

# 鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	46

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	47
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	50
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	52
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
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>53</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	54
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>54</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>54</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	54
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4	基金投资策略的改变	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	55
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8	其他重大事件	56
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>57</b>
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	57
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	57
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>57</b>
12.1	备查文件目录	57
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金	
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	261,894,084.09 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	216,081,508.36 份	45,812,575.73 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	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。
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	宋震
	联系电话	010-68105888
	电子邮箱	service@pyamc.com
客户服务电话	400-968-6688	95588
传真	010-68105966	010-66105798
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区栖霞路 120 号 3 层 302 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	100045	100140
法定代表人	杨爱斌	陈四清

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏扬基金管理有限公司	北京市西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 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（2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日）	报告期（2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	103,984,373.51	17,301,820.43
本期利润	108,892,005.00	17,504,454.15
加权平均基金份额本期利润	0.4771	0.4242
本期加权平均净值利润率	18.75%	17.08%
本期基金份额净值增长率	20.60%	20.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2021 年 6 月 30 日）	
期末可供分配利润	260,165,640.38	52,414,716.30
期末可供分配基金份额利润	1.2040	1.1441
期末基金资产净值	622,385,422.71	128,618,037.28
期末基金份额净值	2.8803	2.8075
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2021 年 6 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	188.03%	180.75%

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。

### 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

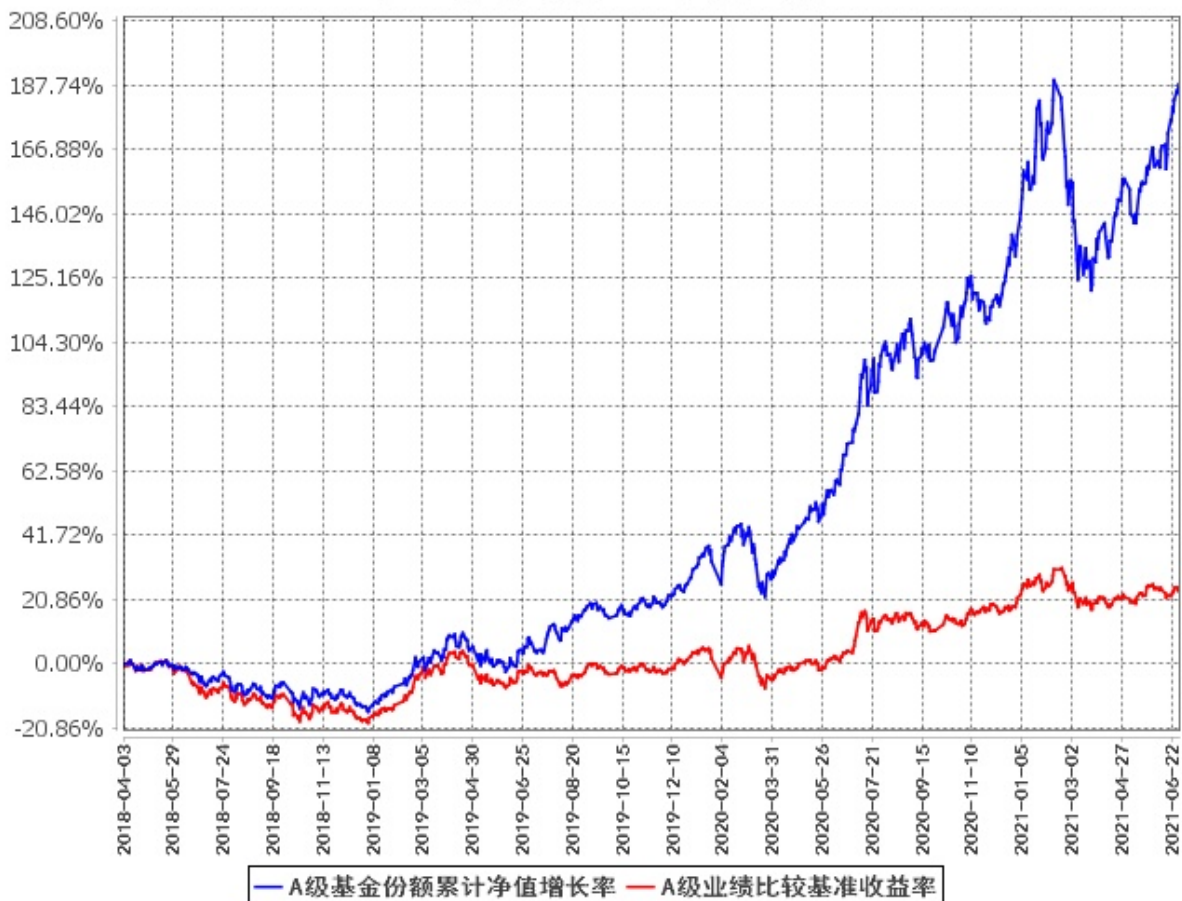
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.01%	1.27%	-0.97%	0.58%	8.98%	0.69%
过去三个月	22.85%	1.33%	3.72%	0.67%	19.13%	0.66%
过去六个月	20.60%	1.88%	2.40%	0.93%	18.20%	0.95%
过去一年	63.82%	1.76%	18.75%	0.97%	45.07%	0.79%
过去三年	201.19%	1.47%	34.61%	1.04%	166.58%	0.43%
自基金合同生效起至今	188.03%	1.43%	24.13%	1.03%	163.90%	0.40%

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	7.94%	1.27%	-0.97%	0.58%	8.91%	0.69%
过去三个月	22.60%	1.33%	3.72%	0.67%	18.88%	0.66%
过去六个月	20.12%	1.88%	2.40%	0.93%	17.72%	0.95%
过去一年	62.54%	1.76%	18.75%	0.97%	43.79%	0.79%
过去三年	194.19%	1.47%	34.61%	1.04%	159.58%	0.43%
自基金合同生效起至今	180.75%	1.43%	24.13%	1.03%	156.62%	0.40%

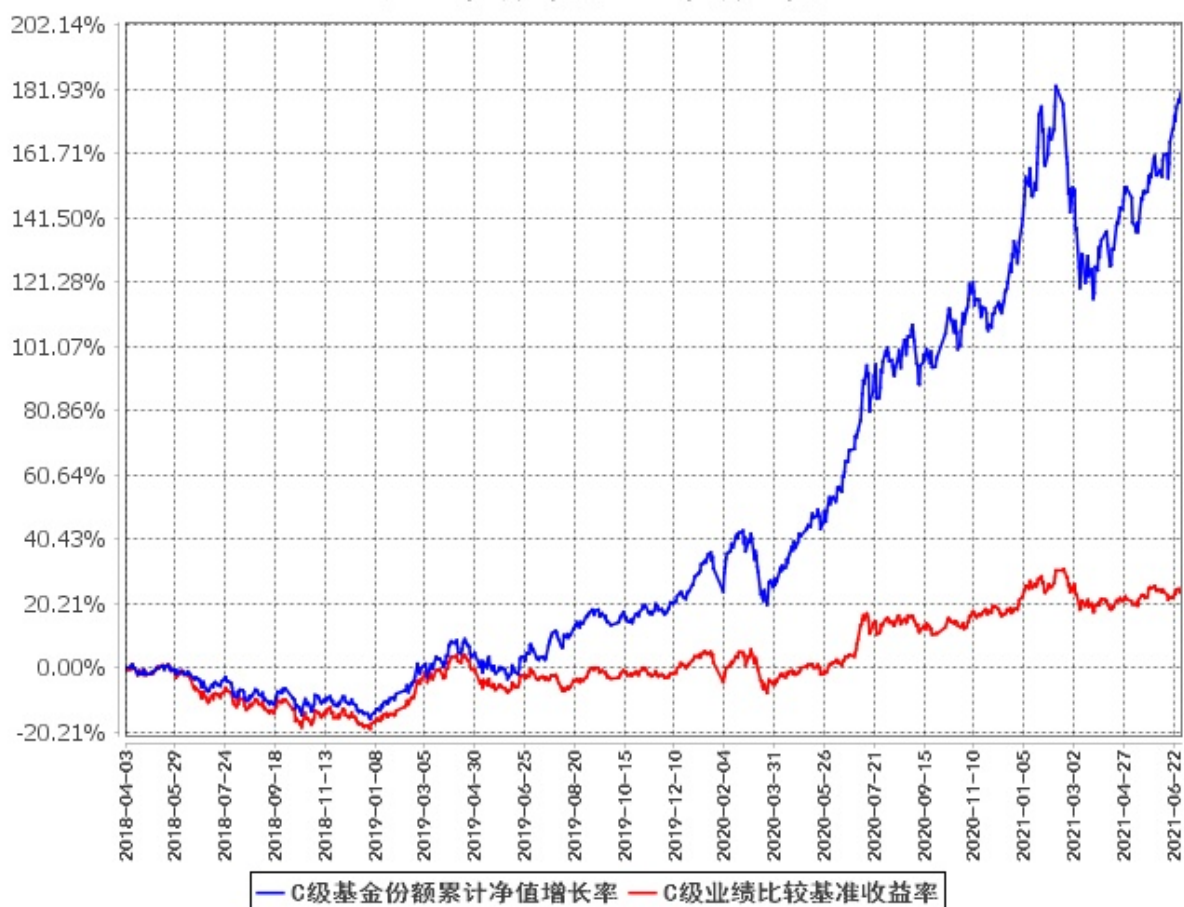
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**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**  
(2018年4月3日至2021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  
(2018年4月3日至2021年6月30日)**



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏扬基金管理有限公司(以下简称“鹏扬基金”)成立于2016年7月6日,是经中国证监会批准成立的基金管理公司,注册地在上海,主要办公地在北京,在北京、上海、深圳设有分公司。

鹏扬基金的愿景是“成为资本市场上有影响力的、持续为客户创造价值的资产管理公司”。公司以“为客户创造价值,为美好生活助力”为使命,以“专业稳健,回报信任”为经营宗旨,秉持“客户至上、勇于担当、拥抱变化、合作共赢”的价值观,沿着“固定收益+”的发展规划路径并以此为特色,协同发展主动债券、主动股票、多资产、主动量化、指数增强五大核心策略。

鹏扬基金建立了行业领先的投研体系,不断强化投研能力,汇聚海内外优秀人才,核心投资人员均具有10年以上优秀头部金融机构工作经历,为客户提供“全天候”的资产管理解决方案。同时,鹏扬基金注重风险管理,从文化上树立全员风险防范意识;从制度上实现风险管理在投前、投中、

投后的全流程覆盖；从能力建设上持续提升宏观研究、信用研究、衍生品对冲的三大避险能力；从结果上检验风险管理成效，杜绝风险事件的发生。

凭借优秀的投资业绩和完善的全流程服务，鹏扬基金规模增长迅速。截至 2021 年 6 月 30 日，公司整体管理资产规模超过 1300 亿元，旗下公募基金数量增长到 45 只，非货币公募基金规模达 763 亿元，成立 1 年以上公募基金均实现了正收益。公司以追求绝对收益为突破点的“固收+”公募基金规模位居行业前列；根据海通证券研究所金融产品研究中心基金业绩评价报告，截至 2021 年 6 月 30 日，股票投资业务取得了投资业绩最近三年排名行业第 2 的优异成绩；指数投资业务在今年市场环境下也初露头角，实现了业绩和规模的快速提升。

#### 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		
赵世宏	本基金 基金经 理,股 票投 资部 总经 理	2019 年 1 月 4 日	-	9	北京大学金融学硕士，曾任中银基金管理有限公司行业研究员，易方达基金管理有限公司研究员、基金经理助理，大成基金管理有限公司基金经理。现任鹏扬基金管理有限公司股票投资部总经理。2019 年 1 月 4 日至今任鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019 年 5 月 22 日至今任鹏扬景欣混合型证券投资基金基金经理；2020 年 2 月 19 日至今任鹏扬景瑞三年定期开放混合型证券投资基金基金经理；2020 年 3 月 20 日至今任鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2020 年 4 月 10 日至今任鹏扬景科混合型证券投资基金基金经理。

注：1. 此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招

募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，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

回顾2021年上半年，年初各国经济出现从新冠疫情中复苏迹象，货币政策调整的预期逐渐上升，包括中国在内的全球主要市场均经历了一轮显著回调。在中国，大部分优质龙头公司估值出现大幅调整及分化。进入2季度，国内外流动性总体宽裕，特别是海外流动性收紧预期逐渐缓解，经济复苏强劲。市场总体呈现普涨，特别是细分行业的龙头公司，估值显著修复。

操作方面，本基金在1季度股票总仓位调整力度不够及时，部分获利较大的持仓减持力度不够，导致净值随市场回调较多。后来在判断大部分优质个股估值进入合适的配置区间后，我们适时调整了配置，将仓位集中在质地最优、确定性最强的标的上，同时增配了部分估值偏低的中小市值公司。此外，本基金进一步提高了股票持仓的分散度，特别是加大了对优质成长龙头公司的配置力度，我们还成功挖掘了部分市场关注度较低的隐形冠军公司，取得了较好的收益，组合净值反弹力度较大。在2季度末，本基金止盈了部分涨幅较大、估值有一定泡沫的持仓标的，以及部分景气度转弱的周期成长类公司。

#### 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 的基金份额净值为 2.8803 元,本报告期基金份额净值增长率为 20.60%;截至本报告期末鹏扬景升混合 C 的基金份额净值为 2.8075 元,本报告期基金份额净值增长率为 20.12%;同期业绩比较基准收益率为 2.40%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期来看,市场上部分板块(如新能源、半导体)股票上涨较大。我们认为,当前应适度回避其中涨幅偏大、估值偏高的标的,但仍应对此类长周期景气向上的行业保持密切的学习和跟踪,抓住后续可能出现的配置时机。

中长期来看,除 3 季度国内经济景气度略有压力外,未来相当长一段时间内,内外部环境总体温和,不会对市场造成较大的负向扰动。我们也密切关注外围通胀引起的欧美货币政策调整风险,由于海外经济仍将受疫情拖累、通胀较难持续,故这方面的风险也不大。

对于标的的选择,相比处于产业成熟期晚期的低估值公司及尚处于导入期的偏炒作的标的,我们更愿意长期配置市场上的“青壮年型公司”,即长期前景广阔、公司基本面硬核、市值还不是特别大的公司,这类公司挑选难度较大,但必然成长为未来中国经济的中坚力量,具有长期阿尔法。我们的主要精力将集中在挖掘、跟踪这些公司。

权益资产操作计划:我们将坚持基本面投资,会继续有条不紊地挖掘具备坚实基本面的优秀公司,不会追随短期的市场风格变化,注重为客户获取长期回报。具体而言,我们认为一部分消费类和医药类资产逐渐具备配置价值,后续会侧重关注这类股票。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金管理人设立估值委员会(成员包括公司分管领导以及投资研究部、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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏扬基金管理有限公司编制和披露的鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	24,932,021.16	35,402,487.51
结算备付金		1,482,201.43	3,790,665.22
存出保证金		207,396.58	147,345.26
交易性金融资产	6.4.7.2	682,568,039.91	737,847,343.44
其中：股票投资		636,402,832.66	674,531,204.10
基金投资		-	-
债券投资		46,165,207.25	63,316,139.34
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	41,000,000.00	-
应收证券清算款		2,952,095.04	2,518,815.77
应收利息	6.4.7.5	762,445.78	431,098.12
应收股利		28,518.48	-
应收申购款		4,514,354.89	1,518,211.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		758,447,073.27	781,655,967.25
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	34,000,000.00
应付证券清算款		458,884.51	7,980,791.86
应付赎回款		5,366,482.37	8,983,185.00
应付管理人报酬		866,799.28	990,381.82
应付托管费		144,466.55	165,063.66
应付销售服务费		76,110.69	58,165.48
应付交易费用	6.4.7.7	439,541.40	676,293.30
应交税费		22.87	106.30
应付利息		-	8,582.90
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	91,305.61	186,530.85
负债合计		7,443,613.28	53,049,101.17
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	261,894,084.09	305,878,050.14

未分配利润	6.4.7.10	489,109,375.90	422,728,815.94
所有者权益合计		751,003,459.99	728,606,866.08
负债和所有者权益总计		758,447,073.27	781,655,967.25

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 261,894,084.09 份，其中鹏扬景升混合 A 基金份额净值 2.8803 元，基金份额总额 216,081,508.36 份；鹏扬景升混合 C 基金份额净值 2.8075 元，基金份额总额 45,812,575.73 份。

## 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		135,148,552.33	78,478,894.04
1. 利息收入		543,344.65	255,784.01
其中：存款利息收入	6.4.7.11	57,089.22	35,071.70
债券利息收入		423,985.12	218,312.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		62,270.31	2,399.46
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		128,469,833.85	38,255,274.20
其中：股票投资收益	6.4.7.12	128,932,788.07	36,958,850.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,362,269.70	264,990.20
资产支持证券投资	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	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,899,315.48	1,031,433.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,110,265.21	39,827,072.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.18	1,025,108.62	140,763.83

号填列)			
<b>减：二、费用</b>		8,752,093.18	3,135,530.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,111,977.51	1,710,246.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	851,996.25	285,041.14
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	408,307.34	63,025.57
4. 交易费用	6.4.7.19	2,015,456.88	956,068.69
5. 利息支出		254,624.68	13,610.42
其中：卖出回购金融资产支出		254,624.68	13,610.42
6. 税金及附加		48.30	2.26
7. 其他费用	6.4.7.20	109,682.22	107,535.77
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		126,396,459.15	75,343,363.73
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		126,396,459.15	75,343,363.73

### 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	305,878,050.14	422,728,815.94	728,606,866.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	126,396,459.15	126,396,459.15
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)	-43,983,966.05	-60,015,899.19	-103,999,865.24
其中：1. 基金申购款	139,618,626.42	220,184,300.83	359,802,927.25
2. 基金赎回款	-183,602,592.47	-280,200,200.02	-463,802,792.49
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)	261,894,084.09	489,109,375.90	751,003,459.99



项目	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	200,524,691.50	55,608,045.80	256,132,737.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	75,343,363.73	75,343,363.73
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)	-22,112,690.55	3,826,228.46	-18,286,462.09
其中：1. 基金申购款	74,075,767.24	37,137,471.15	111,213,238.39
2. 基金赎回款	-96,188,457.79	-33,311,242.69	-129,499,700.48
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)	178,412,000.95	134,777,637.99	313,189,638.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨爱斌	崔雁巍	韩欢
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏扬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》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,首次募集的有效净认购金额为人民币 577,817,559.83 元,有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币 155,305.41 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2018)验字第 61290365\_A04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,基金合同于 2018 年 4 月 3 日生效。首次设立募集规模为 577,972,865.24 份基金份额,其中认购资金利息折合 155,305.41 份基金份额,本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及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或注册上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许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。

#### 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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 3 号<半年度报告的内容与格式>》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》及其他中国证监会、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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

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

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

##### 6.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称“资管产品运营业务”)，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

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

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转

让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

#### 6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	24,932,021.16
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	24,932,021.16

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	480,050,141.76	636,402,832.66	156,352,690.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	45,424,305.84	46,165,207.25
	银行间市场	-	-
	合计	45,424,305.84	46,165,207.25

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	525,474,447.60	682,568,039.91	157,093,592.31

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	41,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	41,000,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	2,564.39
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	791.93
应收债券利息	759,017.56
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	-
应收出借证券利息	-
其他	71.90
合计	762,445.78

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	439,541.40
银行间市场应付交易费用	-
合计	439,541.40

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,525.16
应付证券出借违约金	-
预提费用	86,780.45
合计	91,305.61

#### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	268,051,771.10	268,051,771.10
本期申购	94,926,491.37	94,926,491.37
本期赎回(以“-”号填列)	-146,896,754.11	-146,896,754.11
本期末	216,081,508.36	216,081,508.36

金额单位：人民币元

鹏扬景升混合 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,826,279.04	37,826,279.04

本期申购	44,692,135.05	44,692,135.05
本期赎回(以“-”号填列)	-36,705,838.36	-36,705,838.36
本期末	45,812,575.73	45,812,575.73

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

#### 6.4.7.10 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
上年度末	202,622,698.80	169,526,167.29	372,148,866.09
本期利润	103,984,373.51	4,907,631.49	108,892,005.00
本期基金份额交易产生的变动数	-46,441,431.93	-28,295,524.81	-74,736,956.74
其中：基金申购款	90,749,186.84	59,659,777.87	150,408,964.71
基金赎回款	-137,190,618.77	-87,955,302.68	-225,145,921.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	260,165,640.38	146,138,273.97	406,303,914.35

单位：人民币元

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
上年度末	27,091,537.46	23,488,412.39	50,579,949.85
本期利润	17,301,820.43	202,633.72	17,504,454.15
本期基金份额交易产生的变动数	8,021,358.41	6,699,699.14	14,721,057.55
其中：基金申购款	41,841,198.53	27,934,137.59	69,775,336.12
基金赎回款	-33,819,840.12	-21,234,438.45	-55,054,278.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,414,716.30	30,390,745.25	82,805,461.55

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年6月30日
活期存款利息收入	38,306.32
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	16,662.05
其他	2,120.85
合计	57,089.22



### 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 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	779,322,933.92
减：卖出股票成本总额	650,390,145.85
买卖股票差价收入	128,932,788.07

### 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 2021 年 1 月 1 日 至 2021 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	-2,362,269.70
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	-2,362,269.70

#### 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 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	38,191,352.89
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	40,380,746.72
减：应收利息总额	172,875.87
买卖债券差价收入	-2,362,269.70

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,899,315.48
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,899,315.48

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日 至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	5,110,265.21
——股票投资	6,193,670.07
——债券投资	-1,083,404.86
——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	5,110,265.21

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年6月30日

基金赎回费收入	1,004,977.87
基金转换费收入	20,130.75
合计	1,025,108.62

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,015,456.88
银行间市场交易费用	-
合计	2,015,456.88

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行汇划费	4,301.77
合计	109,682.22

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

无。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏扬基金管理有限公司(“鹏扬基金”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构

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

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,111,977.51	1,710,246.46
其中：支付销售机构的客户维护费	1,843,313.91	882,775.28

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

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	851,996.25	285,041.14

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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
鹏扬基金	-	21,862.15	21,862.15
工商银行	-	17,178.68	17,178.68
合计	-	39,040.83	39,040.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
鹏扬基金	-	6,159.14	6,159.14
工商银行	-	2,663.41	2,663.41
合计	-	8,822.55	8,822.55

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

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

## 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日	
	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）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日	
	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）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	4,487,432.68	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	4,487,432.68	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.52%	-

注：1、基金管理人投资本基金的相关费用符合基金招募说明书及相关临时公告、交易所、登记结算机构的有关规定。

2、对于分级基金，下属分级份额的比例的分母采用基金总份额。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	24,932,021.16	38,306.32	11,521,071.78	28,117.18

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021 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
688007	光峰科技	2021年2月9日	2021年8月9日	大宗交易流通受限	18.88	39.94	212,000	4,002,560.00	8,467,280.00	
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	新股锁定期流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	
688538	和辉光电	2021年5月20日	2021年11月29日	新股锁定期流通受限	2.65	3.38	177,148	469,442.20	598,760.24	
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定期流通受限	47.33	251.96	601	28,445.33	151,427.96	
688639	华恒生物	2021年4月14日	2021年10月22日	新股锁定期流通受限	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	
688216	气派科技	2021年6月15日	2021年12月23日	新股锁定期流通受限	14.82	47.64	2,000	29,640.00	95,280.00	
688621	阳光诺和	2021年6月11日	2021年12月21日	新股锁定期流通受限	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定期流通受限	33.22	87.50	842	27,971.24	73,675.00	
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定期流通受限	48.59	90.39	541	26,287.19	48,900.99	
300973	立高食品	2021年4月	2021年10	新股锁	28.28	115.71	360	10,180.	41,655.	

	品	8 日	月 15 日	定期流 通受限				80	60	
688367	工大高 科	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 28 日	新股锁 定期流 通受限	11.53	17.94	1,717	19,797. 01	30,802. 98	-
300953	震裕科 技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股锁 定期流 通受限	28.77	99.85	240	6,904.8 0	23,964. 00	-
300941	创识科 技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁 定期流 通受限	21.31	49.94	399	8,502.6 9	19,926. 06	-
301015	百洋医 药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁 定期流 通受限	7.64	38.83	462	3,529.6 8	17,939. 46	-
300932	三友联 众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁 定期流 通受限	24.69	31.71	492	12,147. 48	15,601. 32	-
300982	苏文电 能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁 定期流 通受限	15.83	45.29	317	5,018.1 1	14,356. 93	-
300968	格林精 密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁 定期流 通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.9 4	14,025. 34	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股锁 定期流 通受限	12.76	43.38	307	3,917.3 2	13,317. 66	-
300614	百川畅 银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁 定期流 通受限	9.19	40.38	329	3,023.5 1	13,285. 02	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股锁 定期流 通受限	12.25	53.71	244	2,989.0 0	13,105. 24	-
300933	中辰股 份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁 定期流 通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.4 4	11,609. 28	-
301002	崧盛股 份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁 定期流 通受限	18.71	57.62	201	3,760.7 1	11,581. 62	-
300955	嘉亨家 化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股锁 定期流 通受限	16.53	46.07	232	3,834.9 6	10,688. 24	-
300956	英力股 份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁 定期流 通受限	12.85	25.80	371	4,767.3 5	9,571.8 0	-



300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定期流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定期流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定期流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定期流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定期流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定期流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定期流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定期流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定期流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定期流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股锁定期流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定期流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定期流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定期流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定期流	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76

				通受限						
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定期流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定期流通受限	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定期流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定期流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定期流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股锁定期流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定期流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股锁定期流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定期流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定期流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定期流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定期流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定期流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定期流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	
301021	英诺激	2021年6月	2022年1月	新股锁	9.46	9.46	290	2,743.4	2,743.4	

	光	28 日	6 日	定期流 通受限				0	0	
301018	申菱环 境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未 上市流 通受限	8.29	8.29	7,029	58,270. 41	58,270. 41	-
688239	航宇科 技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未 上市流 通受限	11.48	11.48	4,926	56,550. 48	56,550. 48	-
688087	英科再 生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未 上市流 通受限	21.96	21.96	2,469	54,219. 24	54,219. 24	-
301017	漱玉平 民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股未 上市流 通受限	8.86	8.86	4,995	44,255. 70	44,255. 70	-
301021	英诺激 光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市流 通受限	9.46	9.46	2,609	24,681. 14	24,681. 14	-
688226	威腾电 气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未 上市流 通受限	6.42	6.42	2,693	17,289. 06	17,289. 06	-
605287	德才股 份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市流 通受限	31.56	31.56	349	11,014. 44	11,014. 44	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未 上市流 通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.3 9	8,358.3 9	-
300948	冠中生 态	-	2021 年 8 月 25 日	锁定期 送/转股	-	27.42	108	-	2,961.3 6	-
300919	中伟股 份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	新股锁 定期流 通受限	24.60	163.00	610	15,006. 00	99,430. 00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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: 张)	期末 成本总 额	期末 估值总 额	备注
113050	南银转 债	2021 年 6 月 17 日	2021 年 7 月 1 日	新债未 上市流 通受限	100.00	100.00	1,950	195,000 .00	195,000 .00	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人将风险管理思想融入公司整体组织架构的设计中，从而实现全方位、多角度风险管理，确保产品风险暴露不超越投资者的风险承受能力。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。基金经理、风险管理部、交易管理部、基金运营部以及监察稽核部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理。从投资决策制定层面，投资决策委员会、投资总监、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理。从投资决策执行层面，风险管理部、交易管理部与基金运营部对投资交易与交割的合规风险、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度的证券，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发行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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	40,948,363.04	41,849,087.42
合计	40,948,363.04	41,849,087.42

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

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	195,013.68	5,207,070.00
AAA 以下	5,780,848.09	16,685,179.85
未评级	0.00	0.00
合计	5,975,861.77	21,892,249.85

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、中期票据。

(3) 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限的情况外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

##### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	24,932,021.16	-	-	-	-	-	24,932,021.16
结算备付金	1,482,201.43	-	-	-	-	-	1,482,201.43
存出保证金	207,396.58	-	-	-	-	-	207,396.58
交易性金融资产	36,664,278.60	2,970,819.90	6,203,540.00	-	326,568.75	636,402,832.66	682,568,039.91
买入返售金融资产	41,000,000.00	-	-	-	-	-	41,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,952,095.04	2,952,095.04
应收利息	-	-	-	-	-	762,445.78	762,445.78
应收股	-	-	-	-	-	28,518.48	28,518.48

利							
应收申购款	-	-	-	-	-	4,514,354.89	4,514,354.89
资产总计	104,285,897.77	2,970,819.90	6,203,540.00	-	326,568.75	644,660,246.85	758,447,073.27
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	458,884.51	458,884.51
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,366,482.37	5,366,482.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	866,799.28	866,799.28
应付托管费	-	-	-	-	-	144,466.55	144,466.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	76,110.69	76,110.69
应付交易费用	-	-	-	-	-	439,541.40	439,541.40
应交税费	-	-	-	-	-	22.87	22.87
其他负债	-	-	-	-	-	91,305.61	91,305.61
负债总计	-	-	-	-	-	7,443,613.28	7,443,613.28
利率敏感度缺口	104,285,897.77	2,970,819.90	6,203,540.00	-	326,568.75	637,216,633.57	751,003,459.99
上年度末 2020年 12月31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	35,402,487.51	-	-	-	-	-	35,402,487.51
结算备付金	3,790,665.22	-	-	-	-	-	3,790,665.22
存出保证金	147,345.26	-	-	-	-	-	147,345.26
交易性金融资产	0.00	9,281,754.24	41,436,063.00	-	12,598,322.10	674,531,204.10	737,847,343.44



产							
应收证 券清算 款						2,518,815.77	2,518,815.77
应收利 息						431,098.12	431,098.12
应收申 购款						1,518,211.93	1,518,211.93
资产总 计	39,340,497.99	9,281,754.24	41,436,063.00		-12,598,322.10	678,999,329.92	781,655,967.25
负债							
卖出回 购金融 资产款	34,000,000.00						34,000,000.00
应付证 券清算 款						7,980,791.86	7,980,791.86
应付赎 回款						8,983,185.00	8,983,185.00
应付管 理人报 酬						990,381.82	990,381.82
应付托 管费						165,063.66	165,063.66
应付销 售服务 费						58,165.48	58,165.48
应付交 易费用						676,293.30	676,293.30
应付利 息						8,582.90	8,582.90
应交税 费						106.30	106.30
其他负 债						186,530.85	186,530.85
负债总 计	34,000,000.00					19,049,101.17	53,049,101.17
利率敏 感度缺 口	5,340,497.99	9,281,754.24	41,436,063.00		-12,598,322.10	659,950,228.75	728,606,866.08

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-13,514.07	-55,139.99
	市场利率下降 25 个基点	13,546.88	55,287.12

### 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 2021 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	-	78,809,691.69	-	78,809,691.69
应收股利	-	-	-	-
资产合计	-	78,809,691.69	-	78,809,691.69
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	-	78,809,691.69	-	78,809,691.69
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 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	-	83,920,286.31	-	83,920,286.31
资产合计	-	83,920,286.31	-	83,920,286.31
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	-	83,920,286.31	-	83,920,286.31

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，对本基金资产负债表日基金资产净值产生的影响。		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	港币相对人民币升值 5%	3,940,484.58	4,196,014.32
	港币相对人民币贬值 5%	-3,940,484.58	-4,196,014.32

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021 年 6 月 30 日		2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	636,402,832.66	84.74	674,531,204.10	92.58
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	46,165,207.25	6.15	63,316,139.34	8.69
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	682,568,039.91	90.89	737,847,343.44	101.27

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	该其他价格风险的敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有股票资产的其他价格风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定市场基准变动 5%，其他变量不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	市场基准上升 5%	35,665,283.02	34,818,617.34
	市场基准下降 5%	-35,665,283.02	-34,818,617.34

注：股票市场基准取沪深 300 指数。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 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

##### 6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，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中属于第一层次的余额为人民币 626,575,676.67 元，属于第二层次的余额为人民币 40,677,322.34 元，属于第三层次的余额为人民币 15,315,040.90 元（上年度末：属于第一层次的余额为人民币 693,026,525.15 元，属于第二层次的余额为人民币 41,486,815.11 元，属于第三层次的余额为人民

币 3,334,003.18 元)。

#### 6.4.14.1.2.2 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。

#### 6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

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工具转出第三层次公允价值的金额为人民币 142,298.08 元。

#### 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	636,402,832.66	83.91
	其中：股票	636,402,832.66	83.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	46,165,207.25	6.09
	其中：债券	46,165,207.25	6.09
	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	41,000,000.00	5.41
	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	26,414,222.59	3.48
8	其他各项资产	8,464,810.77	1.12
9	合计	758,447,073.27	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 78,809,691.69 元，占期末基金资产净值的比例为 10.49%。

## 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	5,850.78	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	479,994,477.65	63.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.69
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	92,798.36	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,536,722.27	2.20
J	金融业	16,979,806.14	2.26
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	38,770,501.05	5.16
N	水利、环境和公共设施管理业	27,576.75	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	557,593,140.97	74.25

### 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	29,863,317.92	3.98
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	13,034,658.01	1.74
G 工业	-	-
H 信息技术	24,532,439.30	3.27
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	11,379,276.46	1.52
合计	78,809,691.69	10.49

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	300124	汇川技术	522,496	38,800,552.96	5.17
2	601012	隆基股份	429,434	38,150,916.56	5.08
3	600885	宏发股份	525,885	32,972,989.50	4.39
4	002460	赣锋锂业	252,901	30,623,782.09	4.08
5	002475	立讯精密	601,693	27,677,878.00	3.69
6	300866	安克创新	144,871	24,261,546.37	3.23
7	002271	东方雨虹	367,952	20,355,104.64	2.71
8	601799	星宇股份	83,002	18,735,211.44	2.49
9	603806	福斯特	177,720	18,683,703.60	2.49
10	300059	东方财富	516,776	16,945,085.04	2.26
11	688188	柏楚电子	37,836	16,496,496.00	2.20
12	02382	舜宇光学科技	78,800	16,090,363.64	2.14
13	300973	立高食品	103,226	15,985,885.60	2.13
14	002706	良信股份	697,140	15,713,535.60	2.09
15	300274	阳光电源	134,226	15,444,043.56	2.06
16	300122	智飞生物	81,200	15,162,476.00	2.02
17	002444	巨星科技	434,750	14,816,280.00	1.97
18	000012	南玻 A	1,437,167	14,716,590.08	1.96
19	300760	迈瑞医疗	28,801	13,825,920.05	1.84
20	688007	光峰科技	337,023	13,703,243.24	1.82
21	688208	道通科技	152,326	13,250,838.74	1.76
22	01801	信达生物	173,000	13,034,658.01	1.74
23	002821	凯莱英	34,492	12,851,719.20	1.71
24	300037	新宙邦	125,200	12,532,520.00	1.67
25	688319	欧林生物	305,895	11,443,531.95	1.52
26	300012	华测检测	357,200	11,387,536.00	1.52
27	06098	碧桂园服务	163,000	11,379,276.46	1.52
28	603259	药明康德	70,656	11,064,023.04	1.47
29	002311	海大集团	129,533	10,569,892.80	1.41
30	600519	贵州茅台	5,100	10,489,170.00	1.40
31	02313	申洲国际	56,000	9,137,569.73	1.22
32	603501	韦尔股份	26,700	8,597,400.00	1.14
33	02020	安踏体育	53,000	8,061,523.87	1.07
34	688179	阿拉丁	57,334	8,040,520.16	1.07
35	01347	华虹半导体	215,000	7,674,689.88	1.02
36	688696	极米科技	9,034	7,516,288.00	1.00
37	688133	泰坦科技	23,509	7,472,805.83	1.00
38	03690	美团-W	27,400	7,304,797.04	0.97

39	00669	创科实业	47,500	5,359,427.28	0.71
40	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.69
41	688390	固德威	13,241	4,422,494.00	0.59
42	300595	欧普康视	35,340	3,659,457.00	0.49
43	000568	泸州老窖	15,500	3,657,070.00	0.49
44	600436	片仔癀	5,100	2,286,330.00	0.30
45	688169	石头科技	1,725	2,175,225.00	0.29
46	688185	康希诺	1,679	1,305,875.83	0.17
47	002372	伟星新材	56,277	1,163,245.59	0.15
48	00268	金蝶国际	35,000	767,385.78	0.10
49	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.09
50	300957	贝泰妮	2,404	641,285.03	0.09
51	688538	和辉光电	177,148	598,760.24	0.08
52	300896	爱美客	668	526,971.84	0.07
53	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.05
54	688076	诺泰生物	4,984	339,958.64	0.05
55	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.04
56	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.03
57	688059	华锐精密	1,023	171,761.70	0.02
58	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.02
59	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
60	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.01
61	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.01
62	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.01
63	300979	华利集团	842	73,675.00	0.01
64	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
65	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
66	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
67	688660	电气风电	5,751	50,608.80	0.01
68	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
69	300981	中红医疗	541	48,900.99	0.01
70	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.00
71	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
72	300887	谱尼测试	378	33,789.42	0.00
73	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.00
74	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
75	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
76	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
77	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
78	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
79	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
80	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
81	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00



82	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
83	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
84	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
85	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
86	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
87	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
88	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
89	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
90	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
91	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
92	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
93	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
94	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
95	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
96	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
97	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
98	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
99	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
100	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
101	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
102	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
103	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
104	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
105	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
106	600276	恒瑞医药	107	7,272.79	0.00
107	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
108	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
109	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
110	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
111	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
112	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
113	603939	益丰药房	110	6,169.90	0.00
114	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
115	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
116	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
117	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
118	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
119	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
120	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
121	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
122	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
123	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
124	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

125	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
-----	--------	------	-----	----------	------

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601799	星宇股份	26,646,052.05	3.66
2	002027	分众传媒	20,995,641.00	2.88
3	300124	汇川技术	19,890,452.95	2.73
4	002475	立讯精密	19,757,689.01	2.71
5	002706	良信股份	18,066,854.48	2.48
6	300059	东方财富	17,816,737.00	2.45
7	01347	华虹半导体	17,697,318.50	2.43
8	002444	巨星科技	16,601,557.50	2.28
9	603719	良品铺子	16,277,472.04	2.23
10	300973	立高食品	15,400,470.08	2.11
11	300012	华测检测	15,260,470.00	2.09
12	601601	中国太保	15,074,617.00	2.07
13	300699	光威复材	14,618,558.32	2.01
14	002271	东方雨虹	14,080,400.00	1.93
15	000012	南玻 A	13,363,140.03	1.83
16	688208	道通科技	12,881,085.78	1.77
17	002600	领益智造	11,966,812.92	1.64
18	688319	欧林生物	11,104,490.84	1.52
19	002375	亚厦股份	10,945,946.00	1.50
20	600885	宏发股份	10,753,782.49	1.48

注：买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002027	分众传媒	44,177,730.78	6.06
2	000661	长春高新	32,984,617.90	4.53
3	601799	星宇股份	29,947,664.13	4.11
4	002271	东方雨虹	27,202,693.00	3.73
5	603517	绝味食品	25,599,979.40	3.51
6	002460	赣锋锂业	24,279,493.01	3.33
7	688007	光峰科技	23,828,884.66	3.27

8	601012	隆基股份	23,547,741.27	3.23
9	603719	良品铺子	23,323,200.94	3.20
10	300274	阳光电源	22,915,137.00	3.15
11	688408	中信博	22,465,392.39	3.08
12	300595	欧普康视	22,197,603.80	3.05
13	688188	柏楚电子	20,709,395.63	2.84
14	600031	三一重工	20,423,926.30	2.80
15	600276	恒瑞医药	17,731,312.03	2.43
16	002821	凯莱英	16,286,046.00	2.24
17	01579	颐海国际	14,045,797.21	1.93
18	601689	拓普集团	14,020,822.15	1.92
19	601601	中国太保	13,820,995.00	1.90
20	06186	中国飞鹤	13,058,781.12	1.79

注：卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	606,068,104.34
卖出股票收入（成交）总额	779,322,933.92

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	40,193,540.00	5.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,971,667.25	0.80
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	46,165,207.25	6.15

### 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	019640	20 国债 10	339,900	33,990,000.00	4.53
2	019649	21 国债 01	42,000	4,202,940.00	0.56
3	113040	星宇转债	20,970	2,970,819.90	0.40
4	113611	福 20 转债	15,540	2,674,278.60	0.36
5	019654	21 国债 06	20,000	2,000,600.00	0.27

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 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。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

##### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

##### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	207,396.58
2	应收证券清算款	2,952,095.04

3	应收股利	28,518.48
4	应收利息	762,445.78
5	应收申购款	4,514,354.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,464,810.77

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113040	星宇转债	2,970,819.90	0.40
2	113611	福 20 转债	2,674,278.60	0.36
3	128136	立讯转债	131,568.75	0.02

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
鹏扬景升 混合 A	28,182	7,667.36	50,630,994.49	23.43%	165,450,513.87	76.57%
鹏扬景升 混合 C	10,701	4,281.15	6,559,182.32	14.32%	39,253,393.41	85.68%
合计	38,883	6,735.44	57,190,176.81	21.84%	204,703,907.28	78.16%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从	鹏扬景升混合 A	785,812.92	0.3637%

业人员持有本基金	鹏扬景升混合 C	135,445.17	0.2957%
	合计	921,258.09	0.3518%

### 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

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	268,051,771.10	37,826,279.04
本报告期基金总申购份额	94,926,491.37	44,692,135.05
减：本报告期基金总赎回份额	146,896,754.11	36,705,838.36
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	216,081,508.36	45,812,575.73

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人：

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人托管部门：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
国信证券	2	523,065,379.28	38.44%	378,984.76	38.20%	-
安信证券	2	520,031,498.16	38.21%	380,866.05	38.39%	-
东方证券	2	275,428,315.69	20.24%	201,821.62	20.34%	-
中信建投	2	42,288,788.33	3.11%	30,405.21	3.06%	-
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。经公司批准后被选择的证券经营机构签订协议。

(3)本基金本报告期内无新增或剔除的交易单元。

##### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	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
国信证券	13,845,021.20	28.66%	480,400,000.00	39.04%	-	-
安信证券	22,496,069.79	46.56%	480,600,000.00	39.05%	-	-
东方证券	11,973,818.90	24.78%	215,600,000.00	17.52%	-	-
中信建投	-	-	54,000,000.00	4.39%	-	-
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关于旗下部分开放式基金在上海浦东发展银行股份有限公司开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021年1月4日
2	鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021年1月22日
3	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021年1月28日
4	鹏扬基金管理有限公司关于旗下开放式基金在珠海盈米基金销售有限公司开展转换费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021年3月1日
5	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在兴业银行股份有限公司开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021年3月2日
6	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021年3月25日
7	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在招商银行旗下招赢通平台开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021年3月25日
8	鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书(2021年第1号)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021年3月27日
9	鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金(鹏扬景升混合 C 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021年3月27日
10	鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金(鹏扬景升混合 A 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021年3月27日
11	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金	证监会指定报刊及网	2021年3月29日



	合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	站、公司官网	
12	鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 30 日
13	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 4 月 6 日
14	鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 4 月 22 日
15	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 5 月 17 日
16	鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金在直销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 5 月 25 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	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 6 月 3 日
18	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 6 月 17 日
19	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 6 月 29 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

## 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

## 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

鹏扬基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日