

鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告 摘要

2018 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：2018 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示

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。本半年度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 2018 年 8 月 23 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 2018 年 4 月 3 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏扬景升混合	
基金主代码	005642	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 3 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	557,995,528.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	鹏扬景升混合 A	鹏扬景升混合 C
下属分级基金的交易代码:	005642	005643
报告期末下属分级基金的份额总额	519,128,639.97 份	38,866,888.95 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，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	<p>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。</p> <p>1、当宏观基本面向好、GDP 稳步增长且预期股票市场趋于上涨时，本基金将增加股票投资比例，分享股票市场上涨带来的收益；</p> <p>2、当宏观基本面一般、GDP 增长缓慢且预期股票市场趋于下跌时，本基金将采取相对稳健的做法，减少股票投资比例，增加债券或现金类资产比例，避免投资组合的损失；</p> <p>3、在预期股票市场和债券市场都存在下跌风险时，本基金将减少股票和债券的持有比例，除现金资产外，增加债券回购、央行票据等现金类资产的比例。</p> <p>基于基金管理人对于经济周期及资产价格发展变化的深刻理解，通过定性和定量的方法分析宏观经济、资本市场、政策导向等各方面因素，建立基金管理人对于各大类资产收益的绝对或相对预期，决定各大类资产配置权重。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*70%+恒生指数收益率 *10%+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	吉瑞	郭明
	联系电话	010-68105888	(010) 66105798
	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) 66105799

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.pyamc.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§ 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

基金级别	鹏扬景升混合 A	鹏扬景升混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 4 月 3 日-2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 4 月 3 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,144,987.35	156,582.88
本期利润	-23,100,045.49	-1,844,532.43
加权平均基金份额本期利润	-0.0434	-0.0443
本期基金份额净值增长率	-4.37%	-4.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0437	-0.0457
期末基金资产净值	496,423,155.11	37,090,603.15
期末基金份额净值	0.9563	0.9543

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、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、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。

4、本基金于 2018 年 4 月 3 日成立，截止到本报告期末未满半年，主要财务指标的实际计算期间

为 2018 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日。

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

鹏扬景升混合 A

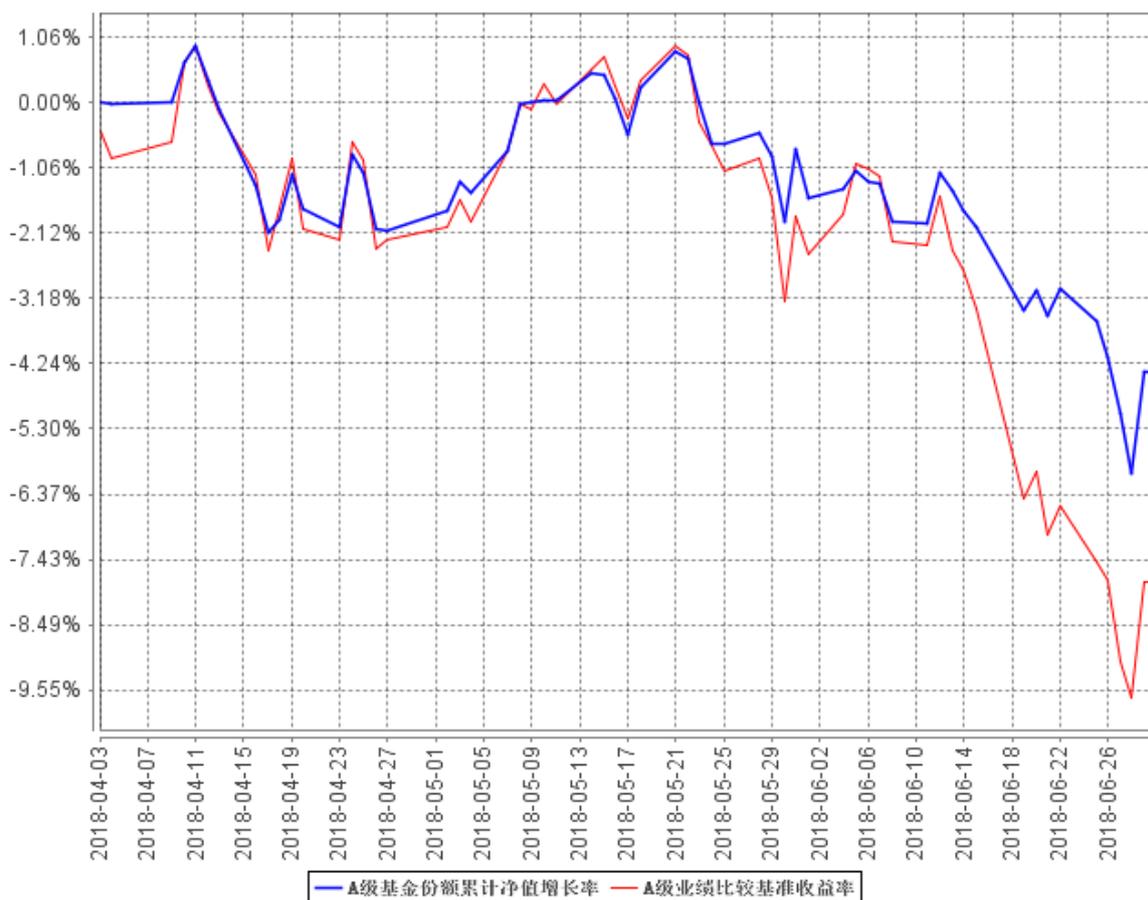
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.66%	0.70%	-6.06%	1.07%	2.40%	-0.37%
自基金合同生效起至今	-4.37%	0.63%	-7.78%	0.90%	3.41%	-0.27%

鹏扬景升混合 C

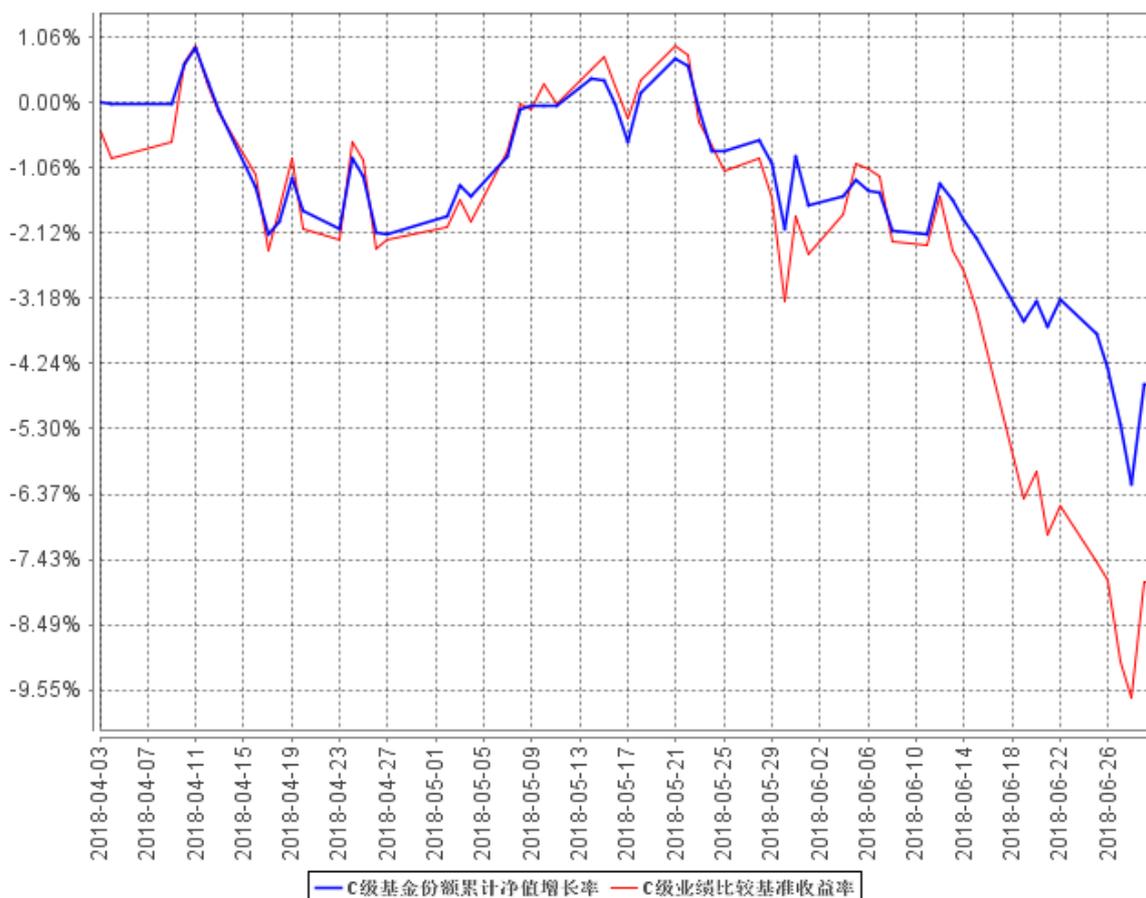
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.74%	0.70%	-6.06%	1.07%	2.32%	-0.37%
自基金合同生效起至今	-4.57%	0.63%	-7.78%	0.90%	3.21%	-0.27%

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



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 2018 年 6 月 30 日。

（2）本基金合同于 2018 年 4 月 3 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。

§ 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

本基金管理人为鹏扬基金管理有限公司，经中国证监会证监许可【2016】1453 号文批准，成立于 2016 年 7 月 6 日，是我国第一家由阳光私募基金管理人股东发起设立的公募基金管理公司，该阳光私募基金管理人北京鹏扬投资管理有限公司（以下简称“鹏扬投资”）曾是国内最大的固定收益类私募基金管理人之一。公司注册资本 10518 万元人民币，杨爱斌持股 52.291%，上海华石投资有限公司、宏实资本管理有限公司的持股比例分别为 42.784%和 4.925%。公司注册地在上海，主要办公地在北京，已在北京、上海、深圳成立分公司。公司的经营宗旨为：纪律为本，

稳健增值。公司长远目标是成为在中国资本市场上有影响力的、能持续为客户创造价值的专业化资产管理公司。公司于 2017 年荣获中国证券报中国基金业“2016 年度金牛特别贡献奖”。

截至 2018 年 6 月 30 日，公司公募基金规模达 124.62 亿元，非货币公募基金规模 74.55 亿元。公司旗下有鹏扬汇利债券型证券投资基金、鹏扬利泽债券型证券投资基金、鹏扬现金通利货币市场基金、鹏扬景兴混合型证券投资基金、鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金、鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金、鹏扬双利债券型证券投资基金、鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金、鹏扬景欣混合型证券投资基金、鹏扬淳合债券型证券投资基金共 10 只开放式基金。

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		
王华	固定收益总监、本基金基金经理	2018 年 4 月 3 日	-	8	清华大学理学学士，CFA、FRM，曾任银河期货研究员、银河期货自营子公司固定收益部总经理，北京鹏扬投资管理有限公司衍生品策略部总经理，现任鹏扬基金管理有限公司固定收益总监、固定收益投资决策委员会主任委员。2018 年 2 月 13 日至今任鹏扬双利债券型证券投资基金基金经理，2018 年 4 月 3 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，2018 年 5 月 10 日至今任鹏扬景欣混合型证券投资基金基金经理，2018 年 6 月 21 日至今任鹏扬淳合债券型证券投资基金基金经理。。
卢安平	副总经理兼首席投资官、本基金基金经理	2018 年 4 月 3 日	-	17	清华大学工商管理硕士，西安交通大学工学学士，曾任全国社保基金理事会资产配置处长、风险管理处处长，中国平安集团公司委托与绩效评估部总经理，平安人寿保险股份有限公司委托投资部总经理。现任鹏扬基金管理有限公司副总经理、股票投资决策委员会主任委员，2017 年 9 月 27 日至今任鹏扬景兴混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 月

					20 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，2018 年 4 月 3 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，2018 年 5 月 10 日至今任鹏扬景欣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 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

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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《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 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

2018 年上半年，按照控制金融风险的总思路，强监管、去杠杆政策强力实施，导致 5 月起社

融增速大幅下滑，资管新规细则颁布前很多理财和金融活动停摆，股市和低等级信用债较大幅度下跌。中美贸易问题影响了股市情绪和信心，成了风险资产市场下跌的引线和助推器，推动了避险资产的上涨。

本基金 2018 年 4 月 3 日成立时，在估值和基本面两个方面，我们认为股债基本平衡，宜采用股票和固收各一半的基本配置。基金成立以后，股票仓位迅速加到了 50%，债券方面先期做了短期银行存单，然后买入 3 年期左右的高等级信用债和利率债，建立了 30%仓位的国开债及高等级信用债，因较为看好利率债，也建立了 5%的国债期货 T1809 合约多头仓位，获取久期上的一定风险暴露。6 月份，随着股票市场的大幅下跌，增加了 10 个百分点的股票仓位。

行业方面，按照 GICS 行业划分标准，6 月末基金持有的第一重仓行业是金融业，并比沪深 300 指数的金融业基准权重高出 3 个百分点；第二重仓行业是工业，比沪深 300 的基准权重高出 7 个百分点；第三重仓行业是信息科技，比沪深 300 的基准权重高出 5 个百分点；第四重仓行业是可选消费，与沪深 300 基准持平；而日常消费品行业本基金的配置比例为零，低于沪深 300 基准 10 个百分点，是主要的低配行业。按照申万行业划分标准，6 月末基金持有的前几大行业依次为银行、非银金融、电子、医药生物；与沪深 300 基准比较，高配的行业依次是电器设备、电子、银行，低配的主要是食品饮料。需要说明的是，这些行业配置比例的形成，主要是自下而上选股自然形成的，我们希望行业配置比较均衡和分散，但必须要有基本面优质且估值合理的个股存在才能实现。

个股方面，本基金持有 20-30 只股票，除强周期个股，如焦煤、电解铝、化工行业的个股，有一定的波段性买卖，其它绝大多数个股采用的买入持有策略。除非估值太高、或者基本面发生重大变化、或者发现更好的投资机会，不进行个股的短期买卖操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬景升混合 A 基金份额净值为 0.9563 元，本报告期基金份额净值增长率为 -4.37%；截至本报告期末鹏扬景升混合 C 基金份额净值为 0.9543 元，本报告期基金份额净值增长率为 -4.57%；同期业绩比较基准收益率为 -7.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，下半年宏观政策会进行调整，中国经济会在底线思维基础上运行。更重要的是，中国经济的潜在增长水平还在 6%左右，宏观经济政策必然会回到支持潜在经济增长水平的方向上来，流动性的紧与宽、老经济与新经济、基建和房地产的种种争论都会回到潜在经济增长的方向

上来。我们对中国经济基本面的中长期前景充满信心。

证券市场方面，中国证券市场一直以来存在长期资金不足、或者长钱短投的问题，市场上真正的长期基本面投资者比较少。打破刚兑，更多净值型产品出现，以及海外资金的大幅流入，有利于明显改善市场的资金结构，市场效率会进一步提高，长期基本面投资者的市场环境会变得更友好。

行业方面，基金将继续在“不变”与“变”两个方面的行业保持相对均衡。传统的比较稳定的“不变”行业，主要是金融、必选消费等行业，本基金已有较大比重的金融股持仓，将在估值合理的条件下增加必选消费持仓；“变”的行业，主要是科技相关行业，包括 ICT、生物医药、新能源等行业，这些行业变化快，波动大，基金将增加分散度，降低集中度风险。固收部分，计划保持目前久期水平，若市场利率下行较多，考虑降低固收仓位和久期。

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后，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、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，本基金托管人在对鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，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，鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金的管理人——鹏扬基金管理有限公司在鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度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鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、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：鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	32,425,034.27
结算备付金		7,521,713.93

存出保证金		285,179.30
交易性金融资产	6.4.7.2	475,797,757.45
其中：股票投资		316,010,757.45
基金投资		-
债券投资		159,787,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	17,000,000.00
应收证券清算款		2,013,430.13
应收利息	6.4.7.5	1,889,901.77
应收股利		-
应收申购款		7,462.95
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		536,940,479.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30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		-
应付证券清算款		3.95
应付赎回款		2,330,181.67
应付管理人报酬		682,697.72
应付托管费		113,782.95
应付销售服务费		25,703.04
应付交易费用	6.4.7.7	215,341.77
应交税费		15,411.65
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	43,598.79
负债合计		3,426,721.54
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	557,995,528.92
未分配利润	6.4.7.10	-24,481,770.66
所有者权益合计		533,513,758.26
负债和所有者权益总计		536,940,479.80

注：1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，鹏扬景升混合 A 基金份额净值 0.9563 元，基金份额总额 519,128,639.97 份；鹏扬景升混合 C 基金份额净值 0.9543 元，基金份额总额 38,866,888.95 份。

鹏扬景升混合份额总额合计为 557,995,528.92 份。

2、本期财务报表的实际编制期间系 2018 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日止。

6.2 利润表

会计主体：鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 4 月 3 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 4 月 3 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		-22,112,390.23
1.利息收入		2,052,394.68
其中：存款利息收入	6.4.7.11	602,338.58
债券利息收入		1,134,189.69
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		315,866.41
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,018,084.88
其中：股票投资收益	6.4.7.12	967,093.28
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13.1	-10,000.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	3,060,991.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-28,246,148.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	63,278.36
减：二、费用		2,832,187.69
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	2,051,257.33
2. 托管费	6.4.9.2.2	341,876.21
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	79,384.20
4. 交易费用	6.4.7.19	312,562.55
5. 利息支出		1,524.93
其中：卖出回购金融资产支出		1,524.93
6. 税金及附加		2,875.32
7. 其他费用	6.4.7.20	42,707.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-24,944,577.92
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-24,944,577.92

注：本期财务报表的实际编制期间系 2018 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日止。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 4 月 3 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 4 月 3 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	577,972,865.24	-	577,972,865.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-24,944,577.92	-24,944,577.92
三、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）	-19,977,336.32	462,807.26	-19,514,529.06
其中：1.基金申购款	1,030,182.98	-15,954.37	1,014,228.61
2.基金赎回款	-21,007,519.30	478,761.63	-20,528,757.67
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	557,995,528.92	-24,481,770.66	533,513,758.26

注：本期财务报表的实际编制期间系 2018 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日止。

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

基金管理人负责人

李操纲

主管会计工作负责人

韩欢

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏扬景升灵活配置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[2017]2250 号《关于准予鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的注册，由鹏扬基金管理有限公司于 2018 年 2 月 6 日至 2018 年 3 月 30

日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明（2018）验字第 61290365_A04 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2018 年 4 月 3 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时鹏扬景升混合 A 类份额已收到首次募集的有效净认购金额为人民币 535,303,727.86 元，折合 535,303,727.86 份鹏扬景升混合 A 类份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 136,884.10 元，折合 136,884.10 份鹏扬景升混合 A 类份额；以上收到的实收基金共计人民币 535,440,611.96 元，折合 535,440,611.96 份鹏扬景升混合 A 类份额。鹏扬景升混合 C 类份额已收到的有效净认购金额为人民币 42,513,831.97 元，折合 42,513,831.97 份鹏扬景升混合 C 类份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 18,421.31 元，折合 18,421.31 份鹏扬景升混合 C 类份额；以上收到的实收基金共计人民币 42,532,253.28 元，折合 42,532,253.28 份鹏扬景升混合 C 类份额。鹏扬景升混合 A 类份额和 C 类份额收到的实收基金合计人民币 577,972,865.24 元，分别折合成 A 类及 C 类基金份额，合计折合 577,972,865.24 份鹏扬景升混合基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均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。

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为 A 类和 C 类份额。在投资人认购、申购时收取认购、申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资人认购、申购时不收取认购、申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。A 类、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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、中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的规定范围内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、公开发行的次级债券、政府支持债券、可转债、可交换债、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货等）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券、债券质押式及买断式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。本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，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、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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。本基金的业绩

比较基准为：中证 800 指数收益率 *70%+ 恒生指数收益率 *10%+中债综合财富（总值）指数收益率*20%

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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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于 2018 年 06 月 30 日的财务状况以及 2018 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2018 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权

益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同

资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于股指期货合约平仓和到期交割日确认，并按平仓和到期交割日成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的同一类别的每份基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额收取费用情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资人选择红利再投资方式进行收益分配，收益的计算以权益登记日当日收市后计算的各类基金份额净值为基准转为相应类别的基金份额进行再投资；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致后，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

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增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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 7%、3%和 2%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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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》、财税[2017]78 号文《关于继续执行沪港股票市场交易互联互通机制有关个人所得税政策的通知》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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	32,425,034.27
定期存款	-
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	-
合计：	32,425,034.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	343,057,924.54	316,010,757.45	-27,047,167.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	39,869,936.00	38,446,000.00
	银行间市场	121,138,045.06	121,341,000.00
	合计	161,007,981.06	159,787,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	504,065,905.60	475,797,757.45	-28,268,148.15

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	9,574,500.00	-	-	注
合计	-	-	-	

注：在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本基金于 2018 年 6 月 30 日所有的国债期货合约产生的持仓损益金额，因此衍生金融工具项下的国债期货投资按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细为：10 年期国债期货 1809 合约买入持仓量 10 手，合约市值人民币 9,596,500.00 元，公允价值变动人民币余额 22,000.00 元。

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 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	17,000,000.00	-
银行间市场	-	-

合计	17,000,000.00	-
----	---------------	---

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,279.49
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,011.00
应收债券利息	1,883,625.20
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-4,476.71
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	462.79
合计	1,889,901.77

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	214,441.77
银行间市场应付交易费用	900.00
合计	215,341.77

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
----	------------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,847.47
预提费用	40,751.32
合计	43,598.79

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鹏扬景升混合 A		
项目	本期 2018 年 4 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	535,440,611.96	535,440,611.96
本期申购	970,600.99	970,600.99
本期赎回(以“-”号填列)	-17,282,572.98	-17,282,572.98
本期末	519,128,639.97	519,128,639.97

鹏扬景升混合 C		
项目	本期 2018 年 4 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	42,532,253.28	42,532,253.28
本期申购	59,581.99	59,581.99
本期赎回(以“-”号填列)	-3,724,946.32	-3,724,946.32
本期末	38,866,888.95	38,866,888.95

注：(1) 如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

(2) 本基金于 2018 年 2 月 6 日至 2018 年 3 月 30 日向社会公开募集。基金合同于 2018 年 4 月 3 日生效。本基金设立时，基金份额总额 577,972,865.24 份，其中鹏扬景升混合 A 类基金份额 535,440,611.96 份，鹏扬景升混合 C 类基金份额 42,532,253.28 份。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鹏扬景升混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,144,987.35	-26,245,032.84	-23,100,045.49
本期基金份额交易产生的变动数	-59,849.75	454,410.38	394,560.63

其中：基金申购款	2,423.91	-16,298.29	-13,874.38
基金赎回款	-62,273.66	470,708.67	408,435.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,085,137.60	-25,790,622.46	-22,705,484.86

鹏扬景升混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	156,582.88	-2,001,115.31	-1,844,532.43
本期基金份额交易产生的变动数	-4,701.14	72,947.77	68,246.63
其中：基金申购款	182.67	-2,262.66	-2,079.99
基金赎回款	-4,883.81	75,210.43	70,326.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	151,881.74	-1,928,167.54	-1,776,285.80

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 4 月 3 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	130,803.17
定期存款利息收入	449,791.67
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	21,503.02
其他	240.72
合计	602,338.58

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 4 月 3 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	40,028,893.45
减：卖出股票成本总额	39,061,800.17
买卖股票差价收入	967,093.28

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年4月3日(基金合同生效日)至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	51,660,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	50,010,000.00
减：应收利息总额	1,660,000.00
买卖债券差价收入	-10,000.00

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年4月3日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,060,991.60
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,060,991.60

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年4月3日至2018年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	-28,268,148.15
——股票投资	-27,047,167.09
——债券投资	-1,220,981.06
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	22,000.00
——权证投资	-
——国债期货投资	22,000.00
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	-28,246,148.15

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年4月3日至2018年6月30日
基金赎回费收入	63,278.36
合计	63,278.36

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年4月3日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	311,331.06
银行间市场交易费用	900.00
证券组合费用-沪港通	297.49
国债期货交易费用	34.00
合计	312,562.55

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年4月3日至2018年6月30日
审计费用	17,930.83
信息披露费	22,820.49

银行费用	1,555.83
证券账户开户费	400.00
合计	42,707.15

6.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
杨爱斌	基金管理人股东
上海华石投资有限公司（“华石投资”）	基金管理人股东
宏实资本管理有限公司（“宏实资本”）	基金管理人股东
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（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于 2018 年 4 月 3 日成立，因此无上年度可比期间。

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年4月3日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,051,257.33
其中：支付销售机构的客户维护费	1,325,772.21

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年4月3日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	341,876.21

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

6.4.9.2.3 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		
	2018年4月3日(基金合同生效日)至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏扬景升混合A	鹏扬景升混合C	合计
工商银行	-	15,124.07	15,124.07
合计	-	15,124.07	15,124.07

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，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。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

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.9.4.2 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

注：无。

6.4.9.5 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 2018 年 4 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	32,425,034.27	130,803.17

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.10 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 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

6.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
603693	江苏新能	2018 年 6 月 25 日	2018 年 7 月 3 日	新股未上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.11.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 325,418,727.30 元，属于第二层次的余额为人民币 150,379,030.15 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.11.2 承诺事项

无。

6.4.11.3 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	316,010,757.45	58.85
	其中：股票	316,010,757.45	58.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	159,787,000.00	29.76
	其中：债券	159,787,000.00	29.76

	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	17,000,000.00	3.17
	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	39,946,748.20	7.44
8	其他各项资产	4,195,974.15	0.78
9	合计	536,940,479.80	100.00

7.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	13,023,760.00	2.44
C	制造业	153,751,319.90	28.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	104,873,257.15	19.66
K	房地产业	13,530,000.00	2.54
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,617,348.55	2.36
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	297,867,245.45	55.83
----	----------------	-------

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	9,122,342.00	1.71
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	9,021,170.00	1.69
K 房地产	-	-
合计	18,143,512.00	3.40

7.3 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

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	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	450,000	26,361,000.00	4.94
2	601288	农业银行	5,500,000	18,920,000.00	3.55
3	600036	招商银行	699,600	18,497,424.00	3.47
4	002595	豪迈科技	949,941	16,519,473.99	3.10
5	000333	美的集团	299,946	15,663,180.12	2.94
6	601998	中信银行	2,456,500	15,254,865.00	2.86
7	600196	复星医药	350,000	14,486,500.00	2.72
8	000002	万科 A	550,000	13,530,000.00	2.54
9	601939	建设银行	2,000,000	13,100,000.00	2.46
10	600741	华域汽车	549,978	13,045,478.16	2.45

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	29,583,296.26	5.54
2	601288	农业银行	21,360,000.00	4.00
3	600036	招商银行	20,438,953.17	3.83
4	600583	海油工程	18,237,685.00	3.42
5	000002	万科 A	16,804,508.07	3.15
6	300070	碧水源	15,788,429.35	2.96
7	000333	美的集团	15,756,843.40	2.95
8	601998	中信银行	15,553,645.00	2.92
9	002595	豪迈科技	15,278,071.26	2.86
10	600612	老凤祥	15,162,804.40	2.84
11	600196	复星医药	15,013,623.00	2.81
12	601939	建设银行	14,723,000.00	2.76
13	601601	中国太保	14,121,675.63	2.65
14	601012	隆基股份	13,476,812.00	2.53
15	600741	华域汽车	12,934,168.26	2.42
16	600176	中国巨石	12,091,095.00	2.27
17	600885	宏发股份	12,087,920.98	2.27
18	600104	上汽集团	11,876,617.02	2.23
19	002050	三花智控	10,956,560.85	2.05
20	600563	法拉电子	10,260,895.66	1.92

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600104	上汽集团	12,522,439.17	2.35
2	600886	国投电力	9,974,830.00	1.87
3	000537	广宇发展	7,798,936.45	1.46
4	000028	国药一致	5,415,733.00	1.02

5	600583	海油工程	2,883,393.00	0.54
6	300750	宁德时代	716,217.80	0.13
7	601066	中信建投	211,383.90	0.04
8	603486	科沃斯	132,103.08	0.02
9	603587	地素时尚	114,004.56	0.02
10	601990	南京证券	108,131.10	0.02
11	300746	汉嘉设计	79,810.74	0.01
12	603045	福达合金	50,920.65	0.01
13	601138	工业富联	20,990.00	0.00

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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	382,119,724.71
卖出股票收入（成交）总额	40,028,893.45

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,859,000.00	5.60
	其中：政策性金融债	29,859,000.00	5.60
4	企业债券	28,950,000.00	5.43
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	91,482,000.00	17.15
7	可转债（可交换债）	9,496,000.00	1.78
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	159,787,000.00	29.95

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	101474010	14 北控集 MTN003	300,000	30,942,000.00	5.80
2	101800140	18 赣高速 MTN001	300,000	30,471,000.00	5.71
3	101800543	18 苏交通 MTN003	300,000	30,069,000.00	5.64
4	160415	16 农发 15	300,000	29,859,000.00	5.60
5	136440	16 渝开投	300,000	28,950,000.00	5.43

7.7 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。

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：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

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。

7.11.2 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
T1809	10年期国债期货1809合约	10	9,596,500.00	22,000.00	-
公允价值变动总额合计（元）					22,000.00
国债期货投资本期收益（元）					0.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）					22,000.00

注 1：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

注 2：本期国债期货投资本期收益为未扣手续费收益。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明：

招商银行（600036.SH）为鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金的前十大持仓证券。2018 年 7 月 5 日深圳保监局针对招商银行存在电话销售欺骗投保人的违法行为，罚款 30 万元。2018 年 2 月 12 日中国银监会针对招商银行存在以下违法违规事实，罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。主要违法违规事实：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本

合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。

本基金投资招商银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除招商银行外，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。

7.12.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明：

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	285,179.30
2	应收证券清算款	2,013,430.13
3	应收股利	-
4	应收利息	1,889,901.77
5	应收申购款	7,462.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,195,974.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

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。

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
鹏扬景升混合 A	5,190	100,024.79	2,526,354.97	0.49%	516,602,285.00	99.51%
鹏扬景升混合 C	726	53,535.66	0.00	0.00%	38,866,888.95	100.00%
合计	5,916	94,319.73	2,526,354.97	0.45%	555,469,173.95	99.55%

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 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	鹏扬景升混合 A	102,117.53	0.02%
	鹏扬景升混合 C	252,848.61	0.65%
	合计	354,966.14	0.06%

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.4 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

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员，基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数据区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数据区间为 0。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏扬景升混合 A	鹏扬景升混合 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 3 日）基金份额总额	535,440,611.96	42,532,253.28
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	970,600.99	59,581.99

减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	17,282,572.98	3,724,946.32
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	519,128,639.97	38,866,888.95

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§ 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:

本基金管理人于 2018 年 6 月 12 日发布《鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告》,范勇宏先生自 2018 年 6 月 8 日起担任鹏扬基金管理有限公司董事长,原董事长姜山先生于 2018 年 6 月 8 日起不再担任鹏扬基金管理有限公司董事长。本基金管理人于 2018 年 6 月 7 日发布《鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告》,卢安平先生自 2018 年 6 月 6 日起担任鹏扬基金管理有限公司副总经理。本基金管理人已按有关规定报中国基金业协会和北京证监局备案上述重大人事变动事项。

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

自本基金基金合同生效日起安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内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

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。

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	
中国国际金融股份有限公司	2	304,808,666.08	72.33%	130,883.92	61.03%	-
国信证券股份有限公司	2	70,361,303.32	16.70%	50,048.44	23.34%	-
中信建投证券股份有限公司	2	46,252,743.00	10.98%	33,509.41	15.63%	-

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。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

3、本基金于 2018 年 4 月 3 日成立，以上席位均为新增交易单元。

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
------	------	--------	------

	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
中国国际金融股份有限公司	60,810,292.98	67.66%	629,000,000.00	23.21%	-	-
国信证券股份有限公司	29,071,001.92	32.34%	1,360,500,000.00	50.21%	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	720,000,000.00	26.57%	-	-

§ 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

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

鹏扬基金管理有限公司
2018 年 8 月 27 日