

鹏扬产业智选一年持有期混合型
证券投资基金
2023 年中期报告

2023 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 25 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
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	13
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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等内容真实、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（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45

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	46
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	51
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	51
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12	投资组合报告附注	52
§ 8	基金份额持有人信息	53
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3	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的情况	53
§ 9	开放式基金份额变动	54
§ 10	重大事件揭示	54
10.1	基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4	基金投资策略的改变	54
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	55
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8	其他重大事件	56
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12	备查文件目录	57
12.1	备查文件目录	57
12.2	存放地点	57
12.3	查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏扬产业智选一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	鹏扬产业智选一年持有混合	
基金主代码	015219	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 9 月 1 日	
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	900,448,783.93 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏扬产业智选一年持有混合 A	鹏扬产业智选一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	015219	015220
报告期末下属分级基金的份额总额	822,014,220.50 份	78,434,563.43 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，精选优质上市公司进行投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略包括：类属资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资业务策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*65%+恒生指数收益率*15%+中债综合财富(总值)指数收益率*20%
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

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		鹏扬基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	宋震	郭明
	联系电话	010-68105888	010-66105799
	电子邮箱	service@pyamc.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-968-6688	95588
传真		010-68105966	010-66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区栖霞路 120 号 3 层 302 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	北京市西城区复兴门外大街 A2 号 西城金茂中心 16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100045	100140
法定代表人	杨爱斌	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.pyamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏扬基金管理有限公司	北京市西城区复兴门外大街 A2 号西城 金茂中心 16 层

§ 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

基金类别	鹏扬产业智选一年持有混合 A	鹏扬产业智选一年持有混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）	报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-92,610,290.56	-9,059,471.73
本期利润	-101,944,597.40	-9,956,764.64
加权平均基金份额本期利润	-0.1241	-0.1275
本期加权平均净值利润率	-13.30%	-13.73%
本期基金份额净值增长率	-12.58%	-12.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 6 月 30 日）	
期末可供分配利润	-116,499,961.41	-11,563,499.95
期末可供分配基金份额利润	-0.1417	-0.1474
期末基金资产净值	708,031,731.06	67,112,755.05
期末基金份额净值	0.8613	0.8557
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 6 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-13.87%	-14.43%

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。

(2) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

(3) 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

鹏扬产业智选一年持有混合 A

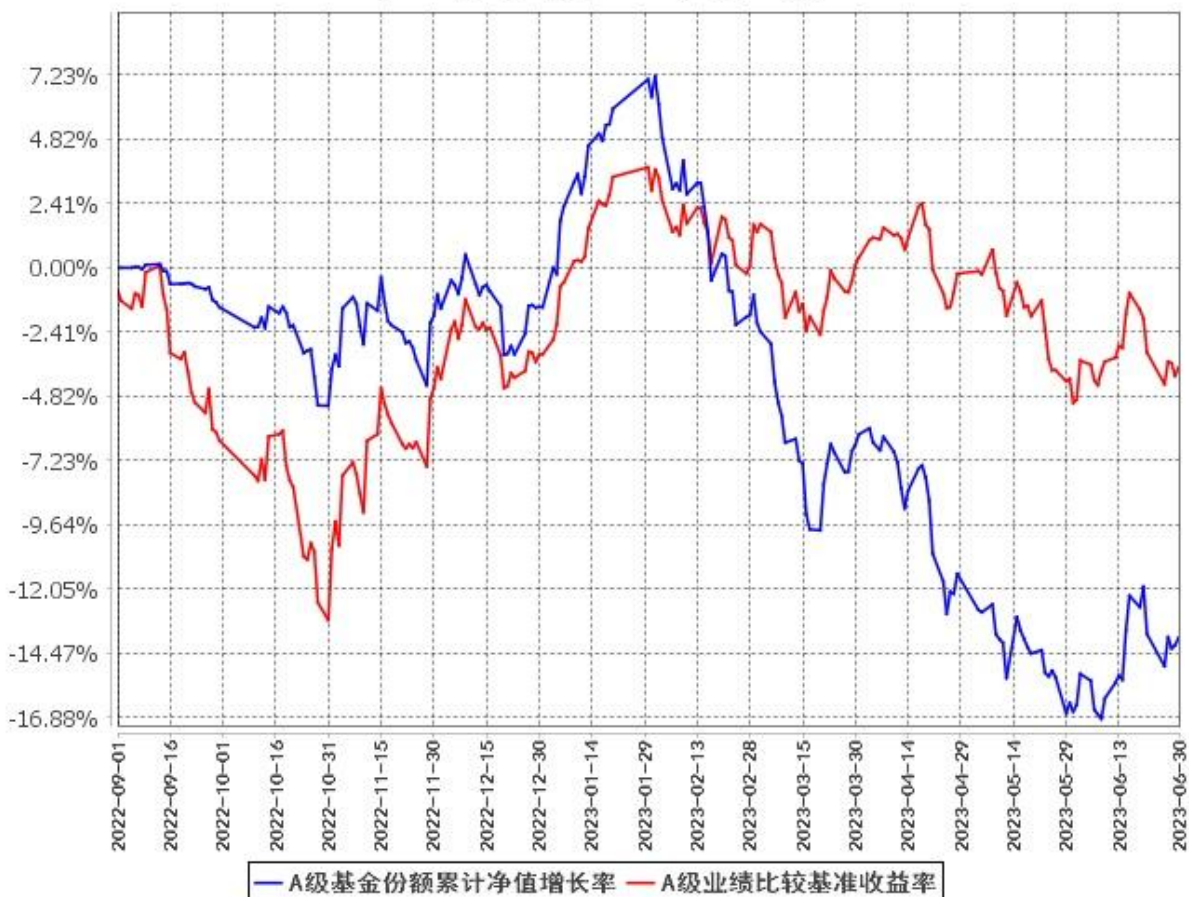
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.34%	1.05%	1.42%	0.75%	1.92%	0.30%
过去三个月	-8.13%	0.97%	-4.09%	0.68%	-4.04%	0.29%
过去六个月	-12.58%	0.94%	-0.50%	0.70%	-12.08%	0.24%
自基金合同生效起至今	-13.87%	0.85%	-3.73%	0.87%	-10.14%	-0.02%

鹏扬产业智选一年持有混合 C

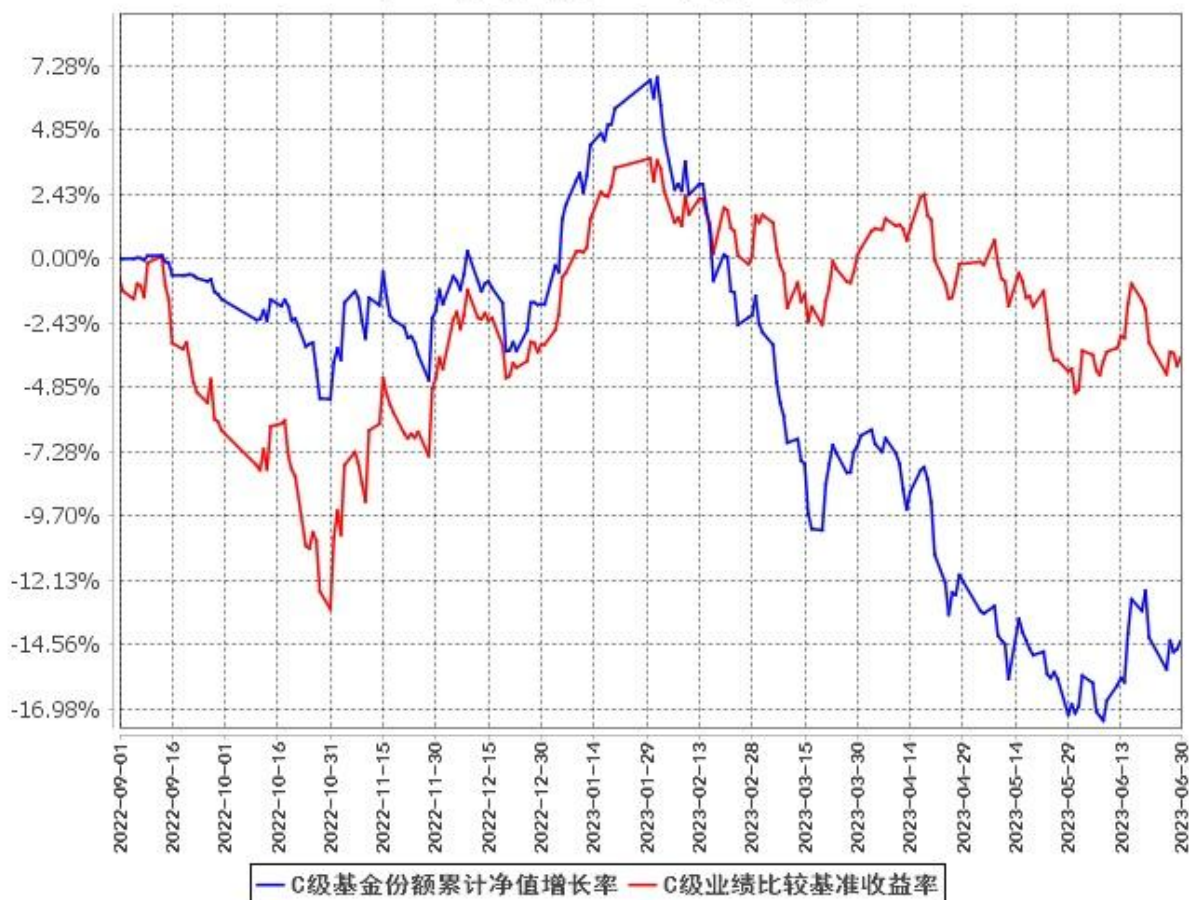
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.28%	1.05%	1.42%	0.75%	1.86%	0.30%
过去三个月	-8.30%	0.97%	-4.09%	0.68%	-4.21%	0.29%
过去六个月	-12.91%	0.94%	-0.50%	0.70%	-12.41%	0.24%
自基金合同生效起至今	-14.43%	0.85%	-3.73%	0.87%	-10.70%	-0.02%

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

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
(2022年9月1日至2023年6月30日)



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
(2022年9月1日至2023年6月30日)



注：(1)本基金合同于 2022 年 9 月 1 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

(2)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的有关规定。

§ 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

鹏扬基金管理有限公司(以下简称“鹏扬基金”)成立于 2016 年 7 月 6 日，是经中国证监会批准成立的国内首家“私转公”基金管理公司，总部位于北京。

公司坚持特色化经营，逐渐形成主动股票、特色指数、多资产 FOF 和传统强项固收业务齐头并进的多元化格局。

公司践行高质量发展。在公司治理和人才战略方面，公司充分发挥专业人士控股的治理结构优势，汇聚海内外优秀人才，致力于打造一支将服务投资者作为长期事业的人才队伍。公司核心投资人员均具有 10 年以上知名金融机构工作经历。公司持续开展“鲲鹏人才培养计划”，为应届毕业生

提供就业岗位，充实投研与金融科技人才梯队。

公司致力于打造平台化、团队化、一体化的投研体系，实现“宏观、策略、行业、公司”的全维度研究覆盖，为客户提供“全天候”的资产管理解决方案。其中，固收团队持续提升宏观研究与资产配置、利率交易、信用研究、转债增强等核心投资能力，力求为投资人获取长期、稳健的收益；股票团队致力于做深度的个股研究和产业研究，遵循基本面理念严选个股，同时充分保留基金经理自身风格特点；指数团队聚焦高质量核心资产，深挖面向未来的行业主题，努力为投资者提供具有长期良好持有体验的指数产品；多资产团队将基于大数据的定量研究和基于调研访谈的定性研究有机结合，为投资者提供便捷的 FOF 组合方案，有效分散投资风险，助力资产稳健增值。

公司高度注重风险管理，并以科技赋能业务。公司从文化上树立全员风险防范意识；从制度上实现风险管理对投前、投中、投后的全流程覆盖；从结果上检验风险管理成效，杜绝风险事件的发生；从科技手段上，公司自主研发的“基于大数据的智能投资与风险管理平台”正式上线运行，实现研究、投资、交易、风控的一体化，大幅提升资管全流程的运作效率，提升风险管理的有效性。

凭借优异的投资业绩和出色的风险管理能力，公司旗下产品鹏扬利泽于 2023 年在证券时报社主办的第十八届中国基金业明星基金奖中荣获“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。银河证券《公募基金管理人长期主动股票投资管理能力和榜单》显示，截至 2023 年 6 月 30 日，鹏扬基金近三年的股票投资主动管理收益率为 23.29%，在 125 家参评公募基金管理人中排名第 12。

公募基金行业高质量发展需要创新驱动。鹏扬基金长期关注客户所需，坚持守正创新。在中国公募基金行业成立 25 周年之际，公司旗下的鹏扬利泽和鹏扬数字经济 ETF 凭借创新性和优秀的持续表现，分别作为国内首只中短债基金和首只数字经济 ETF，入选《中国基金报》五年一度的“行业创新范例”（固收类、指数类）。2023 年 6 月，鹏扬基金发行的国内首只 30 年期国债 ETF 正式上市，不仅为投资者配置超长期国债，管理久期风险提供了全新的工具，而且提升了国债二级市场流动性，助力国债市场高质量发展。

鹏扬基金作为一家有理想、有担当的公募基金公司，全面履行社会责任，持续开展投资者教育和公益慈善活动。作为中国基金业协会投教专委会委员单位，公司积极联合各类媒体平台和行业机构力量，开展投资者教育工作。在中国基金业协会的指导下，公司深入三四线城市和校园，开展多层次的投教活动，内容涵盖基金投资基础知识和进阶经济金融专业讲座。2023 年 3 月，包括公司总经理在内的 6 位投研负责人开启了为期一年的线上实盘定投，并定期提供投教与陪伴，与投资者共赴长期投资、价值投资之约。在我国国债期货合约上市 10 周年以及 30 年国债期货上市之年，公司在中国基金业协会、中国金融期货交易所的指导下，举行多场面向专业投资者的投教活动，助力行业稳步推进金融衍生品投资，提升资本市场长期稳定性。在 2023 年“7.1”前夕，公司在延安市延

长县初级中学捐助的“金鹏电教室”落地，为乡村振兴和教育事业贡献力量。

鹏扬基金以“为客户创造价值，为美好生活助力”为使命，秉持“客户至上、勇于担当、拥抱变化、合作共赢”的价值观，以“专业稳健，回报信任”作为经营宗旨。公司的长远目标是成为中国资本市场上有影响力的、能持续为客户创造价值的资产管理公司。在专业人士持股的治理机制下，客户利益、股东利益及管理者的利益高度一致，使得公司能够更加专注于长期目标，寻求服务投资者的最佳方案，在大资管行业迈向高阶发展的进程中行稳致远。

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		
邓彬彬	本基金 基金经 理,股 票投 资部 副总 监	2022年9月1日	-	15	中国人民银行研究生部金融学硕士。曾任国投瑞银基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资经理、基金经理，华夏基金管理有限公司研究员、基金经理，百毅资本管理有限公司投资经理。现任鹏扬基金管理有限公司股票投资部副总监。2020年6月29日至2021年7月20日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29日至今任鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2020年6月29日至今任鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金基金经理；2021年2月2日至今任鹏扬先进制造混合型证券投资基金基金经理；2022年1月27日至今任鹏扬产业趋势一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2022年9月1日至今任鹏扬产业智选一年持有期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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》

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 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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《鹏扬基金管理有限公司公平交易制度》，公平对待旗下管理的所有基金及其它组合。

本基金管理人通过统计检验的方法对本公司旗下管理的所有投资组合，在本报告期内不同时间窗口下(1日内、3日内、5日内)同向交易的价差进行了专项分析，包括旗下各大类资产组合之间的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为0的T检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下组合存在违反公平交易的情况。

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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现涉及本基金的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

2023年上半年，股票市场行业分化显著。高股息资产和受益于AI的TMT板块表现较好，供需恶化的板块新能源、CXO等表现较差。我们分析内在原因：第一，经济复苏弱于预期，全球地缘政治的不确定性，市场用高股息确定性资产避险；第二，ChatGPT逐步演变为杀手级的应用，带来AI板块的系统性机会。

操作方面，本基金投资主要聚焦在新能源、食品饮料和TMT板块。其中，新能源板块的投资损失较大。我们的投资理念是坚持长期从三个维度去思考行业和公司：第一，行业景气周期。考虑行

业的长期空间和细分行业的竞争壁垒。第二，公司质地。重点关注公司管理层是否优秀，是否长期创造了股东价值。第三，估值水平。产业演变是我们最重要的底层逻辑，聚焦于科技、消费和金融三大领域，选择优质的公司进行投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬产业智选一年持有混合 A 的基金份额净值为 0.8613 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.58%；截至本报告期末鹏扬产业智选一年持有混合 C 的基金份额净值为 0.8557 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.91%；同期业绩比较基准收益率为-0.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，我们判断全球库存周期结束，国内托底的政策逐步到来，各行业逐步补库存，PPI 见底。我们相对看好可选消费、顺周期（有色，化工和部分机械公司）、互联网公司和具备核心竞争力的新能源公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（成员包括公司分管领导以及投资研究部、风险管理部、监察稽核部、交易管理部、基金运营部等部门负责人及相关业务骨干，估值委员会成员中不包括基金经理）。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——鹏扬基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对鹏扬基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：鹏扬产业智选一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,583,610.14	12,079,760.80
结算备付金		3,833,467.52	10,653,443.14
存出保证金		397,798.38	203,041.64
交易性金融资产	6.4.7.2	750,249,349.98	829,859,038.84
其中：股票投资		705,535,635.30	760,048,771.17
基金投资		-	-
债券投资		44,713,714.68	69,810,267.67
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	13,996,799.45	30,993,917.81
应收清算款		1,367,903.22	3,988,873.45
应收股利		-	-
应收申购款		9,835.52	1,075.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		780,438,764.21	887,779,151.53
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		2,712,869.03	1,751,096.03
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		946,557.78	1,126,486.42
应付托管费		157,759.65	187,747.72
应付销售服务费		43,714.05	51,732.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		453.11	4,634.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,432,924.48	1,227,821.73
负债合计		5,294,278.10	4,349,518.75
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	900,448,783.93	896,875,997.08
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-125,304,297.82	-13,446,364.30
净资产合计		775,144,486.11	883,429,632.78
负债和净资产总计		780,438,764.21	887,779,151.53

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 900,448,783.93 份，其中鹏扬产业智选一年持有混合 A 基金份额净值 0.8613 元，基金份额总额 822,014,220.50 份；鹏扬产业智选一年持有混合 C 基金份额净值 0.8557 元，基金份额总额 78,434,563.43 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏扬产业智选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-104,081,803.67
1. 利息收入		123,060.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	85,570.50
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		37,489.86
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-93,973,264.28
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-100,860,938.39
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	978,916.76
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	5,908,757.35
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）	6.4.7.16	-10,231,599.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
减：二、营业总支出		7,819,558.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,263,443.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,043,907.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	288,706.77
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		100,599.14
其中：卖出回购金融资产支出		100,599.14
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		189.84
8. 其他费用	6.4.7.19	122,711.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-111,901,362.04
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-111,901,362.04
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-111,901,362.04

注：本基金合同于 2022 年 9 月 1 日生效，无上年度可比期间。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏扬产业智选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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 (基金净值)	896,875,997.08	-	-13,446,364.30	883,429,632.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	896,875,997.08	-	-13,446,364.30	883,429,632.78
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	3,572,786.85	-	-111,857,933.52	-108,285,146.67
(一)、综合收益总额	-	-	-111,901,362.04	-111,901,362.04
(二)、本期基金份额 交易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	3,572,786.85	-	43,428.52	3,616,215.37
其中：1. 基金申购款	3,572,786.85	-	43,428.52	3,616,215.37
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的基金净值变动(净 值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	900,448,783.93	-	-125,304,297.82	775,144,486.11

注：本基金合同于 2022 年 9 月 1 日生效，无上年度可比期间。

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：

杨爱斌	崔雁巍	韩欢
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

鹏扬产业智选一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[2022]264号《关于准予鹏扬产业智选一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册,由鹏扬基金管理有限公司于2022年7月27日至2022年8月30日向社会公开募集,首次募集的有效净认购金额为人民币896,082,790.04元,有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币185,249.29元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2022)验字第61290365_A18号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,基金合同于2022年9月1日生效,基金合同生效日的基金份额总额为896,268,039.33份基金份额,其中认购资金利息折合185,249.29份基金份额,本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为鹏扬基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称港股通标的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、可转债、可交换债、可分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品)、货币市场工具、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、资产支持证券、债券回购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。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务。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。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不得超过本基金所投资股票资产的50%)。每个交易日日终,在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在1年以内的政府债券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。如法律法规或监管机构变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资比例。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会

会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净值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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；

存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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(以下简称“资管产品运营业务”)，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、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股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、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；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基

金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	10,583,610.14
等于：本金	10,582,421.83
加：应计利息	1,188.31
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	10,583,610.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	702,997,441.26	-	705,535,635.30	2,538,194.04
贵金属投资-金交所黄金 合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	44,168,929.80	44,713,714.68	22,510.20
	银行间市场	-	-	-
	合计	44,168,929.80	44,713,714.68	22,510.20
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	747,166,371.06	522,274.68	750,249,349.98	2,560,704.24

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	13,996,799.45	-

银行间市场	-	-
合计	13,996,799.45	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,276,265.83
其中：交易所市场	1,276,265.83
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	156,658.65
合计	1,432,924.48

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

鹏扬产业智选一年持有混合 A		
项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	819,469,397.25	819,469,397.25
本期申购	2,544,823.25	2,544,823.25
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	822,014,220.50	822,014,220.50

金额单位：人民币元

鹏扬产业智选一年持有混合 C	
项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,406,599.83	77,406,599.83
本期申购	1,027,963.60	1,027,963.60
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	78,434,563.43	78,434,563.43

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。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

鹏扬产业智选一年持有混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-23,792,644.84	11,691,368.63	-12,101,276.21
本期利润	-92,610,290.56	-9,334,306.84	-101,944,597.40
本期基金份额交易产生的变动数	-97,026.01	160,410.18	63,384.17
其中：基金申购款	-97,026.01	160,410.18	63,384.17
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-116,499,961.41	2,517,471.97	-113,982,489.44

单位：人民币元

鹏扬产业智选一年持有混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,446,468.70	1,101,380.61	-1,345,088.09
本期利润	-9,059,471.73	-897,292.91	-9,956,764.64
本期基金份额交易产生的变动数	-57,559.52	37,603.87	-19,955.65
其中：基金申购款	-57,559.52	37,603.87	-19,955.65
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,563,499.95	241,691.57	-11,321,808.38

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	38,224.65
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	44,193.19
其他	3,152.66
合计	85,570.50

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,898,471,209.42
减：卖出股票成本总额	1,994,581,653.10
减：交易费用	4,750,494.71
买卖股票差价收入	-100,860,938.39

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	548,784.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	430,132.76
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	978,916.76

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	35,472,689.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	34,212,111.44
减：应计利息总额	830,275.13
减：交易费用	170.00
买卖债券差价收入	430,132.76

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,908,757.35
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	5,908,757.35

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-10,231,599.75
——股票投资	-10,558,161.19
——债券投资	326,561.44
——资产支持证券投资	-
——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	-10,231,599.75

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	42,151.28
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	534.00
港股通证券组合费	1,919.01
合计	122,711.66

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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

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

本基金本报告期不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。

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
鹏扬基金管理有限公司（“鹏扬基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
杨爱斌	基金管理人股东

注：以下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

本基金合同于 2022 年 9 月 1 日生效，无上年度可比期间。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

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
	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	6,263,443.65
其中：支付销售机构的客户维护费	2,974,983.92

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	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	1,043,907.31

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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 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		
	鹏扬产业智选一年持有混合 A	鹏扬产业智选一年持有混合 C	合计
鹏扬基金	-	541.60	541.60
工商银行	-	9,782.93	9,782.93
合计	-	10,324.53	10,324.53

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.80%年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务

费计算方法如下：

$$H=E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

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

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

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

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

份额单位：份

鹏扬产业智选一年持有混合 A				
关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
杨爱斌	1,000,131.51	0.11%	1,000,131.51	0.11%

注：(1) 以上关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书及相关临时公告、交易所、登记结算机构的有关规定。

(2) 对于分级基金，下属分级份额的比例的分母采用基金总份额。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	10,583,610.14	38,224.65

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 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										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	19.86	18.06	4,899	97,294.14	88,475.94	-
688485	九州一轨	2023 年 1 月 11 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	11.10	17.04	3,172	35,209.20	54,050.88	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	5.69	5.41	9,563	54,413.47	51,735.83	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	23.60	64.67	764	18,030.40	49,407.88	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	23.77	42.89	1,130	26,860.10	48,465.70	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	38.13	31.03	1,012	38,587.56	31,402.36	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	39.99	36.71	847	33,871.53	31,093.37	-
688146	中船特	2023 年 4 月	上市后 6 个月	新股锁	36.15	38.13	804	29,064.	30,656.	-

	气	13 日	月	定期流 通受限				60	52	
301246	宏源药 业	2023 年 3 月 10 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	50.00	30.71	931	46,550. 00	28,591. 01	-
688352	颀中科 技	2023 年 4 月 11 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	12.10	12.07	2,361	28,568. 10	28,497. 27	-
301486	致尚科 技	2023 年 6 月 30 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	57.66	57.66	482	27,792. 12	27,792. 12	-
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	67.28	65.43	409	27,517. 52	26,760. 87	-
688582	芯动联 科	2023 年 6 月 21 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	26.74	40.68	648	17,327. 52	26,360. 64	-
301293	三博脑 科	2023 年 4 月 25 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	29.60	71.42	333	9,856.8 0	23,782. 86	-
301303	真兰仪 表	2023 年 2 月 13 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	26.80	22.32	1,058	28,354. 40	23,614. 56	-
688552	航天南 湖	2023 年 5 月 8 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	21.17	23.50	956	20,238. 52	22,466. 00	-
688570	天玛智 控	2023 年 5 月 29 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	30.26	25.33	884	26,749. 84	22,391. 72	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	32.34	31.86	687	22,217. 58	21,887. 82	-
688543	国科军 工	2023 年 6 月 14 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	43.67	53.05	410	17,904. 70	21,750. 50	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	11.88	21.02	1,030	12,236. 40	21,650. 60	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	75.00	90.76	221	16,575. 00	20,057. 96	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	125.80	118.03	163	20,505. 40	19,238. 89	-

601061	中信金属	2023年3月30日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	6.58	7.58	2,524	16,607.92	19,131.92	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	245.56	122.11	150	36,834.00	18,316.50	-
301262	海看股份	2023年6月13日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301383	天键股份	2023年5月31日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
688562	航天软件	2023年5月15日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	双元科技	2023年5月31日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301408	华人健康	2023年2月22日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301397	溯联股份	2023年6月15日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
688334	西高院	2023年6月9日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023年5月25日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
301387	光大同创	2023年4月10日	上市后6个月	新股锁定期流	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-

				通受限						
301322	绿通科技	2023年2月27日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64	
301382	蜂助手	2023年5月9日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	
301320	豪江智能	2023年6月1日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	
688433	华曙高科	2023年4月7日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	
688629	华丰科技	2023年6月16日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	
688620	安凯微	2023年6月15日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	
301345	涛涛车业	2023年3月10日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	
301292	海科新源	2023年6月29日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	
301315	威士顿	2023年6月13日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	
688523	航天环宇	2023年5月26日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	
301225	恒勃股份	2023年6月8日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	
301429	森泰股份	2023年4月10日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	
601065	江盐集团	2023年3月31日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	
688631	莱斯信息	2023年6月19日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	
688479	友车科	2023年5月	上市后6个月	新股锁	33.99	29.49	332	11,284.	9,790.6-	

	技	4 日	月	定期流 通受限				68	8	
301232	飞沃科 技	2023 年 6 月 8 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	
301376	致欧科 技	2023 年 6 月 14 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	
301355	南王科 技	2023 年 6 月 2 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	
301357	北方长 龙	2023 年 4 月 11 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	
301386	未来电 器	2023 年 3 月 21 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	
688429	时创能 源	2023 年 6 月 20 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	
301373	凌玮科 技	2023 年 1 月 20 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	
301170	锡南科 技	2023 年 6 月 16 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	
688535	华海诚 科	2023 年 3 月 28 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	
601133	柏诚股 份	2023 年 3 月 31 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	
301157	华塑科 技	2023 年 3 月 1 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	
301202	朗威股 份	2023 年 6 月 28 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	
301295	美硕科 技	2023 年 6 月 19 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	

301203	国泰环 保	2023 年 3 月 28 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	
688603	天承科 技	2023 年 6 月 30 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	
301261	恒工精 密	2023 年 6 月 29 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	
301337	亚华电 子	2023 年 5 月 16 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	
301428	世纪恒 通	2023 年 5 月 10 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	
301281	科源制 药	2023 年 3 月 28 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	
001380	华纬科 技	2023 年 5 月 9 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	
603125	常青科 技	2023 年 3 月 30 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	
001328	登康口 腔	2023 年 3 月 29 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	
001282	三联锻 造	2023 年 5 月 15 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	
001360	南矿集 团	2023 年 3 月 31 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	
603137	恒尚节 能	2023 年 4 月 10 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	
001324	长青科 技	2023 年 5 月 12 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	
001367	海森药 业	2023 年 3 月 30 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	
603172	万丰股 份	2023 年 4 月 28 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	

				通受限						
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	5 个交易日	新股未上市流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个交易日	新股未上市流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	5 个交易日	新股未上市流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个交易日	新股未上市流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	7 个交易日	新股未上市流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
688507	索辰科技	-	上市后 6 个月	锁定期送/转股	-	122.11	72	-	8,791.92	-
301322	绿通科技	-	上市后 6 个月	锁定期送/转股	-	53.24	130	-	6,921.20	-
301281	科源制药	-	上市后 6 个月	锁定期送/转股	-	25.10	96	-	2,409.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人通过制定政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程持续监控上

述各类风险。

本基金管理人将风险管理思想融入公司整体组织架构的设计中，从而实现全方位、多角度风险管理，确保产品风险暴露不超越投资者的风险承受能力。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。基金经理、风险管理部、交易管理部、基金运营部以及监察稽核部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理。从投资决策制定层面，投资决策委员会、投资总监、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理。从投资决策执行层面，风险管理部、交易管理部与基金运营部对投资交易与交付的合规风险、操作风险等风险进行管理。从风险监控层面，公司督察长、风险管理部及监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、风险管理委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告。

同时，本基金管理人采用科学的风险管理分析方法对组合面对的投资风险进行分析，主要通过定性分析和定量分析的方法，评估各种金融工具的风险及可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据基金资产所投资的不同金融工具的特征，制定相关风险量化指标及模型，并通过日常量化分析报告确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-

A-1 以下	-	-
未评级	44,713,714.68	49,280,885.75
合计	44,713,714.68	49,280,885.75

注：(1) 债券评级取自第三方评级机构(不含中债资信评估有限责任公司)的债项评级。

(2) 未评级债券包括国债、政策性金融债、央票、地方政府债、短期融资券、公司债等。

(3) 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	20,529,381.92
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	20,529,381.92

注：(1) 债券评级取自第三方评级机构(不含中债资信评估有限责任公司)的债项评级。

(2) 未评级债券包括国债、政策性金融债、央票、地方政府债、中期票据、公司债等。

(3) 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金管理人通过限制投资集中度、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限的情况外(如有)，其余均能及时变现。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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对于基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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。

本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,583,610.14	-	-	-	10,583,610.14
结算备付金	3,833,467.52	-	-	-	3,833,467.52
存出保证金	397,798.38	-	-	-	397,798.38
交易性金融资产	44,713,714.68	-	-	705,535,635.30	750,249,349.98
买入返售金融资产	13,996,799.45	-	-	-	13,996,799.45
应收清算款	-	-	-	1,367,903.22	1,367,903.22
应收申购款	-	-	-	9,835.52	9,835.52
资产总计	73,525,390.17	-	-	706,913,374.04	780,438,764.21
负债					
应付清算款	-	-	-	2,712,869.03	2,712,869.03
应付管理人报酬	-	-	-	946,557.78	946,557.78
应付托管费	-	-	-	157,759.65	157,759.65
应付销售服务费	-	-	-	43,714.05	43,714.05
应交税费	-	-	-	453.11	453.11
其他负债	-	-	-	1,432,924.48	1,432,924.48
负债总计	-	-	-	5,294,278.10	5,294,278.10
利率敏感度缺口	73,525,390.17	-	-	701,619,095.94	775,144,486.11
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,079,760.80	-	-	-	12,079,760.80
结算备付金	10,653,443.14	-	-	-	10,653,443.14
存出保证金	203,041.64	-	-	-	203,041.64
交易性金融资产	69,810,267.67	-	-	760,048,771.17	829,859,038.84
买入返售金融资产	30,993,917.81	-	-	-	30,993,917.81
应收清算款	-	-	-	3,988,873.45	3,988,873.45
应收申购款	-	-	-	1,075.85	1,075.85
资产总计	123,740,431.06	-	-	764,038,720.47	887,779,151.53
负债					
应付清算款	-	-	-	1,751,096.03	1,751,096.03
应付管理人报酬	-	-	-	1,126,486.42	1,126,486.42
应付托管费	-	-	-	187,747.72	187,747.72
应付销售服务费	-	-	-	51,732.41	51,732.41
应交税费	-	-	-	4,634.44	4,634.44
其他负债	-	-	-	1,227,821.73	1,227,821.73
负债总计	-	-	-	4,349,518.75	4,349,518.75
利率敏感度缺口	123,740,431.06	-	-	759,689,201.72	883,429,632.78

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变。		
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-33,298.67	-91,449.07
	市场利率下降 25 个基点	33,351.36	91,810.69

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波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与负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	37,023,729.58	-	37,023,729.58
资产合计	-	37,023,729.58	-	37,023,729.58
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	37,023,729.58	-	37,023,729.58
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	57,956,340.20	-	57,956,340.20
资产合计	-	57,956,340.20	-	57,956,340.20
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	57,956,340.20	-	57,956,340.20

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，对本基金资产负债表日基金资产净值产生的影响。		
假设	除汇率以外的其他变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低外汇风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	港币相对人民币升值 5%	1,851,186.48	2,897,817.01
港币相对人民币贬值 5%	-1,851,186.48	-2,897,817.01	

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是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发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

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	上年度末
----	-----	------

	2023 年 6 月 30 日		2022 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	705,535,635.30	91.02	760,048,771.17	86.03
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	705,535,635.30	91.02	760,048,771.17	86.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	该其他价格风险的敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有股票资产的其他价格风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定市场基准变动 5%，其他变量不变。		
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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场基准上升 5%	36,790,425.88	41,636,750.24
	市场基准下降 5%	-36,790,425.88	-41,636,750.24

注：股票市场基准取沪深 300 指数。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

第一层次	703,507,812.00	759,665,000.40
第二层次	45,336,375.54	69,810,267.67
第三层次	1,405,162.44	383,770.77
合计	750,249,349.98	829,859,038.84

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃(包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃)和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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	705,535,635.30	90.40
	其中：股票	705,535,635.30	90.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	44,713,714.68	5.73
	其中：债券	44,713,714.68	5.73
	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	13,996,799.45	1.79
	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	14,417,077.66	1.85
8	其他各项资产	1,775,537.12	0.23
9	合计	780,438,764.21	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 37,023,729.58 元，占期末基金资产净值的比例为 4.78%。

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

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	485,236,381.31	62.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	65,135.77	0.01
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	160,868,514.11	20.75
J	金融业	22,180,373.00	2.86
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	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	76,875.17	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	485.40	0.00
S	综合	-	-
	合计	668,511,905.72	86.24

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（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-

I 电信服务	37,023,729.58	4.78
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	37,023,729.58	4.78

注：以上行业分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

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	002459	晶澳科技	1,620,000	67,554,000.00	8.72
2	300014	亿纬锂能	1,053,603	63,742,981.50	8.22
3	600519	贵州茅台	29,600	50,053,600.00	6.46
4	002368	太极股份	1,163,906	47,918,010.02	6.18
5	000063	中兴通讯	995,900	45,353,286.00	5.85
6	603799	华友钴业	845,230	38,804,509.30	5.01
7	00700	腾讯控股	121,100	37,023,729.58	4.78
8	000858	五粮液	218,700	35,772,759.00	4.61
9	688111	金山办公	54,697	25,829,017.34	3.33
10	600570	恒生电子	555,911	24,621,298.19	3.18
11	600079	人福医药	851,300	22,934,022.00	2.96
12	600131	国网信通	1,112,900	22,469,451.00	2.90
13	000001	平安银行	1,975,100	22,180,373.00	2.86
14	603806	福斯特	493,500	18,353,265.00	2.37
15	605117	德业股份	105,060	15,711,723.00	2.03
16	002756	永兴材料	244,092	15,282,600.12	1.97
17	600537	亿晶光电	1,935,800	14,789,512.00	1.91
18	002605	姚记科技	285,800	13,269,694.00	1.71
19	603444	吉比特	26,700	13,112,637.00	1.69
20	002531	天顺风能	831,400	12,662,222.00	1.63
21	000860	顺鑫农业	314,100	10,582,029.00	1.37
22	300274	阳光电源	87,500	10,205,125.00	1.32
23	002384	东山精密	389,839	10,096,830.10	1.30
24	601728	中国电信	1,579,700	8,893,711.00	1.15
25	601138	工业富联	341,500	8,605,800.00	1.11
26	603345	安井食品	58,500	8,587,800.00	1.11
27	688012	中微公司	52,129	8,155,582.05	1.05
28	000568	泸州老窖	35,400	7,418,778.00	0.96
29	835185	贝特瑞	257,788	6,264,248.40	0.81
30	000651	格力电器	155,800	5,688,258.00	0.73
31	002126	银轮股份	282,000	4,991,400.00	0.64
32	603927	中科软	120,200	4,634,912.00	0.60

33	300748	金力永磁	38,900	1,163,888.00	0.15
34	002850	科达利	5,900	780,275.00	0.10
35	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.04
36	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
37	688249	晶合集成	4,899	88,475.94	0.01
38	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
39	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
40	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
41	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.01
42	688472	阿特斯	3,172	54,050.88	0.01
43	688469	中芯集成	9,563	51,735.83	0.01
44	688361	中科飞测	764	49,407.88	0.01
45	301358	湖南裕能	1,130	48,465.70	0.01
46	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
47	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
48	301291	明阳电气	1,012	31,402.36	0.00
49	688484	南芯科技	847	31,093.37	0.00
50	688146	中船特气	804	30,656.52	0.00
51	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
52	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
53	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
54	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
55	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
56	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
57	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
58	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
59	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
60	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
61	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
62	001287	中电港	1,030	21,650.60	0.00
63	301322	绿通科技	391	20,816.84	0.00
64	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
65	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
66	601061	中信金属	2,524	19,131.92	0.00
67	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
68	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
69	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
70	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
71	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
72	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
73	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
74	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
75	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00

76	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
77	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
78	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
79	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
80	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
81	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
82	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
83	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
84	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
85	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
86	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
87	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
88	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
89	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
90	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
91	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
92	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
93	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
94	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
95	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
96	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
97	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
98	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
99	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
100	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
101	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
102	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
103	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
104	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
105	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
106	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
107	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
108	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
109	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
110	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
111	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
112	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
113	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
114	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
115	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
116	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
117	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
118	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

119	300251	光线传媒	60	485.40	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	002756	永兴材料	73,464,605.86	8.32
2	603259	药明康德	69,658,895.00	7.89
3	002459	晶澳科技	69,407,076.96	7.86
4	600570	恒生电子	67,605,864.60	7.65
5	688599	天合光能	66,478,539.61	7.53
6	300014	亿纬锂能	57,770,221.18	6.54
7	603799	华友钴业	55,254,938.62	6.25
8	002368	太极股份	53,850,016.27	6.10
9	002460	赣锋锂业	51,437,362.20	5.82
10	000063	中兴通讯	46,498,036.00	5.26
11	002384	东山精密	39,825,350.08	4.51
12	688111	金山办公	35,227,211.56	3.99
13	300769	德方纳米	34,886,844.00	3.95
14	601098	中南传媒	31,525,845.12	3.57
15	00700	腾讯控股	31,169,240.82	3.53
16	605117	德业股份	29,646,143.44	3.36
17	603306	华懋科技	25,979,847.96	2.94
18	002304	洋河股份	25,223,871.40	2.86
19	002475	立讯精密	24,411,283.06	2.76
20	000983	山西焦煤	21,823,024.70	2.47
21	600131	国网信通	21,448,281.57	2.43
22	002709	天赐材料	21,395,929.56	2.42
23	603444	吉比特	20,209,570.00	2.29
24	603345	安井食品	20,017,622.05	2.27
25	300130	新国都	19,613,928.60	2.22
26	301236	软通动力	19,550,277.16	2.21
27	000001	平安银行	19,270,911.94	2.18
28	601318	中国平安	18,452,049.00	2.09
29	000333	美的集团	18,103,846.40	2.05
30	000988	华工科技	17,820,946.70	2.02
31	600537	亿晶光电	17,741,575.00	2.01

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	688599	天合光能	99,528,448.36	11.27
2	002304	洋河股份	64,177,357.00	7.26
3	002460	赣锋锂业	61,948,518.95	7.01
4	603799	华友钴业	60,865,368.38	6.89
5	603259	药明康德	59,554,194.70	6.74
6	002384	东山精密	56,142,122.62	6.36
7	600522	中天科技	53,559,197.05	6.06
8	000034	神州数码	50,225,757.88	5.69
9	000001	平安银行	49,369,532.31	5.59
10	002756	永兴材料	48,423,550.51	5.48
11	835185	贝特瑞	41,004,656.53	4.64
12	600570	恒生电子	37,802,940.03	4.28
13	601318	中国平安	35,342,792.45	4.00
14	300769	德方纳米	31,826,510.34	3.60
15	600036	招商银行	31,708,049.00	3.59
16	002142	宁波银行	31,589,556.37	3.58
17	603659	璞泰来	30,054,331.00	3.40
18	601098	中南传媒	28,882,873.58	3.27
19	000733	振华科技	26,838,243.28	3.04
20	03690	美团-W	23,618,339.76	2.67
21	002475	立讯精密	23,547,758.55	2.67
22	000988	华工科技	21,849,697.55	2.47
23	000983	山西焦煤	21,768,674.30	2.46
24	002709	天赐材料	21,737,420.26	2.46
25	600153	建发股份	20,419,616.75	2.31
26	603306	华懋科技	20,087,713.00	2.27
27	00700	腾讯控股	19,675,652.66	2.23
28	000333	美的集团	19,568,923.99	2.22
29	603986	兆易创新	18,931,750.32	2.14
30	000858	五粮液	18,426,535.00	2.09

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	1,950,626,678.42
卖出股票收入(成交)总额	1,898,471,209.42

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	44,713,714.68	5.77
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	44,713,714.68	5.77

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	019688	22 国债 23	414,000	41,863,373.75	5.40
2	019679	22 国债 14	28,000	2,850,340.93	0.37
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

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

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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。

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	397,798.38
2	应收清算款	1,367,903.22
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,835.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,775,537.12

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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情况。

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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 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

份额级别	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
鹏扬产业智选一年持有混合 A	6,366	129,125.70	1,988,071.57	0.24%	820,026,148.93	99.76%
鹏扬产业智选一年持有混合 C	3,866	20,288.30	100,008.77	0.13%	78,334,554.66	99.87%
合计	10,232	88,003.20	2,088,080.34	0.23%	898,360,703.59	99.77%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	鹏扬产业智选一年持有混合 A	5,949,910.32	0.7238%
	鹏扬产业智选一年持有混合 C	740,773.25	0.9444%
	合计	6,690,683.57	0.7430%

8.3 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	鹏扬产业智选一年持有混合 A	>100
	鹏扬产业智选一年持有混合 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏扬产业智选一年持有混合 A	>100
	鹏扬产业智选一年持有混合 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏扬产业智选一年持有混合 A	鹏扬产业智选一年持有混合 C
基金合同生效日（2022 年 9 月 1 日）基金份额总额	819,105,578.65	77,162,460.68
本报告期期初基金份额总额	819,469,397.25	77,406,599.83
本报告期基金总申购份额	2,544,823.25	1,027,963.60
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	822,014,220.50	78,434,563.43

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

1、基金管理人：

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人托管部门：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

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

本报告期内未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	
中金公司	3	1,342,548,889.06	35.02%	594,066.76	24.69%	-
国信证券	2	810,166,874.93	21.13%	588,381.13	24.45%	-
中信建投	2	639,057,540.73	16.67%	466,238.09	19.37%	-
兴业证券	2	514,378,097.53	13.42%	374,020.05	15.54%	-
安信证券	2	383,255,313.90	10.00%	278,492.12	11.57%	-
东吴证券	2	144,509,212.97	3.77%	105,301.16	4.38%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-

注：(1)基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

(2)基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后被选择的证券经营机构签订协议。

(3)在上述租用的券商交易单元中，兴业证券、东吴证券的交易单元为本基金本报告期内新增的交易单元。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中金公司	6,193,386.00	39.10%	267,810,000.00	47.85%	-	-	-	-
国信证券	5,395,410.00	34.07%	104,000,000.00	18.58%	-	-	-	-
中信建投	4,249,766.90	26.83%	68,000,000.00	12.15%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	45,500,000.00	8.13%	-	-	-	-
安信证券	-	-	59,400,000.00	10.61%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	15,000,000.00	2.68%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	鹏扬产业智选一年持有期混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 1 月 20 日
2	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与天天基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 2 月 8 日
3	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 3 月 13 日
4	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 3 月 21 日
5	鹏扬产业智选一年持有期混合型证券投资基金 2022 年年度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 3 月 29 日
6	鹏扬产业智选一年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 4 月 22 日
7	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分	证监会指定报刊及网	2023 年 4 月 25 日

	基金参与万得基金销售有限公司费率优惠活动的公告	站、公司官网	
8	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 5 月 8 日
9	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 5 月 10 日
10	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 6 月 9 日
11	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 6 月 28 日

§ 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

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。

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

1. 中国证监会核准鹏扬产业智选一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬产业智选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬产业智选一年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. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
6. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 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。

12.3 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

2023年8月30日