

鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 21 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 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）起至 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	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.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59

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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	鹏扬核心价值混合	
基金主代码	006051	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 29 日	
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	975,439,166.98 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分类基金的基金简称:	鹏扬核心价值混合 A	鹏扬核心价值混合 C
下属分类基金的交易代码:	006051	006052
报告期末下属分类基金的份额总额	964,851,718.21 份	10,587,448.77 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以低估或合理价格买入并持有具备核心竞争力、能够持续为社会创造更大价值的企业，通过资产配置和精选个股，在控制风险的前提下，力争实现更多超额回报。
投资策略	<p>(一) 类属资产配置策略</p> <p>基于基金管理人对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> <p>1、当宏观基本面向好、通胀稳定且股票估值合理或低估时，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、当宏观基本面向弱、或通胀预期较高、或股票估值泡沫比较明显时，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。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>本基金以长期结构性价值投资为导向，自上而下选择具有高投资价值的行业、自下而上遴选优质股票，精选个股、长期持有。本基金主要根据国家宏观经济运行、产业结构调整、行业自身生命周期、对国民经济发展贡献程度以及行业技术创新等因素，分析上市公司未来的价值创造力，同时，定性和定量分析相结合，挖掘具有高投资价值的优质上市公司。</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，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特定风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吉瑞	张燕
	联系电话	010-68105888	0755-83199084
	电子邮箱	service@pyamc.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-968-6688	95555
传真		010-68105966	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 120 号 3 层 302 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 16 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100045	518040
法定代表人		杨爱斌	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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

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	北京西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 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	鹏扬核心价值混合 A	鹏扬核心价值混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月29日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月29日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-9,302,560.78	-126,119.63
本期利润	-4,738,148.22	140,011.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0074	0.0044
本期加权平均净值利润率	-0.74%	0.44%
本期基金份额净值增长率	1.15%	0.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	-9,211,384.58	-121,743.14
期末可供分配基金份额利润	-0.0095	-0.0115
期末基金资产净值	975,923,875.35	10,688,052.60
期末基金份额净值	1.0115	1.0095
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.15%	0.95%

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 2019 年 1 月 29 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 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 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

鹏扬核心价值混合 A

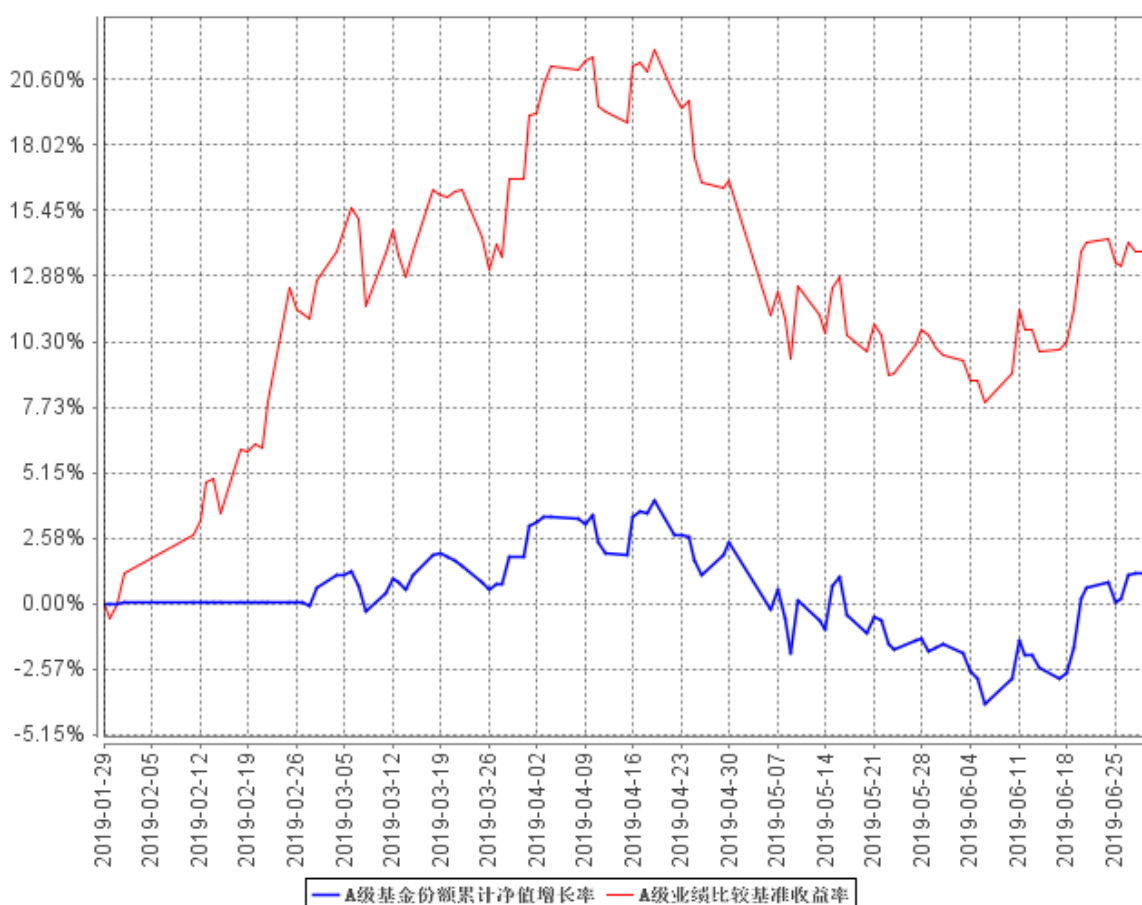
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.82%	0.80%	3.73%	0.90%	-0.91%	-0.10%
过去三个月	-0.65%	0.87%	-2.44%	1.16%	1.79%	-0.29%
自基金合同生效起至今	1.15%	0.71%	13.83%	1.22%	-12.68%	-0.51%

鹏扬核心价值混合 C

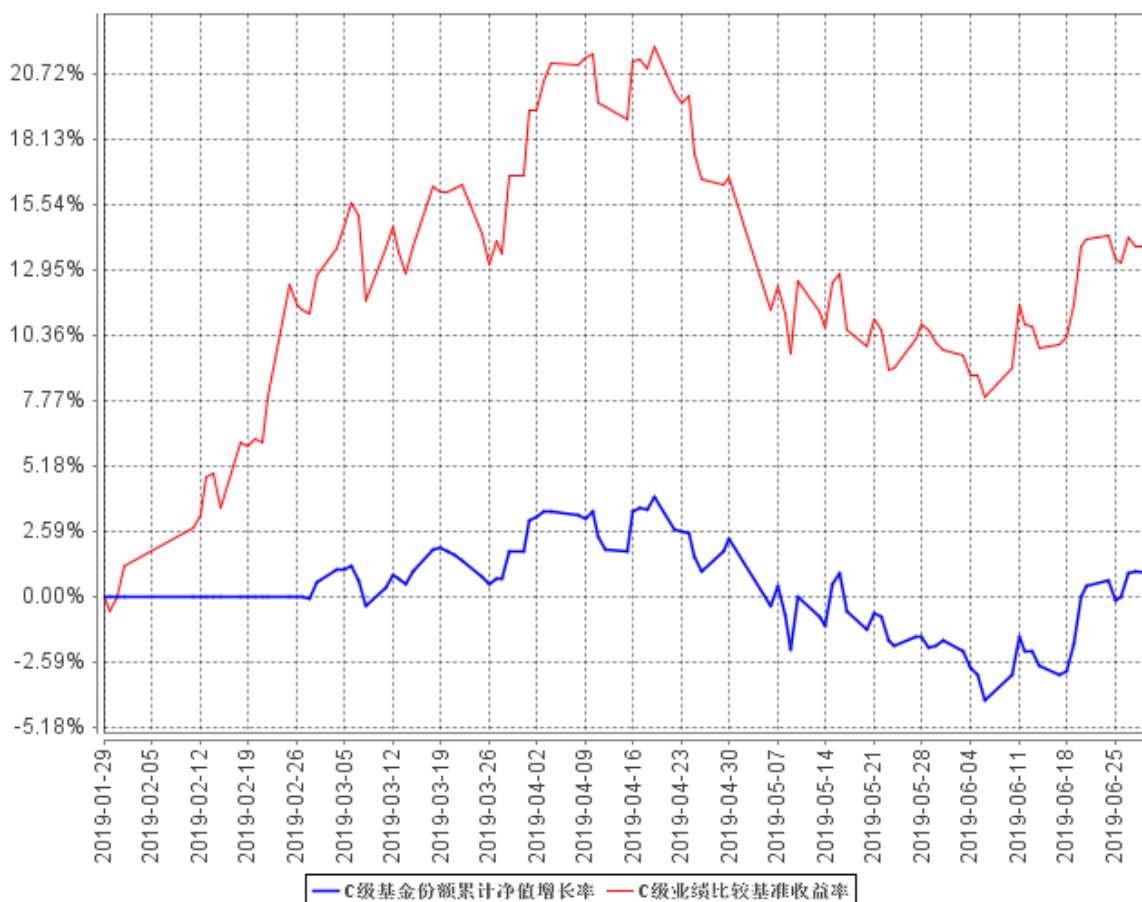
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.77%	0.80%	3.73%	0.90%	-0.96%	-0.10%
过去三个月	-0.79%	0.87%	-2.44%	1.16%	1.65%	-0.29%
自基金合同生效起至今	0.95%	0.71%	13.83%	1.22%	-12.88%	-0.51%

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 2019 年 6 月 30 日。

（2）本基金合同于 2019 年 1 月 29 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

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

3.3 其他指标

注：无

§ 4 管理人报告

4.1 基金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 11800 万元人民币，杨爱斌持股比例为 50.000%，上海华石投资有限公司持股比例为 28.156%，宏实资本管理有限公司持股比例为 7.500%，上海济通企业管理中心（有限合伙）、上海璞识企业管理中心（有限合伙）和上海润京企业管理中心（有限合伙）持股比例分别为 4.364%、4.990%和 4.990%。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”；于 2019 年荣获证券时报“2018 年度明星基金公司成长奖”、荣获朝阳永续 2018 年度“创业成就奖”、荣获新浪 2018 年度“最受信赖责任投资基金公司”。

截至 2019 年 6 月 30 日，公司公募基金规模达 306.70 亿元，非货币公募基金规模 264.89 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、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、鹏扬泓利债券型证券投资基金、鹏扬淳享债券型证券投资基金、鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金、鹏扬添利增强债券型证券投资基金、鹏扬淳盈 6 个月定期开放债券型证券投资基金共 16 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		
卢安平	副总经理兼首席投资官、本基金基金	2019 年 1 月 29 日	-	18	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

	经理			<p>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兼首席投资官。2017 年 9 月 27 日至 2019 年 1 月 4 日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；2019 年 1 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。</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场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

2019 年上半年，万得全 A 指数上涨 25%，其中沪深 300 上涨 27%，中证 500 上涨 19%，中证 1000 上涨 20%，中小板指数上涨 20%，创业板指数上涨 20%，沪深 300 指数的涨幅大幅领先于中小盘指数。由于沪深 300 指数囊括了 A 股市场上大多数最优秀的公司，且估值相对于中小盘指数有大幅折让，因此上半年沪深 300 指数的涨幅领先是合理的，显示出市场的效率在迅速提高。

股市的长期回报来自于上市公司的价值创造，没有公司的创新、创造，经济增长将无从谈起，股票这个大类资产相对于房地产、相对于债券等大类资产的超额回报也就无从谈起。而公司的价值创造来自于企业家精神，来自于公司强大的组织管理能力，来自于好的公司价值观和企业文化。企业家精神重在创新和坚韧、追求极致的产品或服务来满足客户需求、永不满足于现状。好的公司在实现员工、股东、上下游等企业生态协调发展的同时，追求为人类社会的进步发展做出贡献，这就是好企业的价值观，是凝聚人心、吸引优秀人才的基石。本基金的投资理念就是投资于这类价值创造型公司，这类公司在实现巨大的商业成功的同时，也为人类社会的进步发展做出突出贡献，比如光伏新能源企业，人工智能企业，给老百姓带来有真实疗效且安全便宜的仿制药和创新药企业，提供好的精神食粮的影视书刊文化企业、提供安全准点又便宜的航空服务企业等。

投资方法上，一个好的股票投资标的首先要有好的管理水平，管理水平第一、技术第二。没有一流管理，领先的技术就会退化；有一流管理，即使技术二流也会进步。好的股票投资标的还需要在商业模式、赛道、竞争格局、估值等各个方面都能满足要求。本基金只投资于有一流管理且满足以上条件的优秀公司，这些公司比我们投资者更理解他们的行业，这些公司在创造和发展他们的行业。

1 月底成立至 6 月底，本基金的日均股票仓位为 40%，期末股票仓位为 78%。总体上，一季度股票仓位不高，待 4 月份上证综指从 3200 左右下跌到 2900 左右以后，股票仓位作了大幅提升。本基金是灵活配置型基金，为降低组合的波动性，风险资产的配置比例随着市场波动会有大幅调整，近期调整的方法主要是逆向，市场跌下来增加股票仓位，市场涨上去则降低仓位。半年末，本基金的前十大行业（申万二级行业）分布上，非银金融占 12.62%，银行占 8.99%，医药生物占 7.99%，电气设备占 7.97%，电子占 7.26%，轻工制造占 6.11%，传媒占 5.21%，机械设备占 5.08%，采掘占 3.15%，汽车占 2.99%。基金前十大重仓股集中度约 45%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬核心价值混合 A 基金份额净值为 1.0115 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.15%;截至本报告期末鹏扬核心价值混合 C 基金份额净值为 1.0095 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.95%;同期业绩比较基准收益率为 13.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年全球经济增长从 2018 年周期分化转为同步放缓。经济合作与发展组织 (OECD) 公布 5 月份综合领先指标显示全球经济已经连续 9 个月下行且处于 100 点以下,主要经济体除中国在 2019 年 3 月企稳出现回升外,美国、日本、欧元区均面临持续下行压力。我们认为全球央行货币重回宽松能延缓经济的下行压力,但在全球债务杠杆较高和全球贫富差距持续扩大导致的民粹主义兴起、全球贸易保护主义抬头的大背景下,全球政治经济格局将进入一个前所未有的新阶段,全球经济很可能进入一个较低的增长阶段,同时全球货币金融体系的分化将给全球资本市场带来巨大的不确定性。

我们认为,2019 年下半年中国经济将面临下行的压力,实际 GDP 增长将下降到 6%-6.2%的水平,名义 GDP 增长将下降到 7.5%-8%的水平。增长回落的主要驱动力是在上半年偏高的房地产投资在下半年房地产政策不捆绑甚至进一步加强的背景下,棚户区改造计划和货币化安置大幅减少导致房地产销量持续回落,而开发商土地高库存、高新开工、高施工、低竣工的格局不可持续。三季度受上半年宽松的货币政策和积极的财政政策刺激,经济仍有一定韧性,但展望四季度,受包商事件引发的流动性分层和信用收缩效应对总需求压制、中美贸易冲突长期化打击出口增长和 FDI 等不利因素影响,经济增长预计将略微低于市场预期。

通货膨胀方面,短期来看,CPI 可能受到猪肉等食品价格上涨影响而继续有所抬升,但核心 CPI 继续保持低位;PPI 总体趋势下降,下半年工业品通缩趋势将更为明显。中期来看,制造业投资下降导致名义工资短期对债券市场形成一定影响,科技创新力度加大导致商品和服务价格下降,金融防风险、金融供给侧结构性改革导致金融部门低质量扩张的终结,因此我们认为未来 1-2 年通货紧缩风险大于通货膨胀风险。

流动性方面,在 1 季度超预期的信贷和社融数据公布后,央行货币政策转为松紧适度,基础货币连续 2 月下降;5 月份,受中美贸易战 2.0 和包商接管引发同业流动性收缩风险的影响,央行连续大幅投放流动性。若 3 季度美联储如市场预期降息,中国央行降低公开市场操作利率也将是大概率事件。展望三季度信贷和社会融资总量,除地方政府债券可能继续高速增加外,企业部

门融资环境略有收缩，这在一定程度上意味着私人非金融部门流动性重新面临收缩局面。

股票市场方面，虽然经济增速有下行压力，但宏观经济的增速和股票市场尤其是主动型股票基金的回报相关性不大。宏观经济增速降低是长期趋势，但现阶段 5% 以上的实际增速及 7% 以上的名义增速仍然是很快的增速，而且各行各业的增速大不一样，大部分行业的集中度都在快速提升。事实上，优秀公司在创造经济增速，优秀公司的集合在拉动宏观经济增速上升。技术上，沪深 300 指数的估值目前仍然严重低估，在流动性充裕，房地产和债券的期望回报已经比较低的背景下，沪深 300 指数未来三年的年均期望回报我们认为在 15% 以上。

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

本基金于 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 06 月 30 日止未进行利润分配。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	31,776,973.47
结算备付金		36,086,701.67
存出保证金		281,400.28
交易性金融资产	6.4.7.2	865,027,937.48
其中：股票投资		774,097,530.53
基金投资		-
债券投资		90,930,406.95
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	70,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	1,517,995.43
应收股利		-
应收申购款		234,828.97
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,004,925,837.30
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 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		14,112,812.97
应付赎回款		2,099,471.91
应付管理人报酬		1,201,152.27
应付托管费		200,192.04
应付销售服务费		3,271.23
应付交易费用	6.4.7.7	630,810.51
应交税费		3.00

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	66,195.42
负债合计		18,313,909.35
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	975,439,166.98
未分配利润	6.4.7.10	11,172,760.97
所有者权益合计		986,611,927.95
负债和所有者权益总计		1,004,925,837.30

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，鹏扬核心价值混合 A 基金份额净值 1.0115 元，基金份额总额 964,851,718.21 份；鹏扬核心价值混合 C 基金份额净值 1.0095 元，基金份额总额 10,587,448.77 份。鹏扬核心价值混合份额总额合计为 975,439,166.98 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效 日)至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		1,560,061.08
1.利息收入		3,660,396.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	504,313.13
债券利息收入		1,179,259.53
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,976,823.34
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,439,195.08
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-15,517,561.72
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-104,415.70
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-104,400.00
股利收益	6.4.7.16	8,287,182.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,830,543.49
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	508,316.67
减：二、费用		6,158,198.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,229,004.56

2. 托管费	6.4.10.2.2	704,834.12
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	59,267.62
4. 交易费用	6.4.7.19	1,087,398.09
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.80
7. 其他费用	6.4.7.20	77,692.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,598,136.92
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,598,136.92

注：本期财务报表的实际编制期间系 2019 年 01 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 06 月 30 日止。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 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）	369,305,775.85	-	369,305,775.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,598,136.92	-4,598,136.92
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）	606,133,391.13	15,770,897.89	621,904,289.02
其中：1.基金申购款	872,501,611.21	17,043,005.46	889,544,616.67
2.基金赎回款	-266,368,220.08	-1,272,107.57	-267,640,327.65
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）	975,439,166.98	11,172,760.97	986,611,927.95

注：本期财务报表的实际编制期间系 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 06 月 30 日

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：

<u>杨爱斌</u>	<u>刘燕</u>	<u>韩欢</u>
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

鹏扬核心价值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[2018]370号《关于准予鹏扬核心价值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12月26日至2019年1月25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（2019）验字第61290365_A01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2019年1月29日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时鹏扬核心价值A类份额已收到首次募集的有效净认购金额为人民币232,761,006.05元，折合232,761,006.05份鹏扬核心价值A类份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币72,170.05元，折合72,170.05份鹏扬核心价值A类份额；以上收到的实收基金共计人民币232,833,176.10元，折合232,833,176.10份鹏扬核心价值A类份额。鹏扬核心价值C类份额已收到的有效净认购金额为人民币136,393,617.32元，折合136,393,617.32份鹏扬核心价值C类份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币78,982.43元，折合78,982.43份鹏扬核心价值C类份额；以上收到的实收基金共计人民币136,472,599.75元，折合136,472,599.75份鹏扬核心价值C类份额。鹏扬核心价值A类份额和C类份额收到的实收基金合计人民币369,305,775.85元，分别折合成A类及C类基金份额，合计折合369,305,775.85份鹏扬核心价值基金份额。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，基金托管人为招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，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，而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、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 2019 年 06 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 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 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 06 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股票、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或现金股利，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有利市场进行。主要市场（或有利市场）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，应采用近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或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，按能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家新规定估值。

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;

(2) 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。

(3) 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;

(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,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。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

注:无。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

注: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

注:无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

注:无。

6.4.5.3 差错更正的说明

注: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 年后一个交易日的股票收盘价（2017 年后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前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》、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 2019年6月30日
活期存款	31,776,973.47
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：	31,776,973.47

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	769,229,883.99	774,097,530.53	4,867,646.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	18,405,950.00	18,417,406.95
	银行间市场	72,561,560.00	72,513,000.00
	合计	90,967,510.00	90,930,406.95
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	860,197,393.99	865,027,937.48	4,830,543.49

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	70,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	70,000,000.00	-

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 2019年6月30日
应收活期存款利息	4,172.10
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	16,855.04
应收债券利息	1,496,841.69
应收资产支持证券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	126.60
合计	1,517,995.43

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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	630,260.51
银行间市场应付交易费用	550.00
合计	630,810.51

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,634.63
预提费用	63,560.79
合计	66,195.42

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鹏扬核心价值混合 A		
项目	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	232,833,176.10	232,833,176.10
本期申购	862,808,154.81	862,808,154.81
本期赎回(以“-”号填列)	-130,789,612.70	-130,789,612.70
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-

本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	964,851,718.21	964,851,718.21

金额单位：人民币元

鹏扬核心价值混合 C		
项目	本期 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	136,472,599.75	136,472,599.75
本期申购	9,693,456.40	9,693,456.40
本期赎回(以“-”号填列)	-135,578,607.38	-135,578,607.38
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	10,587,448.77	10,587,448.77

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 12 月 26 日至 2019 年 1 月 25 日向社会公开募集。基金合同于 2019 年 1 月 29 日生效。本基金设立时，基金份额总额 369,305,775.85 份，其中鹏扬核心价值 A 类基金份额 232,833,176.10 份，鹏扬核心价值 C 类基金份额 136,472,599.75 份。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鹏扬核心价值混合 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	-9,302,560.78	4,564,412.56	-4,738,148.22
本期基金份额交易产生的变动数	91,176.20	15,719,129.16	15,810,305.36
其中：基金申购款	-325,479.61	17,226,651.28	16,901,171.67
基金赎回款	416,655.81	-1,507,522.12	-1,090,866.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,211,384.58	20,283,541.72	11,072,157.14

单位：人民币元

鹏扬核心价值混合 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	-126,119.63	266,130.93	140,011.30
本期基金份额交易产生的变动数	4,376.49	-43,783.96	-39,407.47
其中：基金申购款	-26,788.65	168,622.44	141,833.79
基金赎回款	31,165.14	-212,406.40	-181,241.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-121,743.14	222,346.97	100,603.83

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日
活期存款利息收入	179,455.59
定期存款利息收入	197,400.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	126,777.35
其他	680.19
合计	504,313.13

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 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日
卖出股票成交总额	193,570,853.50
减：卖出股票成本总额	209,088,415.22
买卖股票差价收入	-15,517,561.72

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日
----	--------------------------------------

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-104,415.70
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	-104,415.70

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	31,134,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	30,104,415.70
减：应收利息总额	1,134,000.00
买卖债券差价收入	-104,415.70

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
国债期货投资收益	-104,400.00
股指期货-投资收益	-

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,287,182.34
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,287,182.34

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,830,543.49
——股票投资	4,867,646.54
——债券投资	-37,103.05
——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	4,830,543.49

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	502,976.32
基金转换费收入	5,340.35
合计	508,316.67

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,086,470.14
银行间市场交易费用	775.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
期货交易市场交易费用	152.95
合计	1,087,398.09

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	22,700.61
信息披露费	40,860.18
账户维护费	1,500.00
银行费用	12,232.02
开户费	400.00
合计	77,692.81

6.4.7.21 分部报告

注：无。

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

注：无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

注：截至财务报表日，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

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	基金管理人股东
宏实资本管理有限公司	基金管理人股东
上海济通企业管理中心（有限合伙）	基金管理人股东
上海璞识企业管理中心（有限合伙）	基金管理人股东
上海润京企业管理中心（有限合伙）	基金管理人股东
鹏扬基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人

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

本基金于 2019 年 1 月 29 日成立，因此无上年度可比期间。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：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
	2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,229,004.56
其中：支付销售机构的客户维护费	2,721,917.82

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：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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
	2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	704,834.12

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%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏扬核心价值混合 A	鹏扬核心价值混合 C	合计
鹏扬基金管理有限公司	-	346.99	346.99
招商银行股份有限公司	-	8,586.40	8,586.40
合计	-	8,933.39	8,933.39

注：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 类基金份额的年销售服务费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

本基金 C 类基金份额的销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

注：无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	31,776,973.47	179,455.59

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2019 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	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
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：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收的合规风险、操作风险等风险进行管理。从风险监控层面，公司督察长、风险管理人员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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不超过该证券的 10%。

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 2019 年 6 月 30 日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	59,104,936.71
合计	59,104,936.71

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）未评级债券包含期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的地方政府债、短期融资券。

（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

注：（1）本基金本报告期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

注：（1）本基金本报告期末未持有同业存单。

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 2019 年 6 月 30 日
AAA	0.00
AAA 以下	499,755.77
未评级	32,822,556.16
合计	33,322,311.93

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）未评级债券为期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的地方政府债。

（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

注：（1）本基金本报告期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

注：（1）本基金本报告期末未持有同业存单。

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

注：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

本基金根据资产的流动性特征，对资产类别做出以下划分：

- 1、现金及短期逆回购，主要包括现金资产中的活期存款以及五个交易日内到期的逆回购。
- 2、短期可变现资产，包括但不限于结算备付金、交易保证金、5 个交易日内可到账的申购款和证券清算款、国债、政策性金融债、中央银行票据、主体评级不低于 AAA 的短融及超短融。
- 3、五个交易日可变现资产，包括现金及短期逆回购、短期可变现资产及五个交易日可变现股票资产。其中，五个交易日可变现股票资产是指变现天数小于等于五个交易日的股票市值，以及变现天数大于五个交易日的股票在五个交易日内可变现的市值。
- 4、流动性风险资产，包括但不限于信用债、五个交易日内无法变现的股票资产等，变现该类资产将承担额外的流动性冲击。
- 5、流动性受限资产，是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流动性受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等。

本基金于本报告期末的现金及短期逆回购占基金资产净值的比例为 10.32%，短期可变现资产占基金资产净值的比例为 13.03%，五个交易日可变现资产占基金资产净值的比例为 90.67%，流动

性风险资产占基金资产净值的比例为 11.18%，流动受限资产占基金资产净值的比例为 0.01%。

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 2019 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	31,776,973.47	-	-	-	-	-	31,776,973.47
结算备付金	36,086,701.67	-	-	-	-	-	36,086,701.67
存出保证金	281,400.28	-	-	-	-	-	281,400.28
交易性金融资产	-	-58,177,900.00	-	-32,752,506.95	774,097,530.53	-	865,027,937.48
买入返售金融资产	70,000,000.00	-	-	-	-	-	70,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,517,995.43	1,517,995.43
应收申购款	-	-	-	-	-	234,828.97	234,828.97
资产总计	138,145,075.42	-58,177,900.00	-	-32,752,506.95	775,850,354.93	-	1,004,925,837.30
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	14,112,812.97	14,112,812.97
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,099,471.91	2,099,471.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,201,152.27	1,201,152.27
应付托管费	-	-	-	-	-	200,192.04	200,192.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,271.23	3,271.23
应付交易费用	-	-	-	-	-	630,810.51	630,810.51
应交税费	-	-	-	-	-	3.00	3.00
其他负债	-	-	-	-	-	66,195.42	66,195.42
负债总计	-	-	-	-	-	18,313,909.35	18,313,909.35
利率敏感度缺口	138,145,075.42	-58,177,900.00	-	-32,752,506.95	757,536,445.58	-	986,611,927.95

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早

者进行分类。

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（2019 年 6 月 30 日）
	市场利率上升 25 个基点	-627,395.18
	市场利率下降 25 个基点	639,755.51

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 2019 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	-	5,332,894.77	-	5,332,894.77
资产合计	-	5,332,894.77	-	5,332,894.77
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	-	5,332,894.77	-	5,332,894.77

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，仅外汇汇率发生合理、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。	
	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（2019年6月30日）
	港币相对人民币升值 5%	266,644.74
	港币相对人民币贬值 5%	-266,644.74

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 2019年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	774,097,530.53	78.46
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	90,930,406.95	9.22
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	865,027,937.48	87.68

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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。	
	假定业绩比较基准变动 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（2019 年 6 月 30 日）
	业绩比较基准上升 5%	36,159,095.12
	业绩比较基准下降 5%	-36,159,095.12

注：（1）股票投资业绩基准取沪深 300 指数。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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 774,540,060.94 元，属于第二层次的余额为人民币 90,487,876.54 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末未发生变动。

6.4.14.2 承诺事项

无。

6.4.14.3 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	774,097,530.53	77.03
	其中：股票	774,097,530.53	77.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	90,930,406.95	9.05
	其中：债券	90,930,406.95	9.05
	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	70,000,000.00	6.97
	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	67,863,675.14	6.75
8	其他各项资产	2,034,224.68	0.20
9	合计	1,004,925,837.30	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 5,332,894.77 元，占期末基金资产净值的比例为 0.54%。

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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	10,758,000.00	1.09
B	采矿业	49,576,516.41	5.02
C	制造业	346,268,254.49	35.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	65,049,847.89	6.59
G	交通运输、仓储和邮政业	17,998,020.00	1.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,159,612.70	0.62
J	金融业	213,197,124.12	21.61
K	房地产业	8,342,026.65	0.85
L	租赁和商务服务业	17,457,000.00	1.77

M	科学研究和技术服务业	-	-
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	33,958,233.50	3.44
S	综合	-	-
	合计	768,764,635.76	77.92

注：以上行业分类以 2019 年 6 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

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	5,332,894.77	0.54
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	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	5,332,894.77	0.54

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	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,089,851	96,571,697.11	9.79
2	601166	兴业银行	4,849,183	88,691,557.07	8.99
3	601012	隆基股份	2,904,825	67,130,505.75	6.80
4	002595	豪迈科技	2,382,449	50,055,253.49	5.07
5	002841	视源股份	539,800	41,839,898.00	4.24
6	600566	济川药业	1,150,000	34,626,500.00	3.51
7	002867	周大生	976,429	33,384,107.51	3.38
8	601225	陕西煤业	3,321,059	30,686,585.16	3.11
9	002475	立讯精密	1,199,911	29,745,793.69	3.01
10	600660	福耀玻璃	1,299,866	29,545,954.18	2.99
11	601688	华泰证券	1,250,000	27,900,000.00	2.83

12	600612	老凤祥	599,850	26,813,295.00	2.72
13	002677	浙江美大	1,999,715	26,316,249.40	2.67
14	603939	益丰药房	309,962	21,694,240.38	2.20
15	300251	光线传媒	3,100,000	21,080,000.00	2.14
16	600547	山东黄金	450,000	18,526,500.00	1.88
17	601021	春秋航空	399,956	17,998,020.00	1.82
18	002027	分众传媒	3,300,000	17,457,000.00	1.77
19	002372	伟星新材	919,822	16,004,902.80	1.62
20	603096	新经典	239,745	12,855,126.90	1.30
21	300009	安科生物	789,811	12,557,994.90	1.27
22	300124	汇川技术	500,000	11,455,000.00	1.16
23	300498	温氏股份	300,000	10,758,000.00	1.09
24	002727	一心堂	350,000	9,971,500.00	1.01
25	000002	万科 A	299,965	8,342,026.65	0.85
26	300454	深信服	69,911	6,120,008.94	0.62
27	02020	安踏体育	113,000	5,332,894.77	0.54
28	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.04
29	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
30	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
31	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
32	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
33	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
34	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
35	300788	中信出版	1,556	23,106.60	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	155,142,015.68	15.72
2	601166	兴业银行	92,217,196.15	9.35
3	601012	隆基股份	65,642,763.69	6.65
4	601939	建设银行	54,170,546.46	5.49
5	002595	豪迈科技	49,708,941.99	5.04
6	600566	济川药业	41,186,256.94	4.17
7	002841	视源股份	41,110,537.00	4.17

8	002867	周大生	35,961,126.30	3.64
9	601225	陕西煤业	30,453,755.12	3.09
10	600660	福耀玻璃	29,120,381.01	2.95
11	002027	分众传媒	28,531,499.40	2.89
12	002677	浙江美大	28,250,596.45	2.86
13	601688	华泰证券	28,054,916.87	2.84
14	002475	立讯精密	26,008,778.75	2.64
15	600612	老凤祥	26,000,031.96	2.64
16	000002	万科 A	22,971,215.56	2.33
17	300251	光线传媒	21,596,051.00	2.19
18	603939	益丰药房	18,482,652.54	1.87
19	601021	春秋航空	18,110,938.40	1.84
20	300009	安科生物	18,048,023.29	1.83

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	601318	中国平安	66,677,128.10	6.76
2	601939	建设银行	51,827,281.00	5.25
3	000002	万科 A	12,062,294.69	1.22
4	002050	三花智控	11,386,520.98	1.15
5	603816	顾家家居	10,217,687.27	1.04
6	01336	新华保险	9,933,955.22	1.01
7	601601	中国太保	6,566,733.00	0.67
8	300009	安科生物	5,624,401.72	0.57
9	002027	分众传媒	5,486,387.00	0.56
10	600741	华域汽车	4,253,881.00	0.43
11	002867	周大生	3,155,766.84	0.32
12	300408	三环集团	2,977,737.35	0.30
13	300498	温氏股份	1,900,515.52	0.19
14	600989	宝丰能源	406,258.08	0.04
15	300770	新媒股份	92,871.97	0.01
16	300773	拉卡拉	87,500.00	0.01
17	002955	鸿合科技	75,798.28	0.01
18	300771	智莱科技	75,377.36	0.01

19	603267	鸿远电子	74,113.39	0.01
20	603068	博通集成	71,656.51	0.01

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	978,318,299.21
卖出股票收入（成交）总额	193,570,853.50

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	90,430,900.00	9.17
	其中：政策性金融债	90,430,900.00	9.17
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）	499,506.95	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	90,930,406.95	9.22

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	150203	15 国开 03	400,000	40,260,000.00	4.08
2	180205	18 国开 05	300,000	32,253,000.00	3.27
3	108901	农发 1801	179,000	17,917,900.00	1.82
4	128067	一心转债	3,715	417,008.75	0.04
5	128059	视源转债	718	82,498.20	0.01

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

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投资。

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

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
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-104,400.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-208,750.00

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 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

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	281,400.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,517,995.43
5	应收申购款	234,828.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,034,224.68

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情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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

份额类别	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
鹏扬核心价值混合 A	4,662	206,960.90	19,998,887.67	2.07%	944,852,830.54	97.93%
鹏扬核心价值混合 C	117	90,491.02	0.00	0.00%	10,587,448.77	100.00%
合计	4,779	204,109.47	19,998,887.67	2.05%	955,440,279.31	97.95%

注：对下属分类基金比例的分母采用各自类别的份额，对合计数比例的分母采用下属分类份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额类别	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	鹏扬核心价值混合 A	903.47	0.0001%
	鹏扬核心价值混合 C	0.00	0.0000%
	合计	903.47	0.0001%

注：对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类份额的合计数（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	鹏扬核心价值混合 A	鹏扬核心价值混合 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 29 日） 基金份额总额	232,833,176.10	136,472,599.75
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	862,808,154.81	9,693,456.40
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	130,789,612.70	135,578,607.38
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）	-	-
本报告期末基金份额总额	964,851,718.21	10,587,448.77

注：如有相应情况，总申购份额含红利再投、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 2019 年 3 月 27 日发布《鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告》，李操纲先生自 2019 年 3 月 25 日起不再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	
华泰证券	2	646,155,886.94	55.25%	457,503.57	60.21%	-
天风证券	2	390,378,222.27	33.38%	205,398.07	27.03%	-
中信建投证券	2	133,070,546.88	11.38%	96,905.11	12.75%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	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。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

3、本基金本报告期交易单元均为 2019 年 1 月 29 日成立时新签约席位。

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
华泰证券	48,067,065.70	100.00%	7,708,000,000.00	47.26%	-	-
天风证券	-	-	6,324,500,000.00	38.78%	-	-
中信建投证券	-	-	2,277,000,000.00	13.96%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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	鹏扬基金管理有限公司旗下鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金关于增加基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、公司官网	2019 年 1 月 4 日
2	鹏扬基金管理有限公司关于旗下鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金增加基金合作销售机构的公告	中国证券报、公司官网	2019 年 1 月 12 日
3	鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	证监会网站、中国证券报、公司官网	2019 年 1 月 30 日
4	鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资的业务公告	证监会网站、中国证券报、公司官网	2019 年 2 月 25 日
5	鹏扬基金管理有限公司关于公司注册资本及股权变更的公告	中国证券报、公司网站	2019 年 2 月 26 日
6	鹏扬基金管理有限公司关于增加基	中国证券报、公司官网	2019 年 3 月 4 日

	金销售机构并参加费率优惠活动的公告		
7	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	中国证券报、公司官网	2019 年 3 月 19 日
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	中国证券报、公司官网	2019 年 3 月 21 日
9	鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告	证监会网站、中国证券报、公司网站	2019 年 3 月 27 日
10	鹏扬基金管理有限公司旗下部分基金在中国中投证券有限责任公司开展费率优惠活动的公告	中国证券报、公司官网	2019 年 3 月 28 日
11	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	中国证券报、公司官网	2019 年 3 月 29 日
12	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	中国证券报、公司官网	2019 年 4 月 3 日
13	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金销售机构的公告	中国证券报、公司官网	2019 年 4 月 3 日
14	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构的公告	中国证券报、公司官网	2019 年 4 月 17 日
15	鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证监会网站、中国证券报、公司官网	2019 年 4 月 18 日
16	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	中国证券报、公司官网	2019 年 5 月 20 日
17	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	中国证券报、公司官网	2019 年 5 月 22 日
18	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证券报、公司官网	2019 年 6 月 20 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

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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
5. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

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

2019年8月23日