

# 鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏扬景沃六个月混合	
基金主代码	009064	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 16 日	
报告期末基金份额总额	3,485,262,565.29 份	
投资目标	本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	基金管理人通过对经济周期及资产价格发展变化的理解，在把握经济周期性波动的基础上，动态评估不同资产类别在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征，追求稳健增长。	
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%	
风险收益特征	本基金属于混合型基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金可能投资于港股通标的股票，需承担汇率风险及境外市场的风险。	
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鹏扬景沃六个月混合 A	鹏扬景沃六个月混合 C
下属分级基金的交易代码	009064	009065
报告期末下属分级基金的份额总额	2,328,295,866.38 份	1,156,966,698.91 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2021 年 7 月 1 日 — 2021 年 9 月 30 日)	
	鹏扬景沃六个月混合 A	鹏扬景沃六个月混合 C
1. 本期已实现收益	31,681,148.75	14,666,872.60
2. 本期利润	-41,128,359.04	-22,074,121.40
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0152	-0.0159
4. 期末基金资产净值	2,560,258,062.44	1,264,416,691.23
5. 期末基金份额净值	1.0996	1.0929

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) 本报告所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏扬景沃六个月混合 A

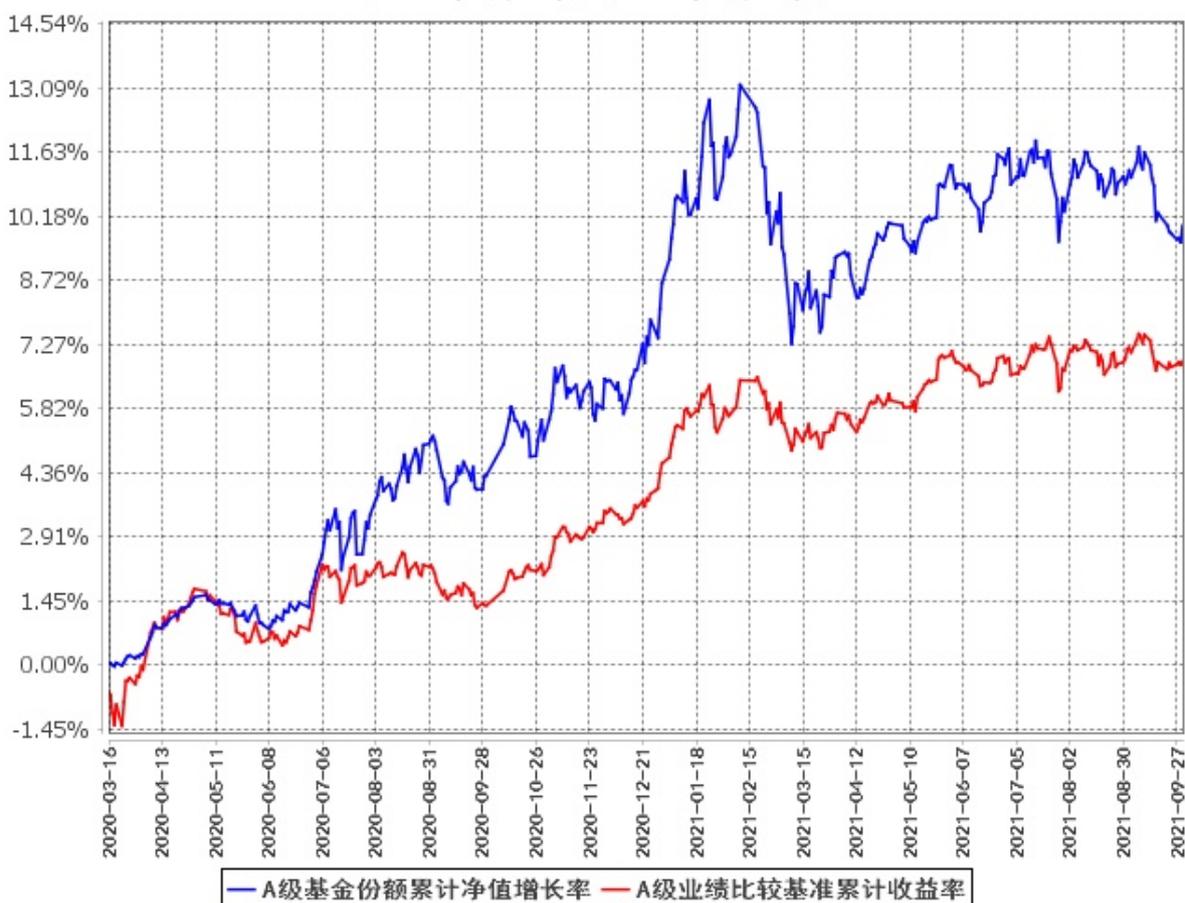
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.45%	0.31%	-0.04%	0.19%	-1.41%	0.12%
过去六个月	1.08%	0.28%	1.46%	0.16%	-0.38%	0.12%
过去一年	5.44%	0.37%	5.46%	0.17%	-0.02%	0.20%
自基金合同 生效起至今	9.96%	0.33%	6.88%	0.18%	3.08%	0.15%

鹏扬景沃六个月混合 C

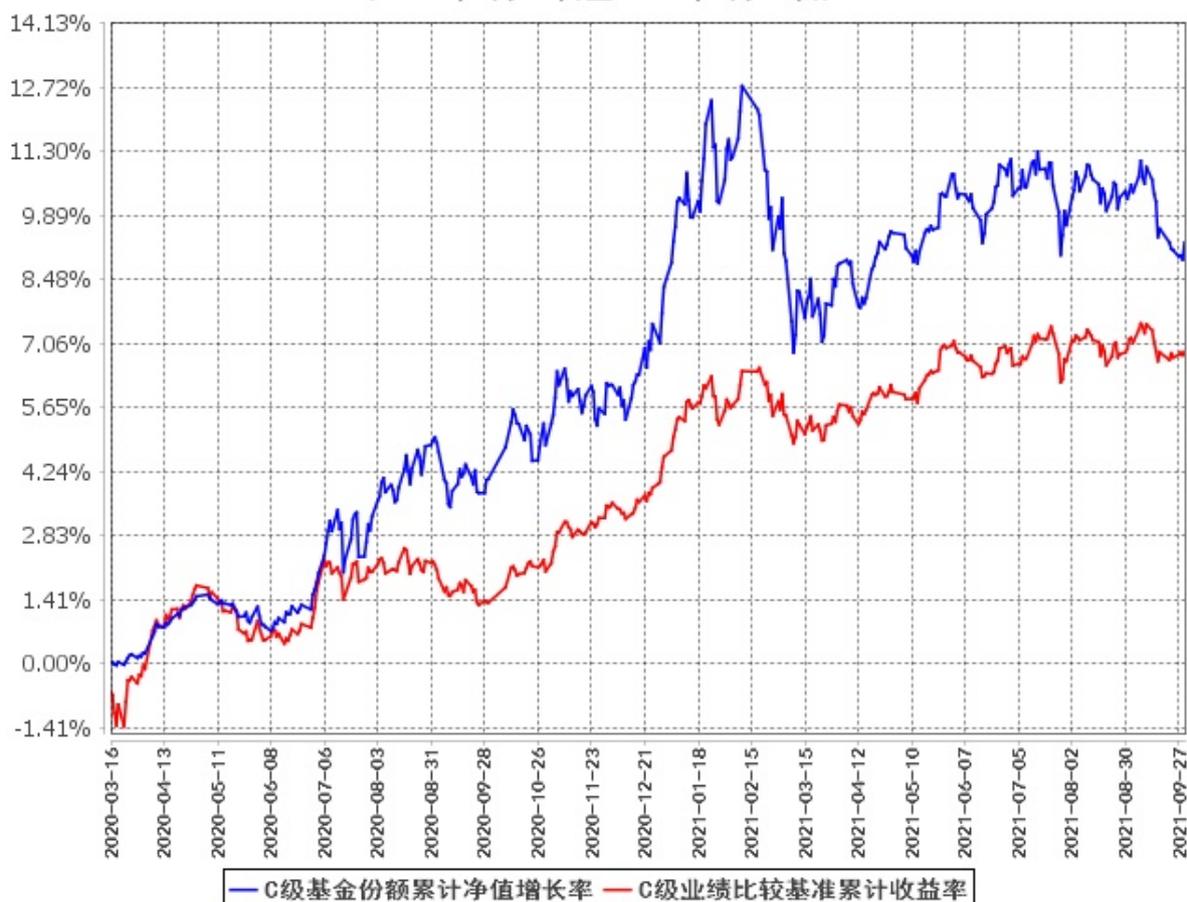
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.55%	0.31%	-0.04%	0.19%	-1.51%	0.12%
过去六个月	0.90%	0.28%	1.46%	0.16%	-0.56%	0.12%
过去一年	5.02%	0.37%	5.46%	0.17%	-0.44%	0.20%
自基金合同 生效起至今	9.29%	0.33%	6.88%	0.18%	2.41%	0.15%

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

**A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2020年3月16日至2021年9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**  
(2020年3月16日至2021年9月30日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨爱斌	本基金基金经理, 总经理	2021年7月1日	-	21	复旦大学国际金融专业经济学硕士，曾任中国平安保险(集团)股份有限公司组合管理部副总经理；华夏基金管理有限公司固定收益投资总监；北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。现任鹏扬基金管理有限公司董事、总经

				<p>理。2017 年 6 月 2 日至今任鹏扬汇利债券型证券投资基金基金经理；2017 年 6 月 15 日至 2019 年 1 月 4 日任鹏扬利泽债券型证券投资基金基金经理；2018 年 12 月 12 日至今任鹏扬泓利债券型证券投资基金基金经理；2020 年 8 月 11 日至今任鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 1 日至今任鹏扬景源一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 1 日至今任鹏扬景明一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 1 日至今任鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 1 日至今任鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 7 日至今任鹏扬景恒六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 7 日至今任鹏扬景惠六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 9 月 30 日至今任鹏扬景阳一年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p>
王莹莹	本基金基金经理, 现金管理部现金策略副总监	2020 年 3 月 16 日	-	<p>6</p> <p>英国埃克斯特大学硕士，曾任北京京粮置业有限公司财务部资金专员；北京鹏扬投资管理有限公司交易管理部债券交易员。现任鹏扬基金管理有限公司现金管理部现金策略副总监。2018 年 8 月 24 日至今任鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、鹏扬淳</p>

				<p>优一年定期开放债券型证券投资基金、鹏扬现金通利货币市场基金基金经理;2019 年 11 月 13 日至 2021 年 3 月 18 日任鹏扬利沣短债债券型证券投资基金基金经理;2019 年 11 月 18 日至今任鹏扬淳开债券型证券投资基金基金经理;2020 年 3 月 16 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 14 日至今任鹏扬景科混合型证券投资基金基金经理;2021 年 1 月 25 日至今任鹏扬淳明债券型证券投资基金基金经理;2021 年 3 月 18 日至今任鹏扬淳合债券型证券投资基金基金经理;2021 年 6 月 16 日至今任鹏扬景源一年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p>
李刚	本基金基金经理, 副总经理	2020 年 3 月 16 日	2021 年 7 月 1 日	<p>19</p> <p>中国社科院经济学博士, 曾任中国农业银行资产负债管理部交易员、资金营运部高级交易员、金融市场部处长、副总经理。2017 年 10 月 16 日至 2021 年 7 月 9 日任鹏扬基金管理有限公司副总经理。2019 年 1 月 4 日至 2020 年 3 月 20 日任鹏扬利泽债券型证券投资基金基金经理;2020 年 1 月 20 日至 2021 年 7 月 1 日任鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金基金经理;2020 年 3 月 16 日至 2021 年 7 月 1 日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 21 日至 2021 年 7 月 8 日任鹏扬景</p>

				<p>恒六个月持有期混合型证券投资基金基金经理;2020 年 6 月 24 日至 2021 年 7 月 8 日任鹏扬景惠六个月持有期混合型证券投资基金基金经理;2020 年 11 月 4 日至 2021 年 7 月 8 日任鹏扬景合六个月持有期混合型证券投资基金基金经理;2021 年 1 月 12 日至 2021 年 7 月 8 日任鹏扬景明一年持有期混合型证券投资基金基金经理;2021 年 3 月 9 日至 2021 年 7 月 8 日任鹏扬景源一年持有期混合型证券投资基金基金经理;2021 年 3 月 23 日至 2021 年 7 月 8 日任鹏扬景安一年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p>
赵世宏	本基金基金经理, 股票投资部总经理	2020 年 3 月 20 日	-	<p>10</p> <p>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; 2021 年 9 月 7 日至今</p>

					任鹏扬数字经济先锋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 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为保护投资者利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合。公司根据《证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《鹏扬基金管理有限公司公平交易制度》、《鹏扬基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，对公平对待公司管理的各类资产做了明确具体的规定并重视交易执行环节的公平交易措施。本报告期内，本公司公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年 3 季度，全球疫情再度恶化，欧美、亚太地区经济增速有所放缓，全球经济复苏动力减弱。受芯片短缺、海运费大涨等不利因素影响，全球制造业 PMI 指标连续 3 个月触顶回落。美国经济增长高位放缓，受疫情反复、财政补贴退坡和消费品大幅涨价等因素影响，美国消费者信心指数大幅回落。中国经济受局部疫情反复、房地产市场降温、汛期洪灾频发、“教育双减”和“能耗双控”等行业政策的影响，国民经济供需两侧均出现放缓，多数经济指标同比回落，经济下行压力增大。通

货膨胀方面，CPI 同比保持低位，主要是猪价大幅下降和房租恢复较弱制约了核心 CPI 和服务价格上涨；PPI 同比大幅上升并保持高位，但受城镇居民可支配收入增速回落和边际消费倾向不足的影响，PPI 向 CPI 传导并不顺畅，PPI 和 CPI 背离不断加大，且背离持续高位时间拉长。流动性方面，央行通过全面降准和灵活适度的公开市场操作，总体保持中性偏宽松局面。信用扩张方面，受实体经济走弱、非标延续收缩、政府债去年基数高等因素共同拖累，社会融资总量增速继续回落，8 月增速已经低于疫情前 2019 年下半年的均衡水平，与历史最低水平持平，对总需求扩张带来不利影响。

2021 年 3 季度，债券市场先扬后抑，利率水平先降后升，中债综合全价指数上涨 0.83%。7 月初受央行超预期降准叠加市场风险偏好大幅下降等多重因素影响，10 年期国债利率水平下行约 27BP；8-9 月利率水平保持在 2.85%左右横向波动，主要受经济基本面不断走弱和政策面转向预期以及专项债供给提速的多重因素影响。由于央行并未使用降息或降低公开市场利率等价格工具，收益率曲线整体呈现小幅牛市变平格局，更多反映经济基本面的下行趋势。信用利差方面，受经济下行压力和部分房地产公司信用风险事件冲击，信用利差整体走阔，高等级和中低等级信用债券等级利差也明显扩大。此外，受银行理财产品监管影响，银行永续债和二级资本债的利率水平和利差水平在政策出台后明显回升。

操作方面，本基金 7-8 月逐步提升组合久期至 2 年左右并维持至 9 月末，仍然延续哑铃配置。组合以 1 年存单、1-3 年高等级与 30 年国债为底仓；季末银行永续债与二级资本债受到政策影响快速回调，组合逐步增配此类品种，以提升组合静态收益。至季末，组合无杠杆，债券静态收益 3.30%。转债方面，组合逢高止盈部分券商、消费品种，仓位从 2.5%降至 1%以内。

2021 年 3 季度，市场分化明显，市场的不确定因素明显加大，但部分行业估值回调充分，配置价值凸显。首先，以新能源、大宗商品为代表的板块，持续大幅上涨，积累了一定泡沫，而制造业、消费、医药等中下游行业又压缩估值。其次，政府对教育、互联网等行业的监管措施，在深刻影响相关行业的长期逻辑之外，也造成了内资和外资风险偏好下降和资金阶段性流出。最后，宏观经济压力增大，从地产、汽车、手机以及其他消费品数据看出，经济下行压力较大，特别是个别地产公司风险发酵到关键节点，相关股票的股价反应较为充分。在这种情况下，投资操作挑战加大，同时长期的投资机会也更多。

操作方面，本基金本报告期内进一步提高了组合持仓的分散度，做了部分超涨公司的止盈操作，也配置了部分回调充分、估值合理的医药、消费类标的。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬景沃六个月混合 A 的基金份额净值为 1.0996 元，本报告期基金份额净值增

长率为-1.45%；截至本报告期末鹏扬景沃六个月混合 C 的基金份额净值为 1.0929 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.55%；同期业绩比较基准收益率为-0.04%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	900,916,200.40	22.94
	其中：股票	900,916,200.40	22.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,834,526,229.83	72.18
	其中：债券	2,834,526,229.83	72.18
	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	-	-
	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	123,270,988.94	3.14
8	其他资产	68,230,861.80	1.74
9	合计	3,926,944,280.97	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 82,679,455.58 元，占期末基金资产净值的比例为 2.16%。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	173,111.52	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	518,884,848.86	13.57

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,299,875.22	0.16
E	建筑业	20,183.39	0.00
F	批发和零售业	77,729.83	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	40,233.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,396,098.51	0.40
J	金融业	204,242,107.37	5.34
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	73,068,725.08	1.91
N	水利、环境和公共设施管理业	29,906.38	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	3,925.22	0.00
S	综合	-	-
	合计	818,236,744.82	21.39

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	27,444,711.85	0.72
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	10,112,465.36	0.26
F 医疗保健	1,170,282.69	0.03
G 工业	-	-
H 信息技术	23,714,885.63	0.62
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	20,237,110.05	0.53
合计	82,679,455.58	2.16

注：以上行业分类采用全球行业分类标准(GICS)。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	3,573,500	65,395,050.00	1.71

2	601939	建设银行	7,015,033	41,879,747.01	1.09
3	000001	平安银行	2,175,600	39,008,508.00	1.02
4	300012	华测检测	1,445,708	36,648,697.80	0.96
5	000333	美的集团	459,700	31,995,120.00	0.84
6	300059	东方财富	902,844	31,030,748.28	0.81
7	600885	宏发股份	442,200	27,584,436.00	0.72
8	02313	申洲国际	198,700	27,444,711.85	0.72
9	300760	迈瑞医疗	61,800	23,818,956.00	0.62
10	02382	舜宇光学科技	139,000	23,714,885.63	0.62

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	535,700,000.00	14.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	420,768,000.00	11.00
	其中：政策性金融债	139,594,000.00	3.65
4	企业债券	241,222,000.00	6.31
5	企业短期融资券	240,597,000.00	6.29
6	中期票据	709,811,000.00	18.56
7	可转债（可交换债）	32,282,229.83	0.84
8	同业存单	593,749,000.00	15.52
9	地方政府债	60,397,000.00	1.58
10	其他	-	-
11	合计	2,834,526,229.83	74.11

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	210005	21 付息国债 05	1,100,000	116,160,000.00	3.04
1	019653	21 国债 05	1,000,000	105,670,000.00	2.76
2	101800976	18 陕交建 MTN003	1,800,000	182,088,000.00	4.76
3	019641	20 国债 11	1,500,000	150,375,000.00	3.93
4	210316	21 进出 16	1,400,000	139,594,000.00	3.65
5	102100276	21 陕延油 MTN001	1,100,000	111,826,000.00	2.92

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

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。中国进出口银行、中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,294,329.78
2	应收证券清算款	25,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	40,922,529.39

5	应收申购款	14,002.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,230,861.80

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	9,493,217.60	0.25
2	127022	恒逸转债	6,171,882.75	0.16
3	110076	华海转债	5,377,000.00	0.14
4	113542	好客转债	3,488,833.80	0.09
5	128121	宏川转债	2,868,872.58	0.08
6	110064	建工转债	2,560,727.70	0.07
7	113563	柳药转债	2,099,000.00	0.05

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏扬景沃六个月混合 A	鹏扬景沃六个月混合 C
报告期期初基金份额总额	3,062,922,276.49	1,602,148,447.07
报告期期间基金总申购份额	20,091,072.39	14,679,368.80
减：报告期期间基金总赎回份额	754,717,482.50	459,861,116.96
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	2,328,295,866.38	1,156,966,698.91

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
6. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可

在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

鹏扬基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日