

鹏扬景阳一年持有期混合型证券投资基金 2024年第2季度报告

2024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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2024年7月18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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 16 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 2024 年 4 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| 基金简称 | 鹏扬景阳一年混合 | |
| 基金主代码 | 011818 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 9 月 28 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 589,340,323.02 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 | 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、信用衍生品投资策略、融资投资策略。 | |
| 业绩比较基准 | 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 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 鹏扬景阳一年混合 A | 鹏扬景阳一年混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 011818 | 011819 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 543,338,161.44 份 | 46,002,161.58 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 (2024 年 4 月 1 日—2024 年 6 月 30 日) | |
|-----------------|--------------------------------------|---------------|
| | 鹏扬景阳一年混合 A | 鹏扬景阳一年混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -5,839,456.20 | -504,979.46 |
| 2. 本期利润 | 5,560,594.15 | 357,376.18 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0093 | 0.0074 |
| 4. 期末基金资产净值 | 548,706,404.82 | 45,946,911.46 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0099 | 0.9988 |

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) 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

鹏扬景阳一年混合 A

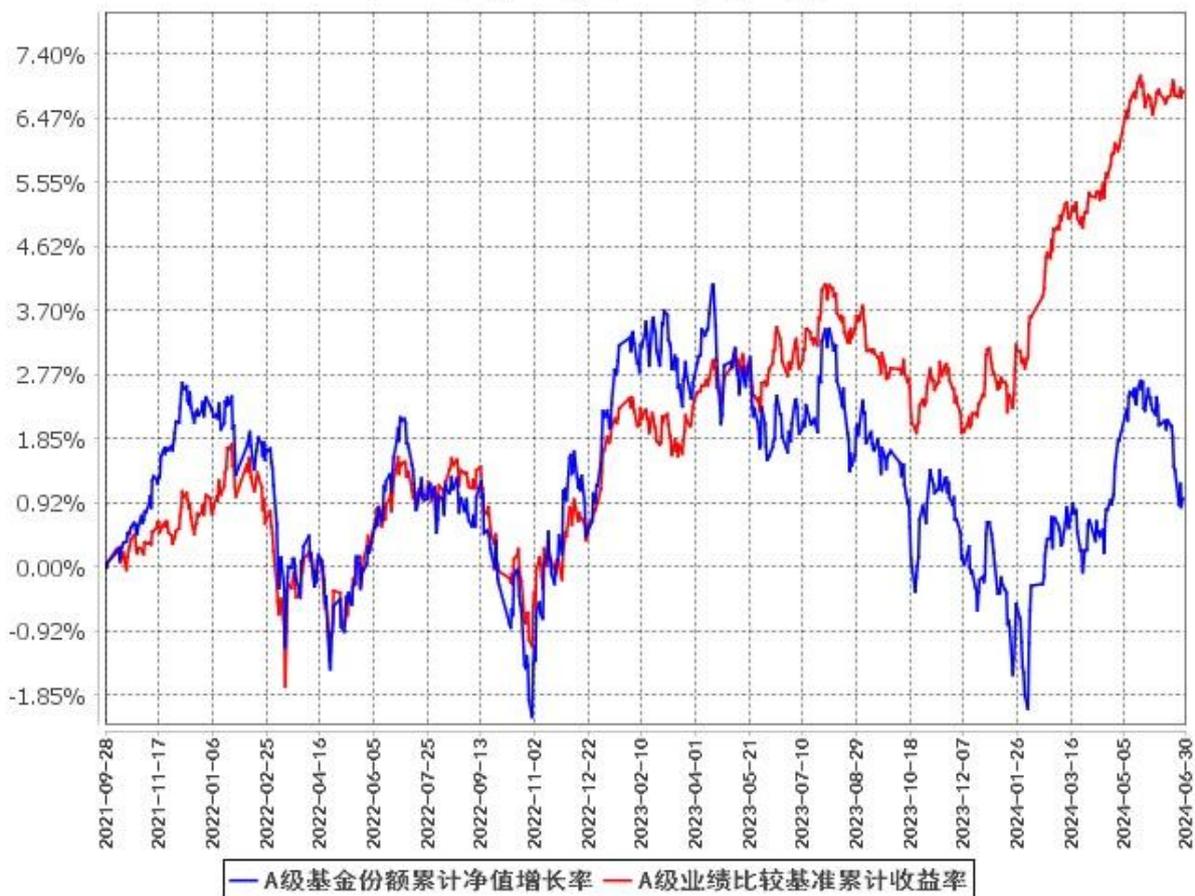
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.74% | 0.20% | 1.65% | 0.11% | -0.91% | 0.09% |
| 过去六个月 | 0.34% | 0.24% | 3.58% | 0.14% | -3.24% | 0.10% |
| 过去一年 | -1.06% | 0.23% | 3.79% | 0.14% | -4.85% | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.99% | 0.24% | 6.86% | 0.17% | -5.87% | 0.07% |

鹏扬景阳一年混合 C

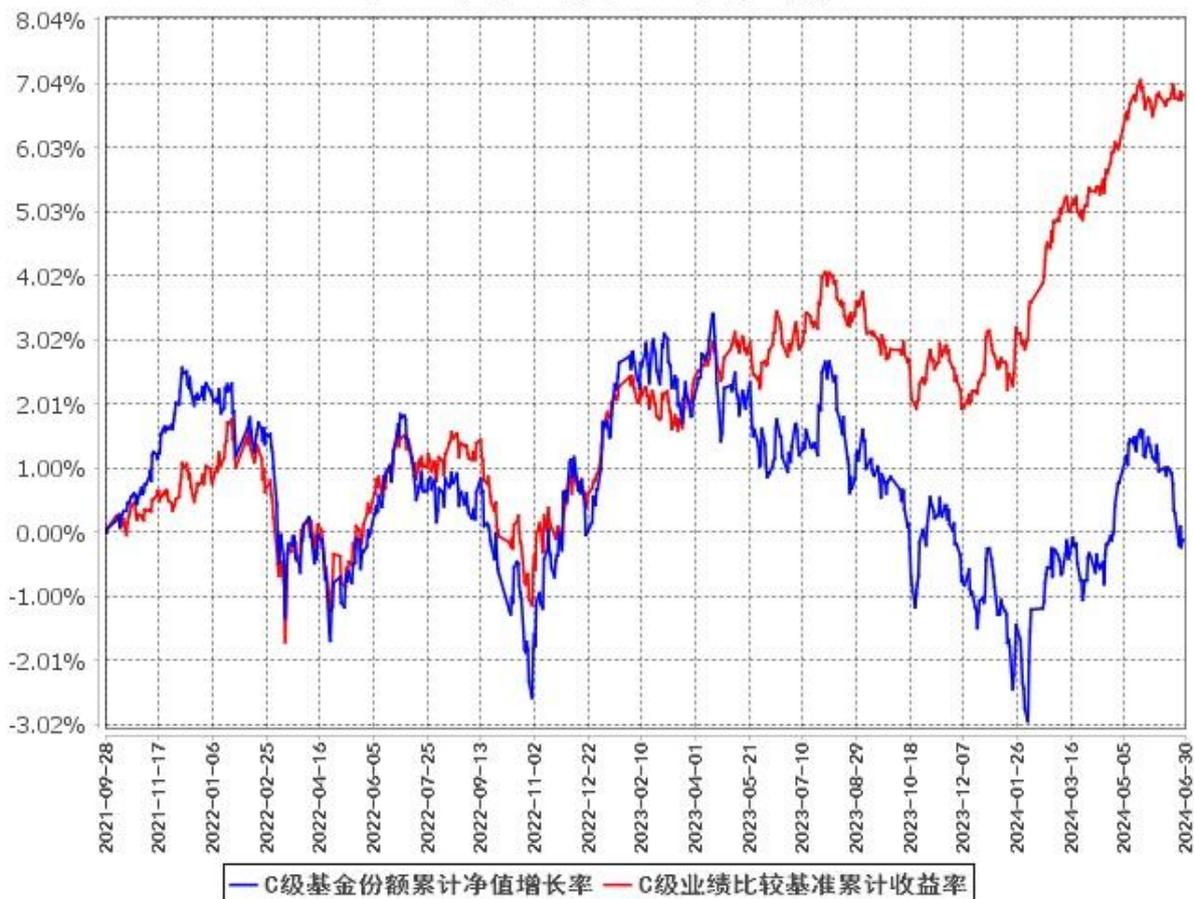
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.63% | 0.20% | 1.65% | 0.11% | -1.02% | 0.09% |
| 过去六个月 | 0.13% | 0.24% | 3.58% | 0.14% | -3.45% | 0.10% |
| 过去一年 | -1.45% | 0.23% | 3.79% | 0.14% | -5.24% | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.12% | 0.23% | 6.86% | 0.17% | -6.98% | 0.06% |

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
(2021年9月28日至2024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
(2021年9月28日至2024年6月30日)



§ 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 | | |
| 杨爱斌 | 本基金基金经理, 总经理 | 2021年9月30日 | - | 24 | 复旦大学国际金融专业经济学硕士。曾任中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理，华夏基金管理有限公司固定收益投资总监，北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。现任鹏扬基金管理有限公司董事、总经理。2017年6月2日至今任鹏扬汇利债券型证券 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>投资基金基金经理；2017 年 6 月 15 日至 2019 年 1 月 4 日任鹏扬利泽债券型证券投资基金基金经理；2018 年 12 月 12 日至今任鹏扬泓利债券型证券投资基金基金经理；2020 年 8 月 11 日至今任鹏扬景沣六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 1 日至今任鹏扬景明一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 1 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；2021 年 7 月 1 日至今任鹏扬景源一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 1 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；2021 年 7 月 7 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；2021 年 7 月 7 日至今任鹏扬景惠六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 9 月 30 日至今任鹏扬景阳一年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|

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 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，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年 2 季度，全球经济动能总体延续较强的韧性，部分发达国家央行逐渐步入降息周期，市场对宏观风险的定价总体延续低位。其中，美国经济“软着陆”仍是主流叙事，经济动能来回摇摆，受金融条件松紧的影响很大，目前未出现趋势变化。美国通胀回落速度偏慢，但是供给端的进一步正常化降低了市场以及美联储对于二次通胀的担忧。

2024 年 2 季度，国内经济动能有所放缓。政策方面，总量政策强调“固本培元”，房地产政策从“三大工程”转为“放开限购+贷款收储”，货币财政政策的强度不及预期。内需方面，制造业投资在产业政策以及出口带动下保持较高增速，消费和基建投资的动能走弱，房地产销售与投资依然较弱。外需方面，受益于美国经济韧性、新兴市场经济好以及价格优势，出口保持较高水平。通货膨胀方面，上游资源品价格仍维持强势，中游制造和下游消费品价格延续低迷，核心原因是上游产能受限、中下游资本开支较大以及内需偏弱。流动性方面，受到汇率贬值压力的影响，降息预期落空，但资金利率基本保持平稳。信用扩张方面，央行在高质量信贷的目标下挤掉信贷水分，信贷和存款增速下滑；结构上，私人部门融资偏弱，政府部门融资回升。

2024 年 2 季度，中债综合全价指数上涨 1.06%。受“手工补息”的叫停、资金面整体宽松以及宏观基本面依然偏弱的影响，债券收益率曲线整体下移。信用债方面，信用利差普遍收窄，AA-评级债券的信用利差压缩最为突出。转债方面，市场先涨后跌。4 月至 5 月市场上涨的驱动来自股债同步走强以及转债估值修复。6 月份转债估值一度降至过去 5 年的低位水平，弱资质转债出现急跌，市场下跌的核心原因是信用风险的担忧大范围扩散。至报告期末，转债估值水平中性略偏低。

利率策略方面，本基金本报告期内止盈了超短端绝对收益偏低的利率债，通过中端利率债赚取了资本利得，增配了有利差保护的中端地方政府债。在利率低位环境下，组合注重资产配置性价比和安全性，并通过适度参与国债期货衍生品交易来进行利率风险管理。信用策略方面，组合坚持中高等级信用债配置策略，并根据相对价值变化调整仓位，2 季度组合信用债仓位整体呈现先上升再下降的趋势。具体而言，组合在季度初适当加仓，按照合理定价积极参与了一二级市场具备相对价值债券的投资机会，尤其是中短端具备一定票息价值的品种。进入 5 月，组合逐步卖出部分性价比下降、利差已压缩至低位的信用债，适度降低了信用债仓位。此外，本基金继续规避资质偏弱、久期偏长的债券，保持组合的流动性。可转债策略方面，本基金在 4 月初预期部分可转债的正股面临业绩披露的压力，逢高减仓了 1 季度加仓的转债，并且保留偏债类转债；5 月份，组合进一步降低转债仓位；6 月份，转债市场开始面临流动性压力，组合通过持仓偏债银行类转债来抵御市场的下行，整体效果较好。

2024 年 2 季度，海外股市延续走强，纳斯达克指数上涨 8.26%，标普 500 指数上涨 3.92%，指数的上涨主要是少数几家大型科技股的贡献。A 股市场整体表现仍弱于海外市场，呈现震荡分化的特征。从风格来看，价值风格跑赢，代表大盘价值风格的上证 50 指数下跌 0.83%，代表成长风格的创业板指数下跌 7.41%。从行业板块来看，表现较好的行业主要是公用事业、煤炭、银行板块。

股票操作方面，本基金本报告期内仓位总体保持在中性偏高的水平，操作主要以结构调整为主，降低了化工、医药和建材行业的仓位，提高了电力设备、计算机和有色行业的仓位。具体而言，金融股方面，组合低配了股价走势与宏观基本面背离的银行股，继续耐心持有估值偏低的龙头券商股。消费股方面，减仓了部分食品行业个股，继续持有高端白酒标的以及估值在低位的细分市场龙头白酒股。周期股方面，逢高止盈了煤炭股与建材股，减仓了港股市场的地产和汽车股。高端制造方面，增仓了几只在细分领域有竞争力的电力设备个股，减仓部分军工个股。医药股方面，买入了估值在低位的医疗器械个股，继续持有麻醉药领域有吸引力的个股。TMT 方面，增仓了港股市场股息率较高的通信服务行业个股，继续持有面板行业龙头股。公用事业方面，继续持有水电行业个股和港股市场的高股息燃气股。目前组合形成了以估值相对较低且具备稳定成长性的消费、医药、公用事业为主，科技、高端制造、周期成长为辅的均衡持仓结构。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬景阳一年混合 A 的基金份额净值为 1.0099 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.74%；截至本报告期末鹏扬景阳一年混合 C 的基金份额净值为 0.9988 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.63%；同期业绩比较基准收益率为 1.65%。

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 | 101,230,917.29 | 16.60 |
| | 其中：股票 | 101,230,917.29 | 16.60 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 470,060,077.60 | 77.08 |
| | 其中：债券 | 449,881,448.56 | 73.78 |
| | 资产支持证券 | 20,178,629.04 | 3.31 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | 205,800.00 | 0.03 |
| 6 | 买入返售金融资产 | 11,004,520.55 | 1.80 |
| | 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 | 19,747,796.11 | 3.24 |
| 8 | 其他资产 | 7,549,014.60 | 1.24 |
| 9 | 合计 | 609,798,126.15 | 100.00 |

注：（1）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 12,040,293.61 元，占期末基金资产净值的比例为 2.02%。

（2）金融衍生品投资为信用风险缓释凭证。

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 | 64,379,911.48 | 10.83 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,110,140.00 | 0.86 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,506,075.00 | 0.25 |
| H | 住宿和餐饮业 | 1,449,890.00 | 0.24 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 8,186,894.00 | 1.38 |
| J | 金融业 | 8,557,512.00 | 1.44 |
| 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 | 201.20 | 0.00 |
| 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 | 89,190,623.68 | 15.00 |

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 | 1,073,311.68 | 0.18 |
| B 消费者非必需品 | 1,410,638.21 | 0.24 |
| C 消费者常用品 | - | - |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | - | - |
| F 医疗保健 | - | - |
| G 工业 | 629,420.64 | 0.11 |
| H 信息技术 | - | - |
| I 电信服务 | 5,346,479.44 | 0.90 |
| J 公用事业 | 1,108,906.20 | 0.19 |
| K 房地产 | 2,471,537.44 | 0.42 |
| 合计 | 12,040,293.61 | 2.02 |

注：以上行业分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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 | 002507 | 涪陵榨菜 | 458,600 | 5,617,850.00 | 0.94 |
| 2 | 002063 | 远光软件 | 1,060,600 | 5,557,544.00 | 0.93 |
| 3 | 00788 | 中国铁塔 | 5,800,000 | 5,346,479.44 | 0.90 |
| 4 | 600116 | 三峡水利 | 740,600 | 5,110,140.00 | 0.86 |
| 5 | 600298 | 安琪酵母 | 160,000 | 4,468,800.00 | 0.75 |
| 6 | 600030 | 中信证券 | 235,400 | 4,291,342.00 | 0.72 |
| 7 | 300693 | 盛弘股份 | 202,700 | 4,244,538.00 | 0.71 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 8 | 000333 | 美的集团 | 60,200 | 3,882,900.00 | 0.65 |
| 9 | 002415 | 海康威视 | 121,100 | 3,743,201.00 | 0.63 |
| 10 | 002939 | 长城证券 | 455,100 | 3,049,170.00 | 0.51 |

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 | 34,211,197.81 | 5.75 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 41,904,448.09 | 7.05 |
| | 其中：政策性金融债 | 41,904,448.09 | 7.05 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 84,431,845.35 | 14.20 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 62,324,487.75 | 10.48 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 地方政府债 | 227,009,469.56 | 38.18 |
| 10 | 其他 | - | - |
| 11 | 合计 | 449,881,448.56 | 75.65 |

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 | 231369 | 23 贵州 28 | 350,000 | 36,657,638.36 | 6.16 |
| 1 | 2371306 | 23 贵州债 28 | 190,000 | 19,915,519.67 | 3.35 |
| 2 | 110059 | 浦发转债 | 442,600 | 48,807,878.70 | 8.21 |
| 3 | 198408 | 23 河南债 59 | 230,000 | 24,077,719.67 | 4.05 |
| 3 | 231436 | 23 河南 59 | 180,000 | 18,842,972.05 | 3.17 |
| 4 | 092303005 | 23 口行二级资本债 02A | 400,000 | 41,904,448.09 | 7.05 |
| 5 | 198898 | 23 湘 139 | 400,000 | 41,832,526.03 | 7.03 |

注：对于同时在交易所和银行间上市的债券，合并计算公允价值参与排序，并按照不同市场分别披露投资明细。

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 261821 | 先锋 5B01 | 200,000 | 20,178,629.04 | 3.39 |

注：本基金本报告期末仅持有上述资产支持证券。

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

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

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险指标说明 |
|-------------------|--------|----------|----------------|-------------|-------------|
| TL2409 | TL2409 | -60 | -65,760,000.00 | -915,000.00 | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | -915,000.00 |
| 国债期货投资本期收益(元) | | | | | -198.00 |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | -915,000.00 |

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的发行主体中，中铁信托有限责任公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局四川监管局的处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没

有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。

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 | 2,339,192.35 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,937,399.51 |
| 3 | 应收股利 | 272,422.74 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 7,549,014.60 |

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 | 110059 | 浦发转债 | 48,807,878.70 | 8.21 |
| 2 | 132026 | G 三峡 EB2 | 1,424,022.33 | 0.24 |
| 3 | 110081 | 闻泰转债 | 1,227,876.84 | 0.21 |
| 4 | 110079 | 杭银转债 | 1,166,611.47 | 0.20 |
| 5 | 110073 | 国投转债 | 1,147,340.52 | 0.19 |
| 6 | 111010 | 立昂转债 | 931,849.47 | 0.16 |
| 7 | 128134 | 鸿路转债 | 747,496.81 | 0.13 |
| 8 | 127049 | 希望转 2 | 707,957.62 | 0.12 |
| 9 | 113616 | 韦尔转债 | 696,062.96 | 0.12 |
| 10 | 128135 | 洽洽转债 | 652,769.14 | 0.11 |
| 11 | 110062 | 烽火转债 | 652,138.53 | 0.11 |
| 12 | 127015 | 希望转债 | 584,929.07 | 0.10 |
| 13 | 113049 | 长汽转债 | 554,561.84 | 0.09 |
| 14 | 127083 | 山路转债 | 547,867.56 | 0.09 |
| 15 | 128142 | 新乳转债 | 528,225.37 | 0.09 |
| 16 | 113046 | 金田转债 | 510,247.07 | 0.09 |
| 17 | 113638 | 台 21 转债 | 466,308.08 | 0.08 |
| 18 | 113067 | 燃 23 转债 | 465,891.33 | 0.08 |
| 19 | 127085 | 韵达转债 | 307,181.83 | 0.05 |
| 20 | 128109 | 楚江转债 | 197,271.21 | 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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 | 鹏扬景阳一年混合 A | 鹏扬景阳一年混合 C |
|-------------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 646,542,172.14 | 50,336,153.85 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 142,438.37 | 9,905.01 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 103,346,449.07 | 4,343,897.28 |
| 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 | 543,338,161.44 | 46,002,161.58 |

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

单位：份

| 项目 | 鹏扬景阳一年混合 A | 鹏扬景阳一年混合 C |
|-------------------------------|--------------|------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 4,932,899.15 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 4,932,899.15 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额 占基金总份额比例 (%) | 0.84 | - |

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阳一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬景阳一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬景阳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。

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

2024 年 7 月 18 日