

鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金
2020 年第 2 季度报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 月 17 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|--|--------------------|
| 基金简称 | 鹏扬景沃六个月混合 | |
| 交易代码 | 009064 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 3 月 16 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 5,052,387,796.79 份 | |
| 投资目标 | 本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。 | |
| 投资策略 | 基金管理人通过对经济周期及资产价格发展变化的理解，在把握经济周期性波动的基础上，动态评估不同资产类别在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征，追求稳健增长。 | |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5% | |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金可能投资于港股通标的股票，需承担汇率风险及境外市场的风险。 | |
| 基金管理人 | 鹏扬基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 | |
| 下属分类基金的基金简称 | 鹏扬景沃六个月混合 A | 鹏扬景沃六个月混合 C |
| 下属分类基金的交易代码 | 009064 | 009065 |
| 报告期末下属分类基金的份额总额 | 3,007,433,793.36 份 | 2,044,954,003.43 份 |

§ 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（2020年4月1日—2020年6月30日） | |
|-----------------|---------------------------|------------------|
| | 鹏扬景沃六个月混合 A | 鹏扬景沃六个月混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 20,556,651.03 | 11,919,962.41 |
| 2. 本期利润 | 43,677,566.14 | 27,636,323.42 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0145 | 0.0135 |
| 4. 期末基金资产净值 | 3,056,714,616.93 | 2,076,057,247.33 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0164 | 1.0152 |

- 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。
- 2、本报告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，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 本报告期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

鹏扬景沃六个月混合 A

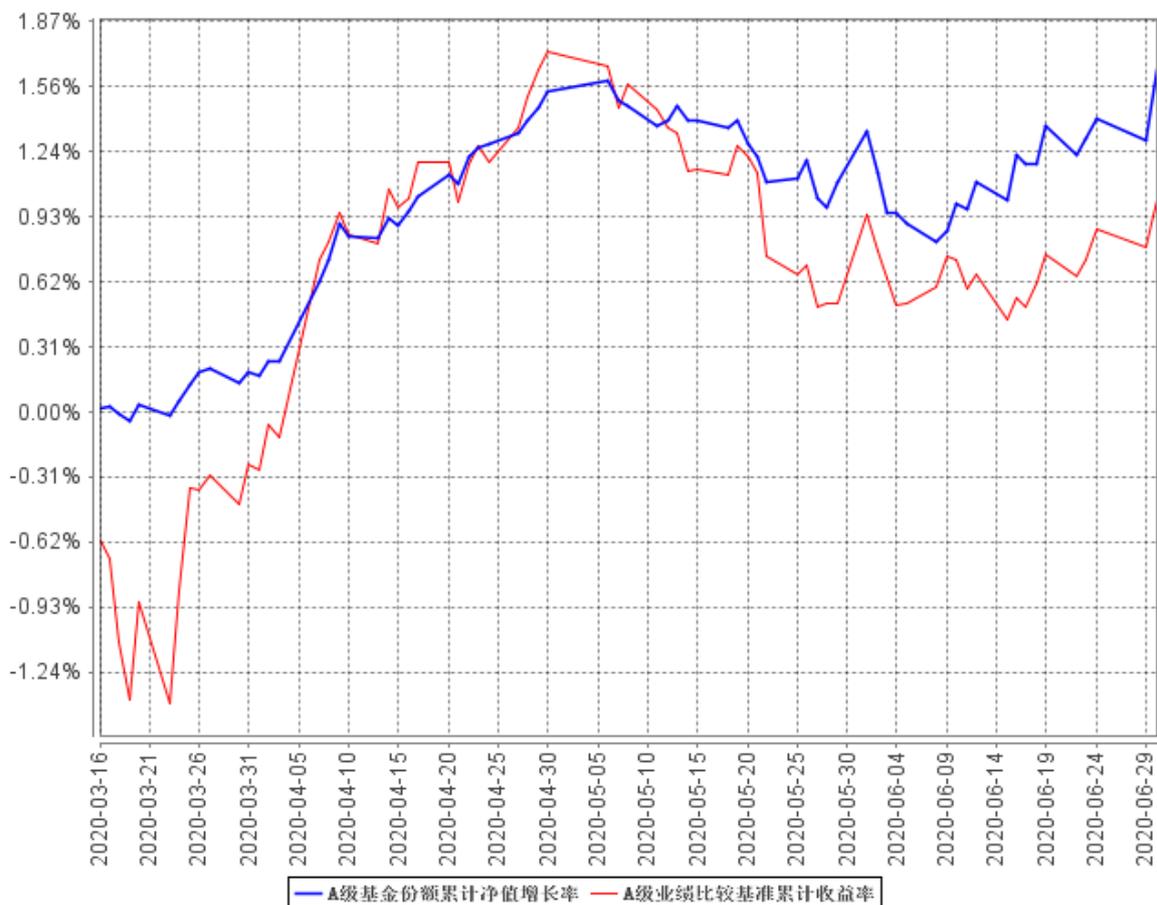
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基准收 益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 1.45% | 0.11% | 1.26% | 0.18% | 0.19% | -0.07% |
| 自基金合同生效 起至今 | 1.64% | 0.11% | 1.01% | 0.22% | 0.63% | -0.11% |

鹏扬景沃六个月混合 C

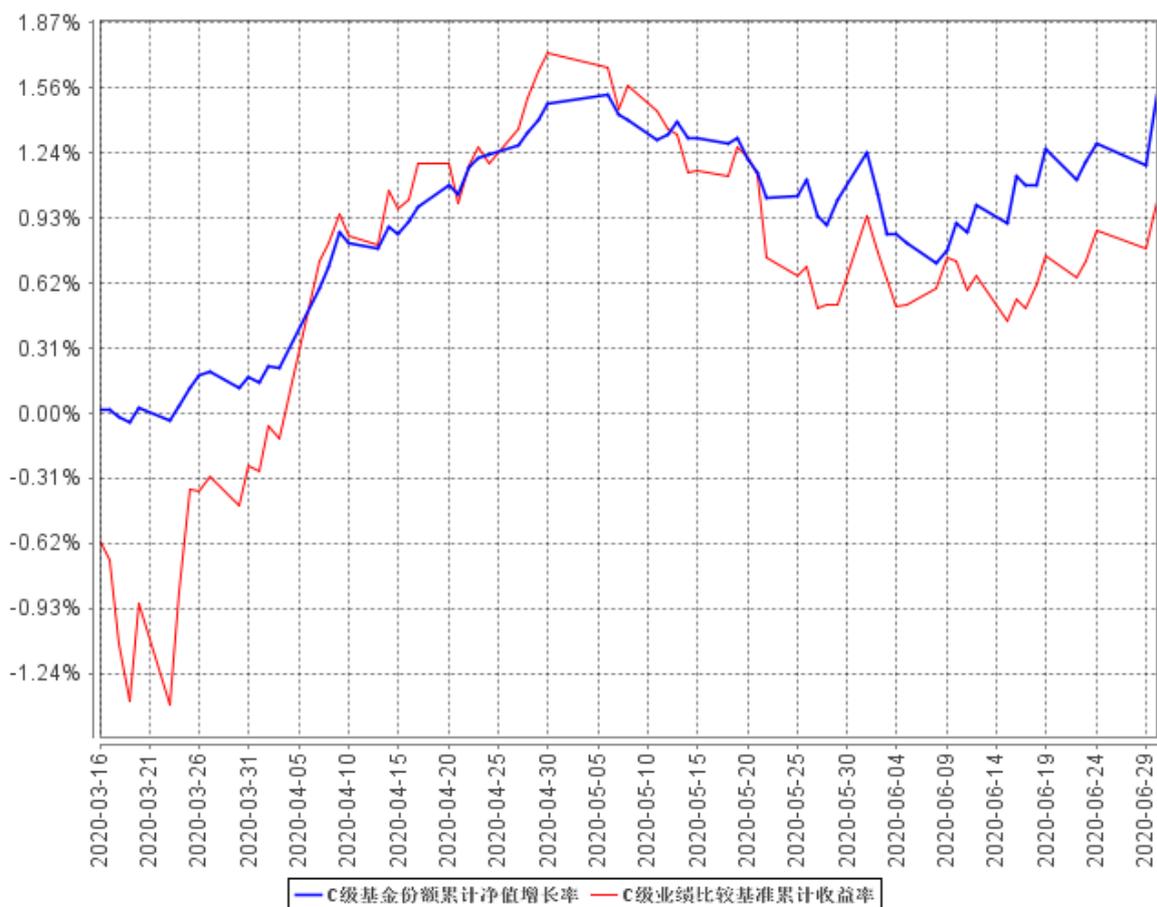
| 阶段 | 净值增 长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基准收 益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 1.35% | 0.11% | 1.26% | 0.18% | 0.09% | -0.07% |
| 自基金合同生效 起至今 | 1.52% | 0.11% | 1.01% | 0.22% | 0.51% | -0.11% |

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

A级基金份额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



C级基金份额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）上图基金净值表现及业绩比较基准截止日期为 2020 年 6 月 30 日。

（2）本基金合同于 2020 年 3 月 16 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

（3）按基金合同规定，本基金的建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

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 | | |
| 李刚 | 副总经理、本基金基金 | 2020 年 3 月 16 日 | - | 18 | 中国社科院经济学博士，曾任中国农业银行资产负债管理部交易员、资金营运部 |

| | | | | | |
|-----|-------|-----------------|---|---|--|
| | 经理 | | | | 高级交易员、金融市场部处长、副总经理。现任鹏扬基金管理有限公司副总经理。2019 年 1 月 4 日至 2020 年 3 月 20 日任鹏扬利泽债券型证券投资基金基金经理，2020 年 1 月 20 日至今任鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金基金经理，2020 年 3 月 16 日至今任鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金基金经理，2020 年 4 月 21 日至今任鹏扬景恒六个月持有期混合型证券投资基金基金经理，2020 年 6 月 24 日至今任鹏扬景惠六个月持有期混合型证券投资基金。 |
| 王莹莹 | 本基金经理 | 2020 年 3 月 16 日 | - | 4 | 英国埃克斯特大学硕士。曾任北京鹏扬投资管理有限公司交易管理部债券交易员。鹏扬基金管理有限公司交易管理部债券交易员、专户投资部投资组合经理。现任鹏扬基金管理有限公司现金管理部基金经理。2018 年 8 月 24 日至今任鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金基金经理、鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、鹏扬现金通利货币市场基金基金经理，2019 年 11 月 13 日至今任鹏扬利洋短债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 11 月 18 日至今任鹏扬淳开债券型证券投资基金基金经理，2020 年 3 月 16 日至今任鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 4 月 14 日至今任鹏扬景科混合型证券投资基金基金经理。 |
| 赵世宏 | 本基金经理 | 2020 年 3 月 20 日 | - | 9 | 北京大学金融学硕士，曾任中银基金管理有限公司行 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|---|
| | 理 | | | | 业研究员，易方达基金管理有限公司研究员、基金经理助理，大成基金管理有限公司基金经理。现任鹏扬基金管理有限公司股票投资部基金经理。2019 年 1 月 4 日至今任鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 5 月 22 日至今任鹏扬景欣混合型证券投资基金基金经理。2020 年 2 月 19 日至今任鹏扬景瑞三年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 20 日至今任鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 4 月 10 日至今任鹏扬景科混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|---|--|--|--|---|

注：1. 此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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

为保护投资者利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合。公司根据《证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《鹏扬基金管理有限公司公平交易制度》、《鹏扬基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，对公平对待公司管理的各类资产做了明确具体的规定并重视交易执行环节的公平交易措施。本报告期内，本公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金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 5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度以来，全球疫情仍未出现拐点，美国和巴西等国家新增确诊病例继续上升，全球经济仍面临疫情防控常态化的负面影响。但在全球主要国家史无前例的货币政策和财政政策刺激下，主要发达经济体虽然经济均大幅负增长，但进入 5 月以来，领先经济指标出现企稳回升迹象。金融市场也从 3 月份的恐慌下跌转为大幅反弹，美国纳斯达克指数再创新高。全球债券市场利率在央行宽松货币政策支持下保持在低位震荡，黄金价格由于实际利率为负而大幅上涨。主要工业品价格也从低位明显反弹。

随着国内复工复产的快速推进以及宽松政策对需求端的拉动，我们预计 2020 年二季度中国经济增长有望 V 型恢复为正增长，但绝对水平仍未达到经济完全复苏的水平。从数据上看，代表需求的 5 月固定资产投资和社会零售实际同比分别为 -6.3%和-3.7%，代表产出的 5 月工业增加值同比回升至 4.4%。通货膨胀方面，受食品价格影响，2020 年 5 月我国 CPI 同比上涨 2.4%明显回落，非食品 CPI 同比上涨 0.4%，核心 CPI 同比上涨 1.1%总体保持平稳，通货膨胀水平逐步下行。2020 年 5 月我国工业生产者出厂价格指数（PPI）同比下降 3.7%，环比下降 0.4%，但高频指标显示 6 月 PPI 环比转正，工业品通货紧缩风险有所缓解。流动性方面，央行货币政策 4 月初较为充裕，5 月后边际收紧，坚持总量政策适度，着重在于用好直达实体的结构性宽信用政策，同时打击各种套利行为，银行间加权回购利率水平从 4 月低位大幅回升到公开市场（OMO）的政策性利率水平。

二季度债券市场先抑后扬，收益率曲线呈熊市变平。4 月市场利率在央行超预期降低超额准备金利率利好政策刺激下大幅下行，但全季度来看 3 年以内中短端品种受央行货币政策边际收紧和杠杆套息去杠杆双重冲击，短端利率上行 30-50BP 左右，10 年以上长端上行幅度约 30BP。信用利差方面，在宽财政宽信用政策支持下，3 年以下短期信用债券信用利差总体收窄约 10-20BP，但 3 年以上信用债券利差扩大 5-15BP。总体来看，流动性总体合理充裕和经济 V 型恢复缓解了短期信用收缩风险，但市场对中长期流动性风险和违约风险仍很谨慎。

二季度，A 股市场在二季度单边上涨，以消费、医药、科技、先进制造为代表的新兴行业涨幅较大。行情初期集中在少数优质公司上，后有逐步扩散之势。

债券方面，4 月 7 日银行间账户可操作，央行清明节前宣布降低超准利率值 0.35%，4 月上旬积极建仓，扫配 1-3 年高等级信用底仓品种，同时运用国债期货灵活交易与 5 年利率债交替运作，

提升组合久期，久期逐步提升至 2 年，上旬基本完成初步建仓，中下旬积极调仓，一方面调整资产流动性，另一方面底仓灵活置换以维持 carry。5 月债市开始回调，5-6 月份策略上谨慎防守，将久期从 2 年调降至 1.1 年，在资金利率上行的过程中调降杠杆至 110%以内水平，在短端大幅上行后积极置换底仓，卖出调整不够的短信用，置换为半年内高评级永续债，缩短久期并提升静态收益。

转债方面，仓位维持在 5%附近水平，以防御性强的银行转债为主，少量持仓消费电子，新能源，军工，基建等行业转债仓位，5-6 月增加成长型转债的占比。

股票操作方面，本基金根据市场变化，逐步提高仓位，在 4 月底国内疫情基本控制、国外疫情见顶时恢复了对优质科技公司的正常配置。在 5-6 月份，适度增配了光伏、电动车等行业优质公司。在实现正常配置后，维持组合配置的稳定，交易较少。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬景沃六个月混合 A 基金份额净值为 1.0164 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.45%；截至本报告期末鹏扬景沃六个月混合 C 基金份额净值为 1.0152 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.35%；同期业绩比较基准收益率为 1.26%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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 | 655,035,332.60 | 10.95 |
| | 其中：股票 | 655,035,332.60 | 10.95 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 5,028,267,390.97 | 84.08 |
| | 其中：债券 | 5,028,267,390.97 | 84.08 |
| | 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 | 207,522,975.88 | 3.47 |
| 8 | 其他资产 | 89,444,102.75 | 1.50 |
| 9 | 合计 | 5,980,269,802.20 | 100.00 |

注：本基金报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 101,126,704.91 元，占期末基金资产净值的比例为 1.97%。

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 | 418,783,389.44 | 8.16 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,766.32 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 55,056.40 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 19,147,470.85 | 0.37 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 26,673,302.00 | 0.52 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 23,850,912.45 | 0.46 |
| J | 金融业 | 31,677,181.00 | 0.62 |
| 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 | 33,490,236.80 | 0.65 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 218,312.43 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 553,908,627.69 | 10.79 |

注：以上行业分类以 2020 年 6 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

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（%） |
|-----------|---------------|--------------|
| A 基础材料 | - | - |
| B 消费者非必需品 | 32,441,278.32 | 0.63 |
| C 消费者常用品 | 15,126,420.25 | 0.29 |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | - | - |
| F 医疗保健 | 35,538,662.02 | 0.69 |

| | | |
|--------|----------------|------|
| G 工业 | - | - |
| H 信息技术 | - | - |
| I 电信服务 | - | - |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | 18,020,344.32 | 0.35 |
| 合计 | 101,126,704.91 | 1.97 |

注：以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 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 | 00853 | 微创医疗 | 1,247,000 | 35,538,662.02 | 0.69 |
| 2 | 06862 | 海底捞 | 1,061,000 | 31,691,526.77 | 0.62 |
| 3 | 300132 | 青松股份 | 1,289,800 | 29,794,380.00 | 0.58 |
| 4 | 002475 | 立讯精密 | 558,824 | 28,695,612.40 | 0.56 |
| 5 | 603517 | 绝味食品 | 373,500 | 26,421,390.00 | 0.51 |
| 6 | 002847 | 盐津铺子 | 264,600 | 25,195,212.00 | 0.49 |
| 7 | 000100 | TCL 科技 | 4,054,400 | 25,137,280.00 | 0.49 |
| 8 | 600031 | 三一重工 | 1,274,580 | 23,911,120.80 | 0.47 |
| 9 | 002821 | 凯莱英 | 98,035 | 23,822,505.00 | 0.46 |
| 10 | 300792 | 壹网壹创 | 133,073 | 23,175,993.68 | 0.45 |

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 | 590,094,000.00 | 11.50 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 395,560,000.00 | 7.71 |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 2,628,727,000.00 | 51.21 |
| 5 | 企业短期融资券 | 89,496,000.00 | 1.74 |
| 6 | 中期票据 | 850,704,000.00 | 16.57 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 473,686,390.97 | 9.23 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 5,028,267,390.97 | 97.96 |

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 | 2028020 | 20 兴业银行小微债 03 | 4,000,000 | 395,560,000.00 | 7.71 |
| 2 | 019627 | 20 国债 01 | 2,900,000 | 290,145,000.00 | 5.65 |

| | | | | | |
|---|-----------|--------------|-----------|----------------|------|
| 3 | 200002 | 20 付息国债 02 | 2,900,000 | 289,942,000.00 | 5.65 |
| 4 | 132013 | 17 宝武 EB | 2,246,980 | 229,708,765.40 | 4.48 |
| 5 | 101582001 | 15 首钢 MTN003 | 1,700,000 | 172,227,000.00 | 3.36 |

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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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：本基金本报告期末未持有贵金属。

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：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

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

根据风险管理原则，本基金以套期保值为主要目的，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。制定国债期货套期保值策略时，基金管理人通过对宏观经济和债券市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，并根据基金现券资产利率风险敞口采用流动性好、交易活跃的期货合约。基金管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，规避利率风险以达到降低投资组合的整体风险的目的。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| | |
|-------------------|--------------|
| 公允价值变动总额合计（元） | - |
| 国债期货投资本期收益（元） | 4,062,233.01 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | -836,300.00 |

注：1、本期国债期货投资本期收益为未扣手续费收益。

2、本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期内以套期保值为主要目的进行了国债期货投资。通过对宏观经济和债券市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型，并与现券资产进行匹配，较好地对冲了利率风险、流动性风险对基金的影响，降低了基金净值的波动。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

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受到调查以及处罚的情况的说明

20 兴业银行小微债 03 (2028020. 1B) 为鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金的前十大持仓证券。交易商协会自律处分信息 (2020 年第 5 次自律处分会议审议决定)：兴业银行股份有限公司作为债务融资工具主承销商，在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本。依据相关自律规定，经 2020 年第 5 次自律处分会议审议，对兴业银行予以警告，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。交易商协会自律处分信息 (2019 年第 9 次自律处分会议审议决定)：兴业银行股份有限公司 (以下简称“兴业银行”) 作为北京粮食集团有限责任公司 (以下简称“京粮集团”) 相关债务融资工具的主承销商，在债务融资工具存续期间未能对京粮集团资产无偿划转重大事项进行有效监测，及时督导京粮集团进行存续期重大事项披露，也未及时召开持有人会议。依据相关自律规定，经 2019 年第 9 次自律处分会议审议，给予兴业银行诫勉谈话处分，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

本基金投资 20 兴业银行小微债 03 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 20 兴业银行小微债 03 外，本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 541,484.93 |
| 2 | 应收证券清算款 | 31,747,500.60 |
| 3 | 应收股利 | 199,333.18 |
| 4 | 应收利息 | 56,943,570.26 |
| 5 | 应收申购款 | 12,213.78 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 89,444,102.75 |

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 | 132013 | 17 宝武 EB | 229,708,765.40 | 4.48 |
| 2 | 110053 | 苏银转债 | 135,565,948.80 | 2.64 |
| 3 | 110059 | 浦发转债 | 40,740,000.00 | 0.79 |
| 4 | 113013 | 国君转债 | 30,865,442.40 | 0.60 |
| 5 | 110064 | 建工转债 | 10,367,302.40 | 0.20 |
| 6 | 128058 | 拓邦转债 | 5,874,912.45 | 0.11 |
| 7 | 110048 | 福能转债 | 5,377,500.00 | 0.10 |
| 8 | 128045 | 机电转债 | 5,363,549.52 | 0.10 |
| 9 | 127012 | 招路转债 | 5,036,500.00 | 0.10 |
| 10 | 113550 | 常汽转债 | 1,482,720.00 | 0.03 |

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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 鹏扬景沃六个月混合 A | 鹏扬景沃六个月混合 C |
|--------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 3,006,220,414.43 | 2,044,757,396.49 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,213,378.93 | 196,606.94 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - | - |
| 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 | 3,007,433,793.36 | 2,044,954,003.43 |

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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：本报告期内基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

§ 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：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
5. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

鹏扬基金管理有限公司

2020 年 7 月 21 日