

鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金
(LOF)
2024 年第 3 季度报告

2024 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024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2024年07月01日起至2024年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华创新动力混合(LOF)
场内简称	创新动力(扩位简称:鹏华创新动力LOF)
基金主代码	501076
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2019年6月10日
报告期末基金份额总额	225,641,128.06份
投资目标	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，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>封闭运作期届满转为上市开放式基金(LOF)后，本基金主要采用资产配置策略、股票投资策略、固定收益策略及其他策略等，其中股票投资不再采用战略配售策略。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>本基金在投资股票时，将根据市场整体估值水平评估系统性风险，同时根据个股估值水平（中证800指数的市净率P/B）决定股票资产的投资比例。</p> <p>上月末中证800指数市净率P/B在过去10年每日市净率P/B中的分位数 本月股票资产占基金资产的比例下限 本月股票资产占基</p>

金资产的比例上限

75分位及以上 30% 60%

25分位(含)至75分位 40% 80%

25分位以下 50% 95%

本基金将科学把握建仓节奏,遵守投资策略,适时控制仓位,力求通过仓位控制进一步降低基金资产收益的波动性。

2、股票投资策略

本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的公司,构建股票投资组合。核心思路在于:1)自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;2)自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,深度挖掘优质的个股。

(1) 自上而下的行业遴选

本基金将自上而下地进行行业遴选,立足于分享符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业的长期成长空间,重点研究新一代信息技术、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以及相关产业在推动互联网、大数据、云计算、人工智能和制造业深度融合上衍生的投资机会。

(2) 自下而上的个股选择

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股票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。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、历史比较和增长性分析,确定具有上升基础的股价水平。

(3) 科创板股票投资策略

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)作为估值依据等。

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需关注:

- 1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司;
- 2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司;
- 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

	<p>整。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p> <p>5、国债期货投资策略 本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目标，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。</p> <p>6、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公告。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中国战略新兴产业成份指数收益率*30%+沪深 300 指数收益率*30%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*10%+中债综合指数收益率*30%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>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</p>

	港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

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（2024年7月1日-2024年9月30日）
1. 本期已实现收益	-25,949,265.03
2. 本期利润	32,472,462.15
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1415
4. 期末基金资产净值	319,812,614.84
5. 期末基金份额净值	1.4174

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

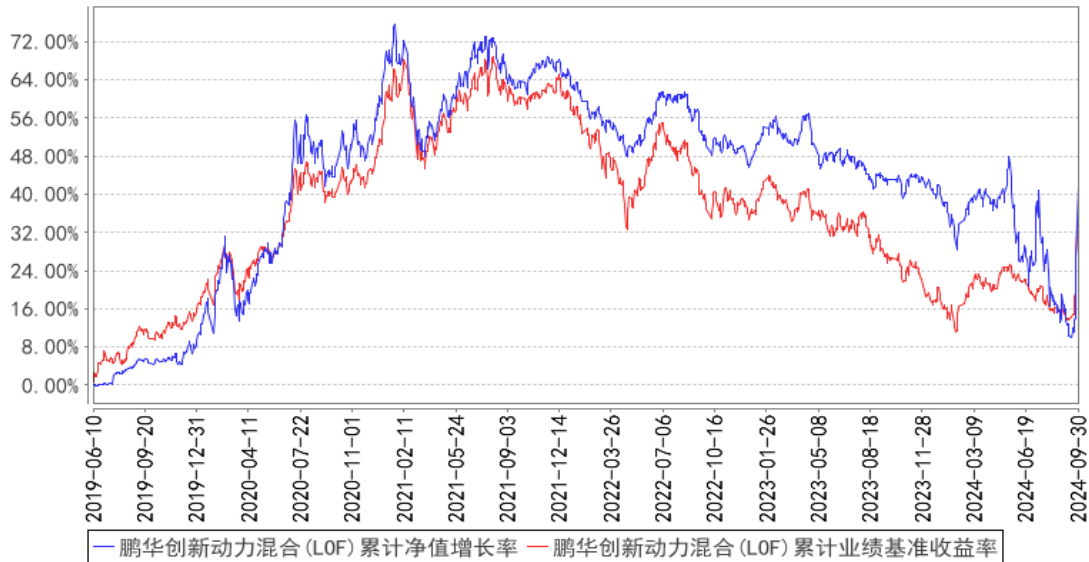
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.52%	2.65%	13.46%	1.20%	-1.94%	1.45%
过去六个月	0.98%	2.08%	12.06%	0.96%	-11.08%	1.12%
过去一年	-1.04%	1.55%	6.88%	0.89%	-7.92%	0.66%
过去三年	-13.48%	0.99%	-15.59%	0.82%	2.11%	0.17%
过去五年	35.64%	1.04%	23.61%	0.84%	12.03%	0.20%
自基金合同 生效起至今	41.74%	1.01%	35.44%	0.83%	6.30%	0.18%

注：业绩比较基准=中国战略新兴产业成份指数收益率*30%+沪深300指数收益率*30%+恒生指数

收益率(使用估值汇率折算)*10%+中债综合指数收益率*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

鹏华创新动力混合(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对比图



注：1、本基金基金合同于 2019 年 06 月 10 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		
李韵怡	基金经理	2022-06-10	-	17 年	李韵怡女士, 国籍中国, 经济学硕士, 17 年证券从业经验。曾任职于广州证券股份有限公司投资管理总部, 先后担任研究员、交易员和投资经理等职务, 从事新股及可转债申购、定增项目等工作; 2015 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司, 从事投研工作, 现担任稳定收益投资部总经理助理/基金经理。2015 年 07 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2015 年 07 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘锐灵

				<p>活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘信灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 03 月担任鹏华弘华灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至 2023 年 09 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至 2023 年 12 月担任鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至 2024 年 02 月担任鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 06 月至 2018 年 07 月担任鹏华兴泽定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2020 年 05 月担任鹏华兴润定期开放灵活配置混合型基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 06 月担任鹏华兴实定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2020 年 05 月担任鹏华兴合定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2023 年 01 月担任鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 07 月担任鹏华弘樽灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 01 月至 2024 年 01 月担任鹏华兴惠定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 06 月至 2022 年 06 月担任鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 11 月至 2023 年 12 月担任鹏华金享混合型证券投资基金基金经理，2020 年 04 月至今担任鹏华鑫享稳健混合型证券投资基金基金经理，2022 年 06 月至今担任鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 李韵怡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。</p>
萧嘉倩	基金经理	2024-05-17	-	<p>13 年</p> <p>萧嘉倩女士, 国籍中国, 经济学硕士, 13 年证券从业经验。曾任国信证券投资银行项目经理, 广发基金金融工程部产品经理, 中信证券投资银行部项目经理, 南方基金基金经理。2024 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司, 现担任稳定收益</p>

					投资部基金经理。2024年02月至今担任鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024年04月至今担任鹏华文化传媒娱乐股票型证券投资基金基金经理，2024年05月至今担任鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理，萧嘉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。

4.1.1 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 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

正如本基金中报披露，从2024年二季度开始本基金基于对宏观经济一年维度和股市复苏的严谨判断下，加大了权益类资产的比重，因为过早布局，在二季度因为宏观经济的再次触底，使

得大盘重新二次探底，由于产品权益类资产比例较高，同时配置的较大弹性标的，因此当大盘回调的时候，基金也迎来较大幅度的回调。但正如此前高仓位配置的思考脉络，在9月26日中央政治局会议之后的一连串货币和财政政策的颁布，得到了一步步验证，我们认为在未来至少一年周期，对中国经济复苏和股市充满信心，目前A股较多绩优资产无论是估值还是股价仍处于历史低分位数，后续也有望得到全球资金对中国资产进行重估，我们认为当前是加大A股权益性资产配置的较好时机。我们重点布局国家重点发展的核心生产力，尤其是自主可控方向（包括计算机、华为链、军工、半导体、高端装备），以及基于公开信息挖掘受益并购重组政策放松的标的。

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11.52%，同期业绩比较基准增长率为13.46%。

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	297,500,865.10	91.77
	其中：股票	297,500,865.10	91.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,785,459.56	1.48
	其中：债券	4,785,459.56	1.48
	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	21,326,451.93	6.58
8	其他资产	557,226.29	0.17
9	合计	324,170,002.88	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78,598,417.52元，占净值比24.58%。

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	105,567,793.71	33.01
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	100,769,503.87	31.51
J	金融业	12,565,150.00	3.93
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	218,902,447.58	68.45

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（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	35,974,047.06	11.25
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	21,533,500.73	6.73
信息技术	-	-
通信服务	21,090,869.73	6.59
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	78,598,417.52	24.58

注：以上分类采用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	002605	姚记科技	1,065,800	26,986,056.00	8.44
2	002600	领益智造	2,879,500	21,625,045.00	6.76
3	002475	立讯精密	495,400	21,530,084.00	6.73
4	09626	哔哩哔哩-W	120,680	21,090,869.73	6.59
5	300395	菲利华	473,800	20,340,234.00	6.36
6	002384	东山精密	824,587	19,410,777.98	6.07
7	301153	中科江南	505,100	15,935,905.00	4.98
8	03908	中金公司	1,236,800	15,503,140.82	4.85
9	002025	航天电器	258,400	14,449,728.00	4.52
10	300598	诚迈科技	291,385	14,062,240.10	4.40

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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)	4,785,459.56	1.50
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,785,459.56	1.50

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123216	科顺转债	48,730	4,785,459.56	1.50

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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目标，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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。

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	379,882.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	177,343.86
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	557,226.29

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123216	科顺转债	4,785,459.56	1.50

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	233,372,837.88
报告期期间基金总申购份额	1,969,985.11
减：报告期期间基金总赎回份额	9,701,694.93
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	225,641,128.06

§ 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) 《鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- (二) 《鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金(LOF)托管协议》；
- (三) 《鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2024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

2024年10月24日