鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金(LOF)
2026年第3季度报告

2026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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2026年10月26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约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华中证香港银行指数（LOF）
场内简称	香港银行(扩位简称：香港银行 LOF）
基金主代码	501025
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2016 年 11 月 10 日
报告期末基金份额总额	2,645,350,310.04 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 0.5%以内，年跟踪误差控制在 6%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。 本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.5%以内，年跟踪误差控制在 6%以内。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。

	1、股票投资策略 （1）股票投资组合的构建 本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。 （2）股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。 1）定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。 2）不定期调整 根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整； 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数； 根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金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。 2、债券投资策略 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。 3、衍生品投资策略 本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。 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。 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。 4、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。 5、融资及转融通投资策略 本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通业务。本基金将根据市场情况和组合风险收益，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务的法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。 本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股，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。		
业绩比较基准	中证香港银行投资指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。		
基金管理人	鹏华基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	鹏华中证香港银行指数(LOF)A	鹏华中证香港银行指数(LOF)C	鹏华中证香港银行指数(LOF)I

下属分级基金的场内简称	香港银行(扩位简称：香港银行 LOF）	-	-
下属分级基金的交易代码	501025	010365	025127
报告期末下属分级基金的份额总额	779,068,111.23 份	1,842,717,402.42 份	23,564,796.39 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	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（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）		
	鹏华中证香港银行指数(LOF)A	鹏华中证香港银行指数(LOF)C	鹏华中证香港银行指数(LOF)I
1.本期已实现收益	41,203,144.52	111,370,545.10	54,776.15
2.本期利润	152,268,111.63	453,194,233.51	235,805.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.2409	0.2762	0.0670
4.期末基金资产净值	1,509,132,839.09	3,981,360,285.10	29,184,770.58
5.期末基金份额净值	1.9371	2.1606	1.2385

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

鹏华中证香港银行指数(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	16.34%	0.97%	15.80%	0.97%	0.54%	0.00%

过去六个月	16.03%	0.93%	14.99%	0.91%	1.04%	0.02%
过去一年	26.81%	0.94%	24.15%	0.92%	2.66%	0.02%
过去三年	107.42%	1.04%	93.59%	1.04%	13.83%	0.00%
过去五年	122.54%	1.05%	96.14%	1.05%	26.40%	0.00%
过去七年	102.00%	1.11%	66.38%	1.10%	35.62%	0.01%
自基金合同生效起至今	118.53%	1.08%	85.61%	1.07%	32.92%	0.01%

鹏华中证香港银行指数(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	16.29%	0.97%	15.80%	0.97%	0.49%	0.00%
过去六个月	15.96%	0.93%	14.99%	0.91%	0.97%	0.02%
过去一年	26.65%	0.94%	24.15%	0.92%	2.50%	0.02%
过去三年	107.17%	1.04%	93.59%	1.04%	13.58%	0.00%
过去五年	121.83%	1.05%	96.14%	1.05%	25.69%	0.00%
自基金合同生效起至今	144.13%	1.06%	106.40%	1.07%	37.73%	-0.01%

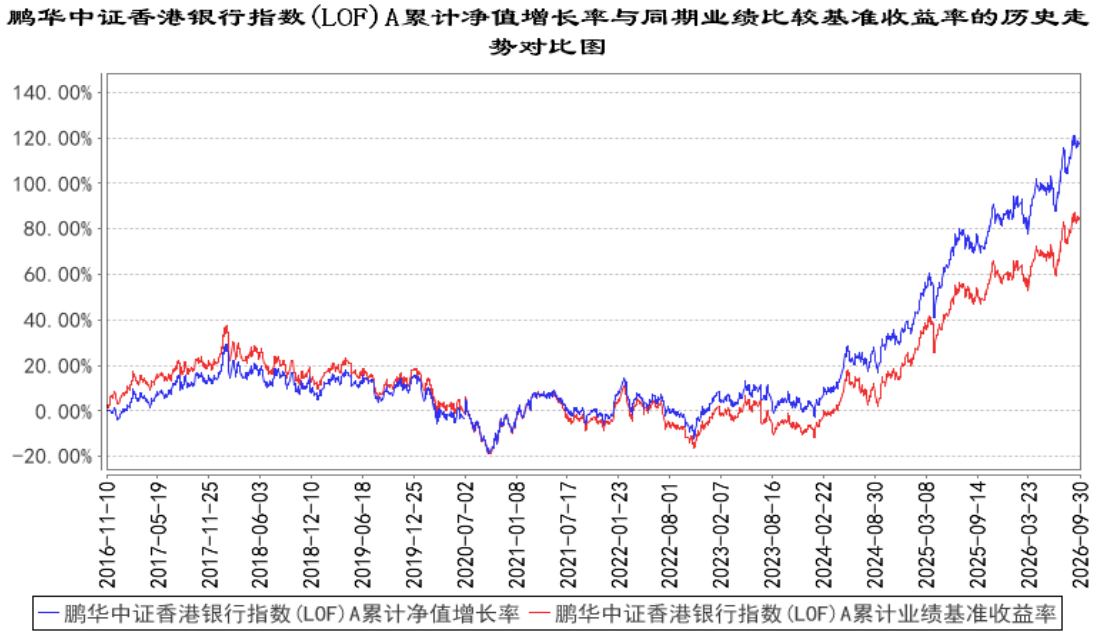
鹏华中证香港银行指数(LOF)I

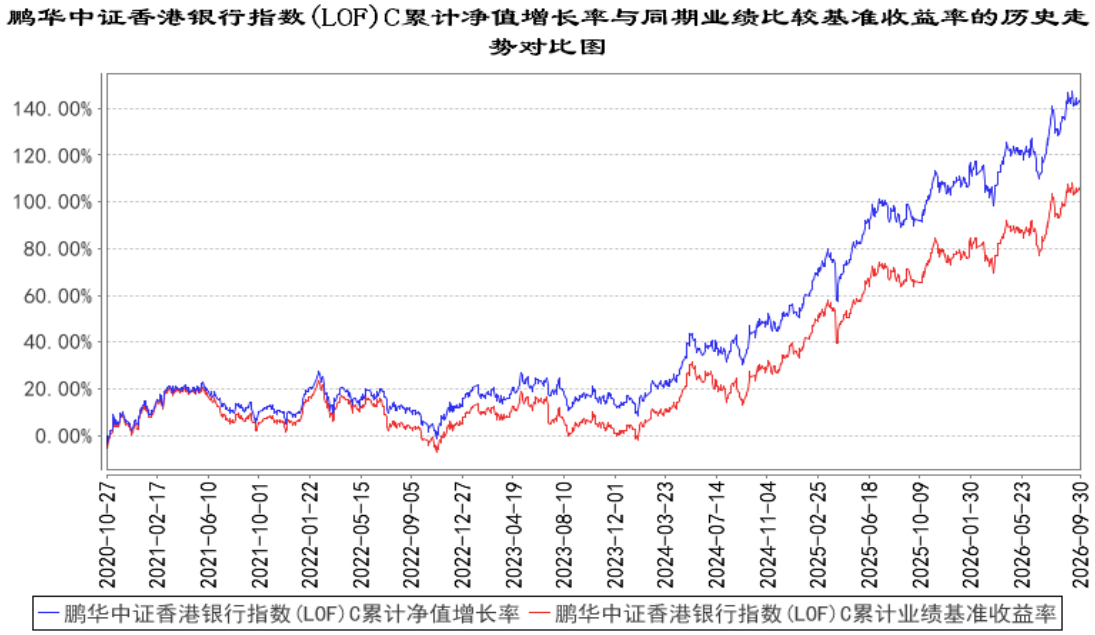
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	16.64%	0.97%	15.80%	0.97%	0.84%	0.00%
过去六个月	16.29%	0.93%	14.99%	0.91%	1.30%	0.02%
过去一年	27.04%	0.94%	24.15%	0.92%	2.89%	0.02%
自基金合同生效起至今	25.10%	0.93%	20.86%	0.90%	4.24%	0.03%

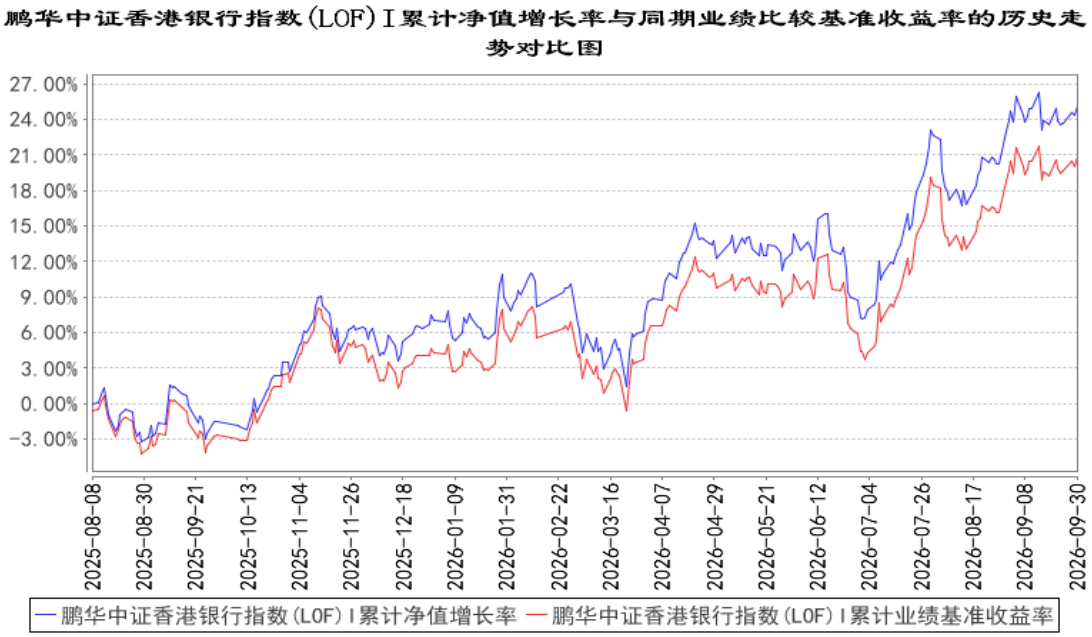
注：业绩比较基准=中证香港银行投资指数收益率×95％＋银行活期存款利率（税后）×5％。

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


鹏华中证香港银行指数(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
140.00%
120.00%
100.00%
80.00%
60.00%
40.00%
20.00%
0.00%
-20.00%
2016-11-10
2017-05-19
2017-11-25
2018-06-03
2018-12-10
2019-06-18
2019-12-25
2020-07-02
2021-01-08
2021-07-17
2022-01-23
2022-08-01
2023-02-07
2023-08-16
2024-02-22
2024-08-30
2025-03-08
2025-09-14
2026-03-23
2026-09-30
鹏华中证香港银行指数(LOF)A累计净值增长率
鹏华中证香港银行指数(LOF)A累计业绩基准收益率


鹏华中证香港银行指数(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
140.00%
120.00%
100.00%
80.00%
60.00%
40.00%
20.00%
0.00%
2020-10-27
2021-02-17
2021-06-10
2021-10-01
2022-01-22
2022-05-15
2022-09-05
2022-12-27
2023-04-19
2023-08-10
2023-12-01
2024-03-23
2024-07-14
2024-11-04
2025-02-25
2025-06-18
2025-10-09
2026-01-30
2026-05-23
2026-09-30
鹏华中证香港银行指数(LOF)C累计净值增长率
鹏华中证香港银行指数(LOF)C累计业绩基准收益率



注：1、本基金基金合同于 2016 年 11 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		
张羽翔	本基金的基金经理	2019-11-22	-	19 年	张羽翔先生，国籍中国，工学硕士，19 年证券从业经验。曾任招商银行软件中心(原深圳市融博技术公司)数据分析师；2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员，先后从事金融工程、量化研究等工作；现担任指数与量化投资部基金经理。2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2016 年 06 月至 2018 年 05 月担任鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 07 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证高

					铁产业指数分级证券投资基金基金经理,2016 年 09 月至 2022 年 08 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理,2016 年 09 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理,2016 年 11 月至 2020 年 07 月担任鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金经理,2016 年 11 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理,2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理,2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华创业板指数分级证券投资基金基金经理,2018 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理,2018 年 05 月至 2020 年 12 月担任鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金经理,2018 年 05 月至 2021 年 10 月担任鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金（LOF）基金经理,2019 年 04 月至今担任鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019 年 07 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证国防交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019 年 11 月至今担任鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金（LOF）基金经理,2019 年 12 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2020 年 02 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证 800 证券保险交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2020 年 03 月至 2022 年 08 月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,2021 年 01 月至 2021 年 01 月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 2021 年 01 月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 2021 年 01 月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 2021 年 01 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 2022

					年 08 月担任鹏华创业板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酒指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证传媒指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证银行指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 07 月至今担任鹏华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021 年 08 月至今担任鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021 年 08 月至 2026 年 06 月担任鹏华中证医药卫生指数证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 12 月至今担任鹏华中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2022 年 07 月至今担任鹏华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2022 年 11 月至今担任鹏华中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2023 年 05 月至今担任鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2024 年 07 月至今担任鹏华中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,2024 年 07 月至今担任鹏华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,2025 年 01 月至 2026 年 09 月担任鹏华恒生港股通红利指数发起式证券投资基金基金经理,2025 年 04 月至 2026 年 05 月担任鹏华上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2025 年 06 月至今担任鹏华国证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2025 年 07 月至 2026 年 08 月担任鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2025 年 08 月至今担任鹏华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2025 年 11 月至今担任鹏华恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2026 年 04 月至今担任鹏华恒生港股通汽车主题交易型开放式指数证券投资

					基金基金经理,2026 年 05 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,2026 年 05 月至今担任鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2026 年 06 月至今担任鹏华中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2026 年 08 月至今担任鹏华中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金基金经理,张羽翔先生具备基金从业资格。

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：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

本报告期内，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%的交易共有 6 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证香港银行投资指数，中证香港银行投资指数从港股通证券范围

内选取银行行业上市公司证券作为指数样本，以反映港股通范围内银行业上市公司证券的整体表现。

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，本基金对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

当前全球利率及市场环境仍存在较大不确定性，银行股兼具的稳定分红、较高股息率、相对较低估值的防御属性仍对投资者具有较强的吸引力。尽管 2026 年以来多数港股上市银行估值回升，但部分银行与历史高位相比仍有差距，其中多数样本股的市净率低于过去 10 年历史中枢，预计板块仍有一定向上修复空间。在各类银行中，国有行客户及负债基础稳固，净息差边际改善，资产质量和风险抵补指标保持稳健，经营韧性相对较强,配置价值较大。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回和成份股调整等工作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期 A 类份额净值增长率为 16.34%,同期业绩比较基准增长率为 15.80%;C 类份额净值增长率为 16.29%,同期业绩比较基准增长率为 15.80%;I 类份额净值增长率为 16.64%,同期业绩比较基准增长率为 15.80%。

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	5,217,956,536.95	90.12
	其中：股票	5,217,956,536.95	90.12
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	468,569,986.87	8.09
8	其他资产	103,581,576.12	1.79
9	合计	5,790,108,099.94	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5,217,956,536.95元，占净值比94.53%。

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

注：无。

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

注：无。

5.2.3 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	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	5,217,956,536.95	94.53
信息技术	-	-
通信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	5,217,956,536.95	94.53

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	00939	建设银行	93,214,000	785,764,601.66	14.24
2	00005	汇丰控股	5,738,000	778,247,005.68	14.10

3	01398	工商银行	107,625,000	712,307,258.78	12.90
4	02888	渣打集团	2,181,050	457,579,596.38	8.29
5	03988	中国银行	82,954,000	433,309,032.76	7.85
6	01288	农业银行	76,053,000	432,842,309.80	7.84
7	02388	中银香港	9,260,000	415,333,640.70	7.52
8	03968	招商银行	9,190,500	406,299,414.02	7.36
9	03328	交通银行	45,694,000	327,918,019.49	5.94
10	00998	中信银行	23,307,000	171,661,732.59	3.11

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

注：无。

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

交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。

中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。

中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

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约定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同约定的证券备选库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	149,541.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	4,315,394.50
4	应收利息	-

5	应收申购款	99,116,640.22
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	103,581,576.12

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

注：无。

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

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

项目	鹏华中证香港银行指数(LOF)A	鹏华中证香港银行指数(LOF)C	鹏华中证香港银行指数(LOF)I
报告期期初基金份额总额	459,431,215.69	1,393,612,540.11	677,472.04
报告期期间基金总申购份额	395,242,169.38	1,862,772,629.86	23,532,800.47
减:报告期期间基金总赎回份额	75,605,273.84	1,413,667,767.55	645,476.12
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	779,068,111.23	1,842,717,402.42	23,564,796.39

§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）《鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金(LOF)基金合同》；

（二）《鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金(LOF)托管协议》；

（三）《鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金(LOF)2026 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：400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司

2026 年 10 月 26 日