斯特	68,797,422.66	3.60
5	301236	软通动力	67,766,343.97	3.54
6	688025	杰普特	59,128,023.07	3.09
7	688698	伟创电气	57,249,230.09	2.99
8	601689	拓普集团	57,145,972.60	2.99
9	002896	中大力德	46,321,486.20	2.42
10	603662	柯力传感	45,831,616.40	2.40
11	603809	豪能股份	44,472,784.51	2.33
12	688256	寒武纪-U	42,897,699.72	2.24
13	300258	精锻科技	42,123,769.48	2.20
14	688160	步科股份	40,561,398.93	2.12
15	000977	浪潮信息	40,007,972.00	2.09
16	300809	华辰装备	39,483,311.40	2.07
17	688041	海光信息	38,547,363.16	2.02
18	300418	昆仑万维	35,210,588.75	1.84
19	002050	三花智控	34,496,999.28	1.80
20	603009	北特科技	31,948,495.50	1.67

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,070,153,029.05
卖出股票收入（成交）总额	2,080,877,580.40

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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）	4,198,907.84	0.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,198,907.84	0.25

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113661	福 22 转债	39,480	4,198,907.84	0.25

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 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贵金属投资明细

注：无。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	71.41
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,049,546.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,049,617.65

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113661	福 22 转债	4,198,907.84	0.25

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
1,055,500	4,379.20	384,325,657.13	8.31	4,237,920,833.26	91.69

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中信证券信安鸿利混合型养老金产品—中国银行股份有限公司	14,605,100.00	5.21
2	刘超	3,990,120.00	1.42

3	李伟	2,353,917.00	0.84
4	新疆维吾尔自治区肆号职业年金计划—民生银行	2,222,700.00	0.79
5	王庆文	2,199,631.00	0.78
6	吴健春	2,122,400.00	0.76
7	孙淑敏	2,058,677.00	0.73
8	杜连仲	1,871,486.00	0.67
9	吴嫣	1,667,913.00	0.60
10	陈东义	1,562,271.00	0.56

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	7,952,955.28	0.1721

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年9月30日） 基金份额总额	12,000,285,420.02
本报告期期初基金份额总额	4,558,580,078.90
本报告期基金总申购份额	1,174,554,862.30
减：本报告期基金总赎回份额	1,110,888,450.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,622,246,490.39

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

本报告期内，公司原副总经理王宗合先生辞去本公司副总经理职务，经公司第六届董事会第二百零四次会议审议通过，董事会同意王宗合先生不再担任公司副总经理，离任日期为 2024 年 2 月 6 日。

本报告期内，公司原副总经理邢彪先生辞去本公司副总经理职务，经公司第六届董事会第二百一十七次会议审议通过，董事会同意邢彪先生不再担任公司副总经理，离任日期为 2024 年 4 月 11 日。

本报告期内，公司原董事长何如先生不再担任公司董事长。经公司 2024 年第三次临时股东大会和第六届董事会第二百一十八次会议审议通过，股东会同意聘任张纳沙女士担任公司董事，董事会选举张纳沙女士担任公司董事长，任职日期自 2024 年 4 月 12 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关责任人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 19 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局

受到的具体措施类型	责令改正及警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定未严格执行，个别业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人高度重视，按照法律法规及相关要求积极落实整改工作。截至报告日，上述事项已整改完毕
其他	-

注：无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券	2	4,109,167,553.65	100.00	3,041,363.18	100.00	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范；
- (4) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的

的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

- (6) 交易、研究服务能力较强。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、合规风控能力和交易、研究水平等后，向券商租用交易单元作为基金交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国信证券	-	-	-	-	-	-

注：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购博隆技术首次公开发行 A 股的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 04 日
2	鹏华创新未来混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 04 日
3	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 18 日
4	鹏华创新未来混合型证券投资基金（LOF）2023 年第 4 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 19 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 23 日
6	鹏华基金管理有限公司关于暂停北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 02 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 02 日
8	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 08 日
9	鹏华基金管理有限公司关于终止与北京中期时代基金销售有限公司销售合作关系的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 04 日
10	鹏华创新未来混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 06 日
11	鹏华创新未来混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2024 年 03 月 06 日

		会基金电子披露网站	
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 16 日
13	鹏华创新未来混合型证券投资基金（LOF）2023 年年度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 28 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 30 日
15	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
16	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
17	鹏华创新未来混合型证券投资基金（LOF）2024 年第 1 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 19 日
18	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 10 日
19	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型类型的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 16 日
20	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低赎回份额和账户最低份额余额限制的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 12 日
21	鹏华创新未来混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 28 日

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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）2024 年中期报告》（原文）。

12.2 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。

12.3 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 8 月 29 日