

# 鹏扬景润一年持有期混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 22 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 20 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|                 |   |                 |
|-----------------|---|-----------------|
| 基金简称            | 鹏扬景润一年混合  |                 |
| 基金主代码           | 012253  |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式  |                 |
| 基金合同生效日         | 2021 年 8 月 6 日  |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 1,311,874,559.17 份  |                 |
| 投资目标            | 本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。                               |                 |
| 投资策略            | 本基金的投资策略包括：类属资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资投资策略、信用衍生品投资策略。  |                 |
| 业绩比较基准          | 中债综合财富(总值)指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%                         |                 |
| 风险收益特征          | 本基金属于混合型基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金可能投资于港股通标的股票，需承担汇率风险及境外市场的风险。 |                 |
| 基金管理人           | 鹏扬基金管理有限公司  |                 |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司  |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 鹏扬景润一年混合 A  | 鹏扬景润一年混合 C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 012253  | 012254          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,250,201,544.05 份  | 61,673,015.12 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10月1日—2021年12月31日) |               |
|-----------------|-----------------------------|---------------|
|                 | 鹏扬景润一年混合 A                  | 鹏扬景润一年混合 C    |
| 1. 本期已实现收益      | 6,123,334.26                | 239,489.22    |
| 2. 本期利润         | 31,795,714.27               | 1,504,111.82  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0254                      | 0.0244        |
| 4. 期末基金资产净值     | 1,268,740,560.29            | 62,486,818.49 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0148                      | 1.0132        |

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

鹏扬景润一年混合 A

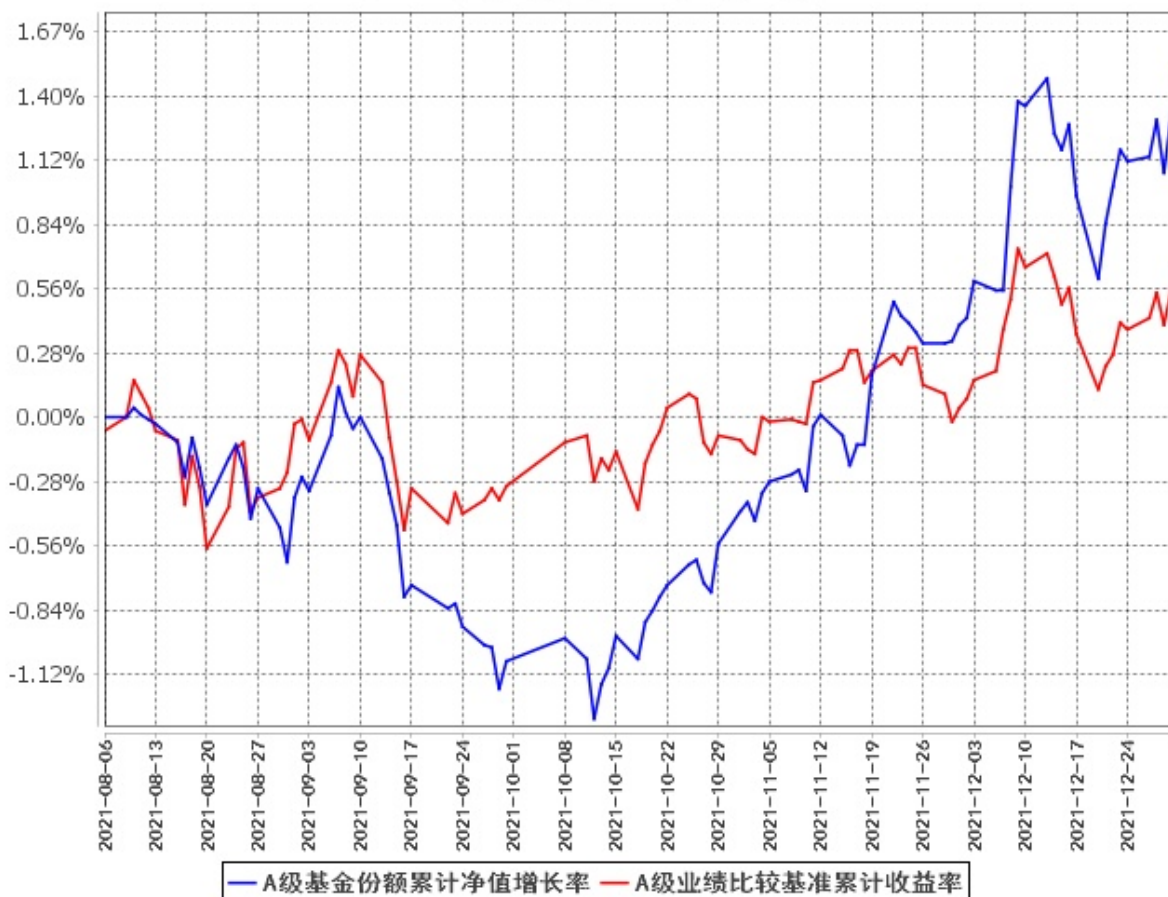
| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③   | ②-④   |
|----------------|--------|---------------|----------------|-------------------|-------|-------|
| 过去三个月          | 2.57%  | 0.16%         | 0.97%          | 0.11%             | 1.60% | 0.05% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 1.48%  | 0.15%         | 0.67%          | 0.13%             | 0.81% | 0.02% |

鹏扬景润一年混合 C

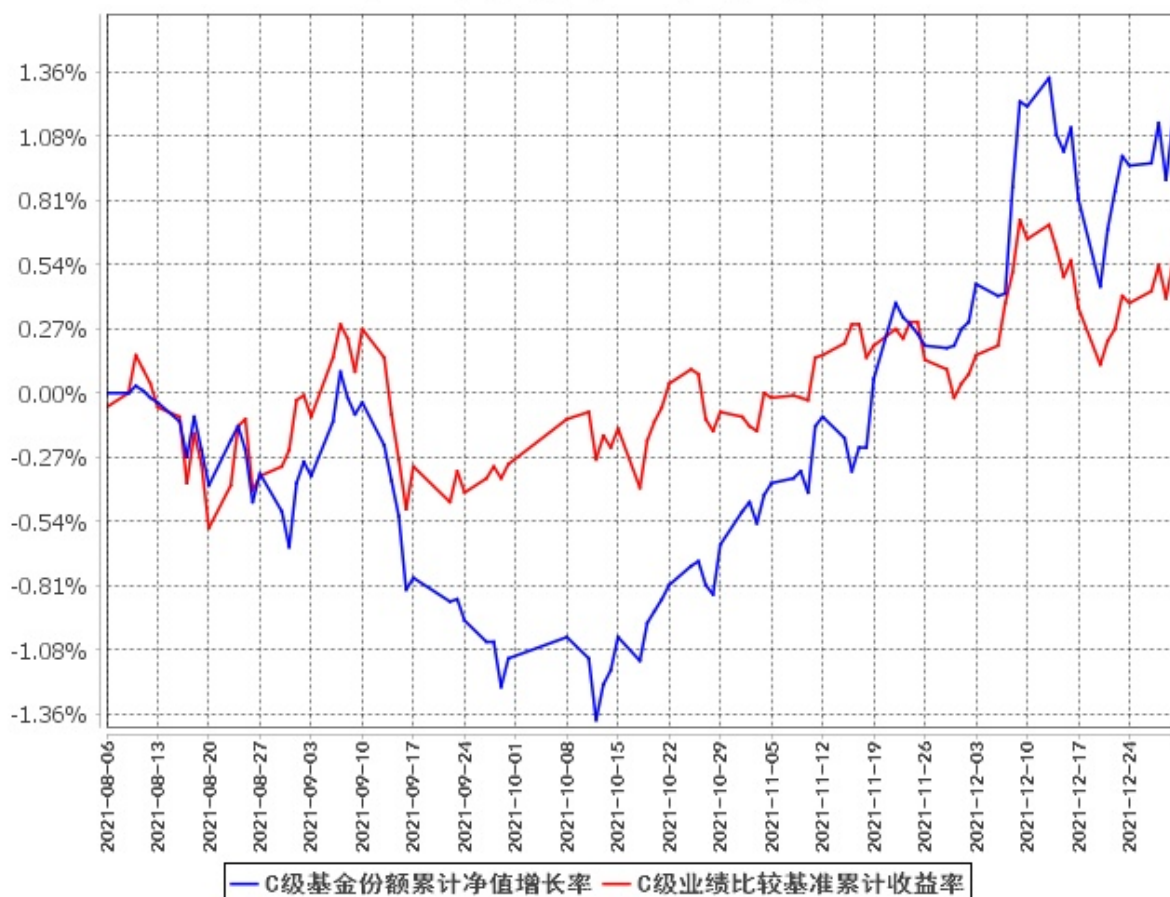
| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③   | ②-④   |
|----------------|--------|---------------|----------------|-------------------|-------|-------|
| 过去三个月          | 2.47%  | 0.16%         | 0.97%          | 0.11%             | 1.50% | 0.05% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 1.32%  | 0.15%         | 0.67%          | 0.13%             | 0.65% | 0.02% |

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

**A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2021年8月6日至2021年12月31日)**



**C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2021年8月6日至2021年12月31日)**



注：(1)本基金合同于 2021 年 8 月 6 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（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 |        |   |
| 王华 | 本基金基金经理, 公司总经理助理 | 2021年8月6日   | -    | 11     | 清华大学理学学士, CFA、FRM。曾任银河期货有限公司研究员、金融市场部固定收益总经理, 银河德睿资本管理有限公司固定收益部总经理, 北京鹏扬投 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>资产管理有限公司衍生品策略部总经理。现任鹏扬基金管理有限公司总经理助理。2018 年 2 月 13 日至今任鹏扬双利债券型证券投资基金基金经理；2018 年 4 月 3 日至 2019 年 8 月 15 日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 2019 年 8 月 15 日任鹏扬景欣混合型证券投资基金基金经理；2018 年 6 月 21 日至今任鹏扬淳合债券型证券投资基金基金经理；2018 年 12 月 12 日至 2021 年 3 月 18 日任鹏扬淳享债券型证券投资基金基金经理；2019 年 3 月 28 日至今任鹏扬添利增强债券型证券投资基金基金经理；2019 年 12 月 25 日至 2021 年 1 月 25 日任鹏扬淳明债券型证券投资基金基金经理；2020 年 2 月 27 日至今任鹏扬淳悦一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2020 年 4 月 21 日至今任鹏扬富利增强债券型证券投资基金基金经理；2020 年 8 月 26 日至 2021 年 12 月 24 日任鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2020 年 10 月 28 日至今任鹏扬稳利债券型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 7 日至今任鹏扬景安一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 8 月 6 日至今任鹏扬景润一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 9 月 9 日至今任鹏</p> |
|--|--|--|--|---|

|  |  |  |  |  |                        |
|--|--|--|--|--|------------------------|
|  |  |  |  |  | 扬景浦一年持有期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 4 季度，受新冠病毒变异冲击及全球货币财政政策边际收紧等多重因素影响，全球经济增长出现高位放缓迹象，全球制造业动能不断走弱，房屋、汽车与居家耐用品涨价对消费信心产生极大抑制，同时随着商品和服务价格上涨，工资等劳动力成本也开始提高，通货膨胀压力加剧。海外主要矛盾已经由应对疫情引起的经济、就业冲击转为应对通货膨胀，部分发达与新兴市场国家开始加息，美联储也正式宣布宽松货币政策的退出，预期在 2022 年进入紧缩和加息周期。

2021 年 3 季度以来，中国经济面临“供给冲击、需求收缩、预期转弱”三重压力。4 季度随着

双碳政策全面纠偏，经济面临的供给冲击已解除，原材料价格回落后企业开始补库，工业产出活动有所恢复。但在需求方面，受财政后置和房地产去杠杆的不利影响，投资需求仍然偏弱；消费需求方面，受持续近两年的新冠疫情反复冲击，居民人均可支配收入恢复缓慢，增长乏力，明显落后于名义 GDP 增长水平。通货膨胀方面，4 季度 CPI 同比保持低位，主要是在信用收缩、需求不足的大背景下，受耐用消费品涨价压力减弱、服务业成本中的房租与农民工工资上涨乏力等因素影响；PPI 价格大幅冲高后逐步回落，主要因为随着“保供稳价”的政策出台，国内煤炭与电力供应紧张逐步缓解，叠加地产投资的快速下降，上游工业原材料等大宗商品价格高位回落。

流动性方面，为应对经济下行压力和部分房地产企业的流动性风险，央行 2021 年 12 月实施全面降准并下调一年期 LPR 利率 5bp，同时加大公开市场操作力度，总体保持流动性偏宽松局面。信用扩张方面，广义社会融资总量同比增速略有回升并有企稳迹象，主要受居民部门房屋按揭贷款改善和政府债券发行提速驱动；但反映经济内生融资需求的中长期贷款延续回落态势。

2021 年 4 季度，债券市场先抑后扬，利率水平先升后降，中债综合全价指数上涨 0.6%。10 月初受降准预期落空、宽信用预期升温以及煤炭等能源价格暴涨的影响，利率快速上行；但自 10 月中下旬开始，在高频经济数据较弱、头部民营房地产企业违约风险上升、货币政策宽松预期和降准降息等利好政策的支持下，利率再次下行回到 7 月降准后的前期低位。信用利差方面，在宽松的流动性支持下，中高等级信用利差多数被动收窄，但受房地产行业基本面不断恶化和部分财政实力较弱地区的城投债券信用风险上升影响，中长期低等级城投债券利差明显走阔。4 季度，受固收+策略产品规模大幅上升对转债市场的大规模配置资金驱动，可转债市场大幅上涨，转债估值水平进一步大幅提升。

操作方面，本基金本报告期内组合久期由 3 左右下降至 1.5-2 区间。信用债除了基本配置外，还于 10 月初银行资本债冲击后的高点开始重点参与了银行资本债交易及行权债博弈，获得不错的收益。转债方面，组合主要通过周期和部分新能源标的博取收益。

2021 年 4 季度，全球股票市场震荡走高。国内股票市场 A 股面临宏观整体环境偏弱、微观基本面好坏参半局面，整体呈现震荡上涨格局，但风格与行业分化较大。从风格来看，中小盘风格跑赢大盘风格。代表大盘价值风格的上证 50 指数上涨 2.42%，沪深 300 指数上涨 1.52%；代表中小盘成长风格的创业板指数和中小板指数分别上涨 2.40%和 6.21%。从行业板块来看，市场始终保持快速轮动特征，前期热门赛道股新能源行业和医药 CXO 行业见顶回落，而受“元宇宙”等概念推动的传媒、通讯、电子等行业涨幅较大。此外，受益于上游原材料价格回落和政策支持的军工以及受益于房地产政策改善预期的家居等轻工制造行业也明显回升，而受房地产投资下滑加速冲击的房地产、银行跌幅居前，受上游大宗商品价格回落影响的钢铁、有色、化工等周期板块也明显走弱。



操作方面，本基金本报告期内逐步增持电力设备、汽车、军工等成长性较优的标的，以及部分被低估的食品饮料标的及银行标的。组合整体行业配置较为均衡，成长与价值兼顾。同时，组合中配置了一定比例的动态套保策略，通过动态套保策略控制组合波动率、仓位和风险敞口，并提高资金效率，增厚组合收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬景润一年混合 A 的基金份额净值为 1.0148 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.57%；截至本报告期末鹏扬景润一年混合 C 的基金份额净值为 1.0132 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.47%；同期业绩比较基准收益率为 0.97%。

#### 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              | 224,603,846.89   | 16.60        |
|    | 其中：股票             | 224,603,846.89   | 16.60        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 1,075,775,581.88 | 79.49        |
|    | 其中：债券             | 1,075,775,581.88 | 79.49        |
|    | 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      | 30,752,831.28    | 2.27         |
| 8  | 其他资产              | 22,216,121.06    | 1.64         |
| 9  | 合计                | 1,353,348,381.11 | 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 16,371,164.54 元，占期末基金资产净值的比例为 1.23%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 136,933,443.13 | 10.29        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,104,906.00  | 0.91         |
| E  | 建筑业              | 4,713.80       | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 4,382,686.82   | 0.33         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 7,394,434.00   | 0.56         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 4,608.00       | 0.00         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 4,091,387.29   | 0.31         |
| J  | 金融业              | 40,398,553.60  | 3.03         |
| 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       | 113,216.04     | 0.01         |
| 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        | 2,804,733.67   | 0.21         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 208,232,682.35 | 15.64        |

### 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 | 7,015,187.87  | 0.53         |
| C 消费者常用品  | 2,745,500.80  | 0.21         |
| D 能源      | -             | -            |
| E 金融      | -             | -            |
| F 医疗保健    | -             | -            |
| G 工业      | -             | -            |
| H 信息技术    | 2,600,900.06  | 0.20         |
| I 电信服务    | 1,718,006.53  | 0.13         |
| J 公用事业    | 2,291,569.28  | 0.17         |
| K 房地产     | -             | -            |
| 合计        | 16,371,164.54 | 1.23         |

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  | 600600 | 青岛啤酒   | 58,800    | 5,821,200.00 | 0.44         |
| 1  | 00168  | 青岛啤酒股份 | 46,000    | 2,745,500.80 | 0.21         |
| 2  | 02238  | 广汽集团   | 808,000   | 5,080,173.95 | 0.38         |
| 2  | 601238 | 广汽集团   | 160,100   | 2,431,919.00 | 0.18         |
| 3  | 600036 | 招商银行   | 142,700   | 6,950,917.00 | 0.52         |
| 4  | 000776 | 广发证券   | 277,100   | 6,813,889.00 | 0.51         |
| 5  | 300059 | 东方财富   | 180,160   | 6,685,737.60 | 0.50         |
| 6  | 601658 | 邮储银行   | 1,253,700 | 6,393,870.00 | 0.48         |
| 7  | 600030 | 中信证券   | 241,200   | 6,370,092.00 | 0.48         |
| 8  | 000333 | 美的集团   | 85,000    | 6,273,850.00 | 0.47         |
| 9  | 600885 | 宏发股份   | 82,900    | 6,187,656.00 | 0.46         |
| 10 | 603501 | 韦尔股份   | 19,000    | 5,904,630.00 | 0.44         |

#### 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      | 110,055,500.00   | 8.27         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 161,858,000.00   | 12.16        |
|    | 其中：政策性金融债 | 60,662,000.00    | 4.56         |
| 4  | 企业债券      | 334,729,500.00   | 25.14        |
| 5  | 企业短期融资券   | 55,053,500.00    | 4.14         |
| 6  | 中期票据      | 227,051,500.00   | 17.06        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 89,767,581.88    | 6.74         |
| 8  | 同业存单      | 97,260,000.00    | 7.31         |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,075,775,581.88 | 80.81        |

#### 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  | 019658    | 21 国债 10      | 690,000 | 68,896,500.00 | 5.18         |
| 2  | 2128042   | 21 兴业银行二级 02  | 500,000 | 50,495,000.00 | 3.79         |
| 3  | 112110428 | 21 兴业银行 CD428 | 500,000 | 48,695,000.00 | 3.66         |
| 4  | 112188237 | 21 汉口银行 CD123 | 500,000 | 48,565,000.00 | 3.65         |
| 5  | 1980400   | 19 陕煤债 02     | 200,000 | 20,188,000.00 | 1.52         |
| 5  | 139437    | 19 陕煤 Y2      | 200,000 | 20,180,000.00 | 1.52         |

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

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称     | 持仓量<br>(买/卖) | 合约市值(元)       | 公允价值变动<br>(元) | 风险说明        |
|-------------------|--------|--------------|---------------|---------------|-------------|
| IF2201            | IF2201 | 26           | 38,589,720.00 | -7,909.41     | -           |
| IC2201            | IC2201 | 25           | 36,889,000.00 | -24,000.00    | -           |
| 公允价值变动总额合计(元)     |        |              |               |               | -31,909.41  |
| 股指期货投资本期收益(元)     |        |              |               |               | -483,613.89 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |        |              |               |               | -34,729.41  |

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

## 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，兴业银行股份有限公司、汉口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或其派出机构的处罚。兴业银行股份有限公司、汉口银行股份有限公司、国家开发银行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或其派出机构的处罚。兴业银行股份有限公司、汉口银行股份有限公司、国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局或其派出机构的处罚。兴业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间市场交易商协会的处罚。

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   | 9,976,911.83  |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,625,528.25  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 10,613,668.99 |
| 5  | 应收申购款   | 11.99         |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 22,216,121.06 |

### 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  | 110067 | 华安转债 | 35,465,308.20 | 2.66         |
| 2  | 110073 | 国投转债 | 26,854,030.80 | 2.02         |
| 3  | 113043 | 财通转债 | 9,174,924.80  | 0.69         |
| 4  | 127017 | 万青转债 | 4,664,195.10  | 0.35         |
| 5  | 128081 | 海亮转债 | 4,067,650.16  | 0.31         |
| 6  | 127018 | 本钢转债 | 2,284,226.10  | 0.17         |
| 7  | 110079 | 杭银转债 | 1,944,069.40  | 0.15         |
| 8  | 128134 | 鸿路转债 | 1,878,372.30  | 0.14         |
| 9  | 127022 | 恒逸转债 | 1,096,379.02  | 0.08         |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 10 | 113542 | 好客转债 | 495,455.40 | 0.04 |
|----|--------|------|------------|------|

### 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                        | 鹏扬景润一年混合 A       | 鹏扬景润一年混合 C    |
|---------------------------|------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,250,000,034.08 | 61,625,748.47 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 201,509.97       | 47,266.65     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | -                | -             |
| 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               | 1,250,201,544.05 | 61,673,015.12 |

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

|                          | 鹏扬景润一年混合 A | 鹏扬景润一年混合 C |
|--------------------------|------------|------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 996,060.32 | -          |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -          | -          |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -          | -          |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 996,060.32 | -          |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.08       | -          |

### 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润一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬景润一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬景润一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
6. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

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

鹏扬基金管理有限公司

2022 年 1 月 22 日