

鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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 10 月 28 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 10 月 26 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏扬景沃六个月混合	
基金主代码	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	5,710,529,125.57 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	
下属分级基金的基金简称	鹏扬景沃六个月混合 A	鹏扬景沃六个月混合 C
下属分级基金的交易代码	009064	009065
报告期末下属分级基金的份额总额	3,841,616,679.23 份	1,868,912,446.34 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7月1日—2020年9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	42,324,412.63	25,528,201.10
2. 本期利润	74,334,476.71	50,330,041.56
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0220	0.0241
4. 期末基金资产净值	4,006,562,148.08	1,944,950,086.63
5. 期末基金份额净值	1.0429	1.0407

- 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 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

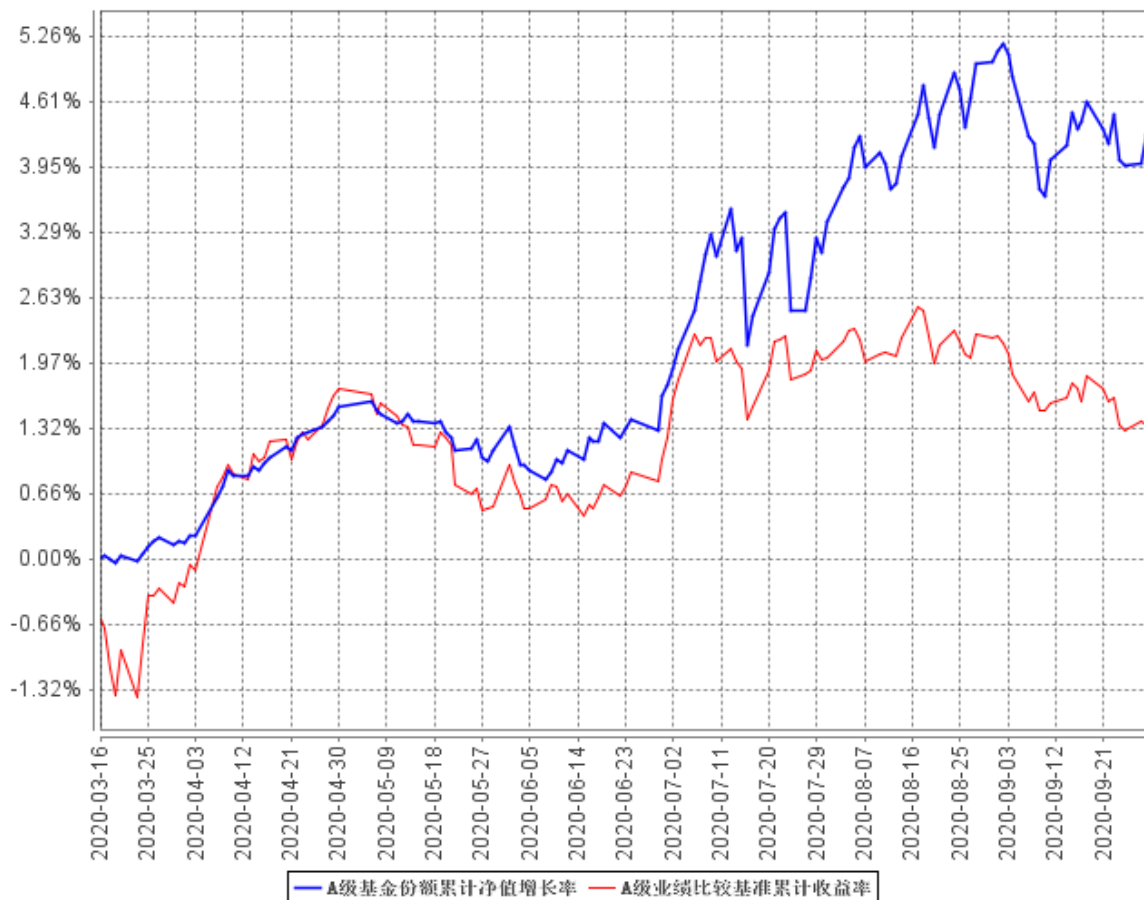
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.61%	0.31%	0.33%	0.18%	2.28%	0.13%
过去六个月	4.09%	0.24%	1.60%	0.18%	2.49%	0.06%
自基金合同生效起至今	4.29%	0.23%	1.34%	0.20%	2.95%	0.03%

鹏扬景沃六个月混合 C

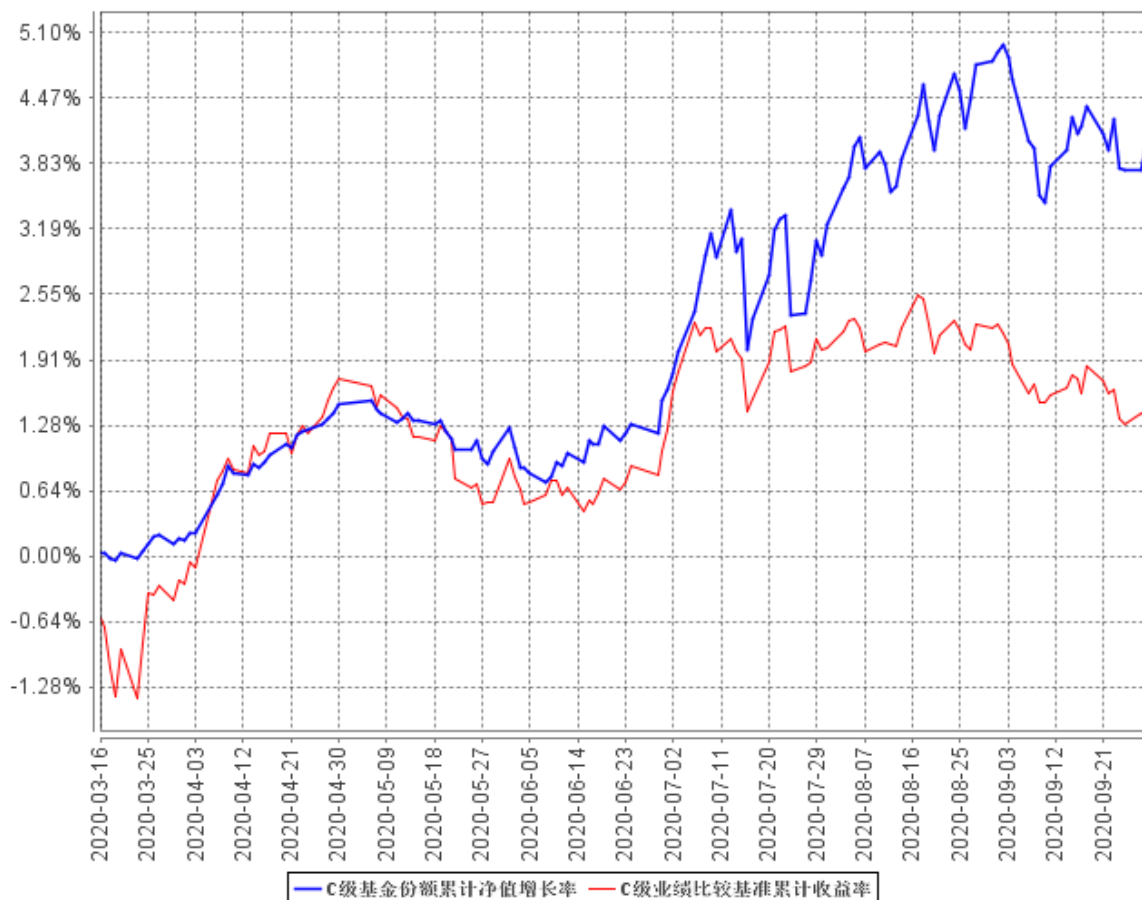
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.51%	0.31%	0.33%	0.18%	2.18%	0.13%
过去六个月	3.89%	0.24%	1.60%	0.18%	2.29%	0.06%
自基金合同生效起至今	4.07%	0.23%	1.34%	0.20%	2.73%	0.03%

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 9 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。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围，四、投资限制”的有关规定。

§ 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、本基金基金经理	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。曾任京粮置业财务部资金专员、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

三季度以来，全球疫情防控有所缓解但仍未出现拐点，美国、巴西、印度等国家新增确诊病例继续维持高位，进入 9 月甚至出现二次反弹态势，全球经济仍面临疫情带来的负面冲击，预计主要发达经济体经济增长在三季度仍难以转正但领先经济指标出现复苏趋势。货币政策方面，全球主要央行在二季度采取了宽松货币政策，在三季度总体货币政策没有进一步宽松进入观察期。美联储推出“平均通货膨胀目标制”的新货币政策框架。财政政策方面，美国两党围绕新一轮的财政刺激计划展开激烈的政治博弈；欧盟达成 7500 亿欧元的复兴基金计划，这是欧元区从宽货币转向宽财政的重要标志。全球金融市场总体平稳，中美两国股票市场涨幅较好，美元指数大幅走弱导致黄金、铜等硬商品大幅上涨，大豆、玉米等软商品价格也出现大幅上涨行情。债券方面，除人民币债券下跌外，全球主要债券市场均呈现上涨态势。

二季度中国经济在宽松货币政策和积极财政政策支持下大幅回升到 3.2%的水平，同时通货膨胀水平稳步下降到 2.4%。进入三季度，货币政策边际收紧，银行间隔夜和 7 天回购利率水平在逐步回升到央行公开市场操作利率水平之上。信贷和社会融资总量扩张方面在宽信贷和宽财政的政策支持下继续维持较高的增长速度。从最新公布的一系列经济指标来看，三季度中国经济在房地产投资、基建投资和超预期的出口数据的支持下回升到 4.9%的水平。

三季度债券市场持续走弱，中债综合全价指数下跌 1.48%。收益率曲线呈现熊市变平格局。1-5 年期限国债利率平均上升幅度约 50BP，7 年以上中长期国债利率上行幅度约 30-40BP。信用债券方面，1-3 年期限的 AAA 和 AA+信用债券利率上行幅度约 50BP，5 年期限利率上行幅度约 30BP。以国开债券为衡量标准，信用利差水平整体呈现压缩趋势。

债券方面，自 5 月债市进入回调，组合始终维持防守操作，保持 1 年以内的短久期票息策略，辅以灵活交易，组合维持中低杠杆水平，控制回撤为主。8 月底组合注重负债管理开启持营，9 月初组合进入可赎回期，为防止规模波动对组合的影响，期间以应对流动性风险为主，继续维持短久期票息策略。9 月末总规模稳定在 60 亿附近，随着市场回调部分资产开始具备配置价值，季末久期小幅提升至 1.5 年，哑铃配置，借力资金波动，积极配置 1-3 年高 AAA 底仓，提升组合静态，长端主要配以 30 年国债。三季度利率债供给压力较大，组合积极参与利率债一级市场投标，灵活波段。

转债方面，仓位维持从 7 月的 5%以上，逢高减仓，到 8 月降低至 3%附近，9 月维持低仓位，配置上以防御性强的银行转债为主，少量配以券商、电子、新能源等行业，成长类转债积极波段

交易。

A 股市场在三季度经历近一个季度的盘整，市场局部泡沫化风险得到比较充分的释放。整体来看，仍可保持相对乐观。市场结构性分化行情已经在相当程度上收敛，前期涨幅较大的板块和行业渐次重新具备配置价值。

权益资产上，三季度本基金根据市场变化，初期逐步减持了组合中估值提升较大的标的，增配了部分顺周期优质龙头公司，组合的集中度进一步下降，在季末时，适度提高集中度，增配了回调较为充分的部分优质标的。

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 1.0429 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.61%；截至本报告期末鹏扬景沃六个月混合 C 基金份额净值为 1.0407 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.51%；同期业绩比较基准收益率为 0.33%。

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	1,234,026,763.24	20.09
	其中：股票	1,234,026,763.24	20.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,623,108,007.13	75.28
	其中：债券	4,623,108,007.13	75.28
	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	206,014,075.01	3.35

8	其他资产	78,444,525.09	1.28
9	合计	6,141,593,370.47	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 152,827,746.89 元，占期末基金资产净值的比例为 2.57%。

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	16,361,675.07	0.27
B	采矿业	-	-
C	制造业	672,126,582.42	11.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	24,182,881.55	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	22,982,333.36	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	69,776,734.17	1.17
J	金融业	153,470,785.44	2.58
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	60,411,350.19	1.02
M	科学研究和技术服务业	61,644,734.56	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	183,777.21	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	45,133.26	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,081,199,016.35	18.17

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	42,338,003.74	0.71
C 消费者常用品	32,752,126.35	0.55
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	24,432,018.75	0.41
G 工业	19,800,619.55	0.33
H 信息技术	1,177,484.80	0.02
I 电信服务	-	-

J 公用事业	-	-
K 房地产	32,327,493.70	0.54
合计	152,827,746.89	2.57

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	600030	中信证券	2,404,794	72,215,963.82	1.21
2	002027	分众传媒	7,485,917	60,411,350.19	1.02
3	002372	伟星新材	2,749,960	43,971,860.40	0.74
4	601688	华泰证券	2,062,700	42,347,231.00	0.71
5	06862	海底捞	847,000	41,493,378.08	0.70
6	600031	三一重工	1,612,380	40,132,138.20	0.67
7	300866	安克创新	270,900	37,067,247.00	0.62
8	603517	绝味食品	440,044	36,092,408.88	0.61
9	000333	美的集团	493,200	35,806,320.00	0.60
10	688188	柏楚电子	147,777	35,129,548.44	0.59

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	597,485,000.00	10.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	202,950,000.00	3.41
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,083,958,000.00	35.02
5	企业短期融资券	736,519,000.00	12.38
6	中期票据	646,414,000.00	10.86
7	可转债（可交换债）	355,782,007.13	5.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,623,108,007.13	77.68

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	200012	20 付息国债 12	2,500,000	248,325,000.00	4.17
2	101559065	15 中航国际 MTN001	1,700,000	171,428,000.00	2.88
3	163833	20 国君 S2	1,600,000	160,000,000.00	2.69
4	019627	20 国债 01	1,500,000	149,850,000.00	2.52
5	019640	20 国债 10	1,500,000	149,475,000.00	2.51

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

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

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

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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

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受到调查以及处罚的情况的说明

18 兴业绿色金融 01(1828014. IB)、18 兴业绿色金融 02(1828017. IB)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。2020 年 9 月 4 日中国人民银行福州中心支行针对兴业银行存在以下主要违法违规事实,给予警告,没收违法所得 10,875,088.15 元,并处 13,824,431.23 元罚款。主要违法违规事实如下: 1. 为无证机构提供转接清算服务,且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定; 2. 为支付机构超范围(超业务、超地域)经营提供支付服务,且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性; 3. 违规连通上、下游支付机构,提供转接清算服务,且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性; 4. 违反银行卡收单外包管理规定; 5. 未按规定履行客户身份识别义务。2020 年 8 月 31 日中国银保监会福建监管局针对兴业银行存在同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保违法违规事实,没收违法所得 6,361,807.97 元,并合计处以罚款 15,961,807.97 元。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。

20 国君 S2(163833.SH)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。2020 年 4 月 30 日中国证券监督管理委员会福建监管局关于对国泰君安证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定：经查，国泰君安证券股份有限公司（下称“你公司”）作为富贵鸟股份有限公司公开发行 2014 年公司债券的承销机构和受托管理人，在尽职调查和受托管理过程中未严格遵守执业规范，未能勤勉尽责地履行相关责任，违反了中国证监会《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 113 号，以下简称《管理办法》）第七条和第四十九条的规定。根据《管理办法》第五十八条的相关规定，福建证监局决定对你公司采取出具警示函的监督管理措施，你公司应引以为戒，在开展业务时恪守勤勉尽责义务，严格遵守职业规范和监管规则，加强业务质量控制，提升合规水平。2019 年 12 月 19 日中国证券监督管理委员会上海监管局针对国泰君安证券股份有限公司分支机构员工存在替客户办理证券交易操作、为客户的融资活动提供便利等违规行为，你公司未能有效动态监控客户交易活动，未及时报告、处置重大异常行为，在分支机构管理、异常交易和操作监控等方面存在不足情形，采取出具警示函的行政监管措施。

本基金投资 18 兴业绿色金融 01、18 兴业绿色金融 02、20 国君 S2 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 18 兴业绿色金融 01、18 兴业绿色金融 02、20 国君 S2 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	992,983.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	54,629,911.51
5	应收申购款	22,821,629.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,444,525.09

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	143,638,145.00	2.41
2	110053	苏银转债	86,458,605.40	1.45
3	110059	浦发转债	40,924,000.00	0.69
4	113013	国君转债	14,247,539.10	0.24
5	110064	建工转债	10,658,793.60	0.18
6	127005	长证转债	10,348,800.00	0.17
7	128065	雅化转债	10,322,029.58	0.17
8	127012	招路转债	5,238,500.00	0.09
9	113542	好客转债	3,467,700.00	0.06
10	128090	汽模转 2	2,882,500.00	0.05
11	128058	拓邦转债	2,545,563.45	0.04
12	128021	兄弟转债	2,389,702.58	0.04
13	113563	柳药转债	2,366,200.00	0.04
14	128075	远东转债	1,294,900.00	0.02
15	113557	森特转债	1,079,000.00	0.02

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	3,007,433,793.36	2,044,954,003.43
报告期期间基金总申购份额	2,121,486,422.10	668,286,661.39
减：报告期期间基金总赎回份额	1,287,303,536.23	844,328,218.48
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	3,841,616,679.23	1,868,912,446.34

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§ 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**

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

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

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

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 10 月 28 日