

鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金

2023 年第 3 季度报告

2023 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 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 2023 年 7 月 1 日起至 2023 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | | |
|-------------|---|--------------|
| 基金简称 | 鹏扬数字经济先锋混合 | |
| 基金主代码 | 012456 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 9 月 7 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 774,442,162.52 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，优选数字经济主题相关的股票进行重点投资，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、可转债/可交换债投资策略。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*60%+恒生指数收益率*20%+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。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 鹏扬数字经济先锋混合 A | 鹏扬数字经济先锋混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012456 | 012457 |

| | | |
|-----------------|------------------|------------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 644,470,926.06 份 | 129,971,236.46 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 (2023 年 7 月 1 日—2023 年 9 月 30 日) | |
|-----------------|--------------------------------------|---------------|
| | 鹏扬数字经济先锋混合 A | 鹏扬数字经济先锋混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -10,009,375.49 | -2,107,314.52 |
| 2. 本期利润 | -47,812,630.46 | -9,440,255.89 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0719 | -0.0715 |
| 4. 期末基金资产净值 | 346,392,977.30 | 68,713,334.21 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.5375 | 0.5287 |

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额, 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

鹏扬数字经济先锋混合 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 | -11.67% | 1.24% | -3.35% | 0.77% | -8.32% | 0.47% |
| 过去六个月 | -15.27% | 1.15% | -7.40% | 0.73% | -7.87% | 0.42% |
| 过去一年 | -25.76% | 1.16% | -0.04% | 0.87% | -25.72% | 0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | -46.25% | 1.36% | -20.17% | 0.92% | -26.08% | 0.44% |

鹏扬数字经济先锋混合 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 | -11.85% | 1.24% | -3.35% | 0.77% | -8.50% | 0.47% |
| 过去六个月 | -15.62% | 1.15% | -7.40% | 0.73% | -8.22% | 0.42% |
| 过去一年 | -26.34% | 1.16% | -0.04% | 0.87% | -26.30% | 0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | -47.13% | 1.36% | -20.17% | 0.92% | -26.96% | 0.44% |

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9月7日至2023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
(2021年9月7日至2023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 | | |
| 赵世宏 | 本基金基金经理, 股票投资部总经理 | 2021年9月7日 | - | 12 | 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 |

| | | | | |
|-----|-----------------------|-----------------|---|---|
| | | | | <p>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 2023 年 7 月 3 日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 2022 年 7 月 13 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 10 日至 2023 年 7 月 11 日任鹏扬景科混合型证券投资基金基金经理；2021 年 9 月 7 日至今任鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金基金经理；2021 年 12 月 21 日至今任鹏扬竞争力先锋一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2022 年 3 月 25 日至今任鹏扬丰融价值先锋一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2023 年 7 月 4 日至今任鹏扬景瑞三年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p> |
| 施红俊 | 本基金经理,数量投资部总经理兼指数投资总监 | 2023 年 8 月 17 日 | - | <p>18</p> <p>同济大学管理学博士。曾任大公国际资信评估有限公司上海分公司中小企业评级部部门经理,中证指数有限公司研究员、固定收益主管、研究开发部副总监。现任鹏扬基金管理有限公司数量投资部总经理兼指数投资总监。2019 年 8 月 29 日至 2022 年 11 月 8 日任鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金经理；2020 年 6 月 9 日至今任鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金经理；2021 年 5 月 25 日至今任鹏扬沪深 300 质量成长低波动指数证券</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>投资基金基金经理；2021 年 7 月 16 日至 2022 年 11 月 30 日任鹏扬中证科创创业 50 指数证券投资基金基金经理；2021 年 8 月 4 日至今任鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 12 月 22 日至今任鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 4 月 27 日至 2023 年 8 月 17 日任鹏扬中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理；2022 年 9 月 26 日至今任鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；2022 年 10 月 26 日至今任鹏扬中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 11 月 9 日至今任鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2022 年 12 月 1 日至今任鹏扬中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2023 年 4 月 25 日至今任鹏扬北证 50 成份指数证券投资基金基金经理；2023 年 5 月 19 日至今任鹏扬中债-30 年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 6 月 29 日至今任鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 8 月 17 日至今任鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金基金经理；2023 年 8 月</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------|
| | | | | | 25 日至今任鹏扬中证国有企业红利交易型开放式指数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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现涉及本基金的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的 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年 3 季度，全球经济动能延续较强的韧性，伴随着通胀的逐步下行，全球宏观风险进一步回落。强劲的数据增强了美国经济“软着陆”的叙事，市场也因此重估中性利率，驱动长端美债利率显著提升。在沙特和俄罗斯共同减产的催化下，原油供需缺口开始浮现，油价在 3 季度出现了大幅上涨，引发市场对二次通胀风险的担忧。美联储 3 季度加息 25bp，最新议息会议进一步淡化明年的降息指引。

2023 年 3 季度，在 7 月份政治局会议定调下，国内货币政策加码、财政政策重新发力、产业政

策保持积极，并且围绕着“活跃资本市场”、“一揽子化债”以及“房地产市场供求关系发生重大变化”出台了一系列政策，国内经济动能企稳。在上述政策与经济背景下，内需方面，消费、投资均有所企稳，基建继续发挥经济稳定器的作用，制造业投资在重大项目推动下保持韧性，居民资产负债表修复则支撑消费企稳好转，服务消费保持高增长、耐用品消费保持正增长，房地产依然对经济形成拖累；外需方面，海外需求阶段性触底、价格拖累缓解叠加去年低基数，出口同比增速出现触底回升的迹象。通货膨胀方面，3 季度国内 CPI 同比整体有所回升、PPI 同比触底回升，服务价格在出行旺季有所上行，上游资源品价格在供给扰动、海外需求上升、人民币贬值的影响下明显上涨，下游商品价格逐步企稳，总体而言目前通胀压力较小。随着居民收入改善以及资产负债表修复，核心 CPI 有望低位震荡回升，但耐用品价格低迷将部分对冲服务类价格上行幅度。流动性方面，7 月资金面偏松；进入 8 月，在稳外汇和政府债券发行加速的影响下，资金面转紧，资金利率波动加大。信用扩张方面，政府融资重新发力支撑社融同比增速企稳回升。企业端，整体融资不弱，在政策推动下，中长期贷款持续投放。居民端，与消费相关的短期贷款回升，中长期贷款跟随地产销售低位企稳。不过当前资金活化程度依然较低，随着经济进一步回暖以及库存去化，后续可能会出现改善。

2023 年 3 季度，海外股市整体震荡回调。纳斯达克指数下跌 4.12%，标普 500 指数下跌 3.65%，道琼斯工业指数下跌 2.62%。随着美债利率水平走高，大型科技股出现一定程度的调整，消费和地产股表现低迷。3 季度，国内股市整体呈现震荡回调，在 7 月政治局会议之后整体有所反弹，但进入 8 月之后，在原油价格上行及美国经济数据超预期的推动下，美债以及美元指数持续上行，国内股市持续承压回落。主要宽基指数里，3 季度上证 50 指数上涨 0.6%，沪深 300 下跌 3.98%，中证 500 下跌 5.13%，偏成长的创业板指数下跌了 9.53%、上证科创 50 指数下跌了 11.67%、中证科创创业 50 指数下跌 10.21%。成长板块受损于当前美债利率的高中枢，及市场风险偏好的下行，目前历史估值分位数已低于四分之一分位数，长期看具备较好性价比。从行业板块来看，3 季度表现较好的主要是受益于能源价格上涨的煤炭、石油石化等板块，以及受益活跃资本市场的非银金融板块；表现较弱的则是受美债利率上行压制的传媒、通信设备等板块。

操作方面，本基金报告期内未对权益整体仓位做明显变动，结构上小幅加仓了港股。选股上，我们认为新技术变革及自主可控将带来长期性的机会，我们重点看好的方向包括数字经济、人工智能、机器人、智能驾驶、半导体、工业母机、信创等，因此我们在中证数字经济指数的基础上，重点配置上述受益于经济复苏、盈利改善或具备中长期前景的优质数字经济类公司。行业上，3 季度本基金加仓了电子、通信、计算机等，主要减仓了机械、电力设备等。截至 3 季度末，本基金相比沪深 300 主要超配电子、计算机、传媒、通信行业。整体看，本基金的持仓目前聚焦在数字经济方向，持仓风格偏成长。在 3 季度成长板块再度较深调整后，我们认为不宜太过悲观，目前的市场整

体估值偏低，国内经济终将恢复向好，且政策上呵护资本市场的意愿较强，市场拐点或在不远处。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬数字经济先锋混合 A 的基金份额净值为 0.5375 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.67%；截至本报告期末鹏扬数字经济先锋混合 C 的基金份额净值为 0.5287 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.85%；同期业绩比较基准收益率为-3.35%。

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 | 374,491,066.97 | 88.66 |
| | 其中：股票 | 374,491,066.97 | 88.66 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 26,422,394.59 | 6.26 |
| | 其中：债券 | 26,422,394.59 | 6.26 |
| | 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 | 20,262,812.51 | 4.80 |
| 8 | 其他资产 | 1,210,921.98 | 0.29 |
| 9 | 合计 | 422,387,196.05 | 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 56,233,687.80 元，占期末基金资产净值的比例为 13.55%。

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 | 184,877,730.67 | 44.54 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和 | 33,563.97 | 0.01 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| | 供应业 | | |
| E | 建筑业 | 9,749,696.17 | 2.35 |
| F | 批发和零售业 | 96,576.80 | 0.02 |
| 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 | 98,874,116.51 | 23.82 |
| J | 金融业 | 5,799,048.00 | 1.40 |
| 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 | 10,753,485.24 | 2.59 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 34,584.35 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 21,185.46 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 8,017,392.00 | 1.93 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 318,257,379.17 | 76.67 |

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 | 9,632,692.46 | 2.32 |
| 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 | 46,600,995.34 | 11.23 |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 56,233,687.80 | 13.55 |

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 | 00728 | 中国电信 | 5,554,000 | 19,978,346.72 | 4.81 |
| 2 | 00700 | 腾讯控股 | 67,500 | 18,966,035.66 | 4.57 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 3 | 688777 | 中控技术 | 366,631 | 17,524,961.80 | 4.22 |
| 4 | 688012 | 中微公司 | 101,902 | 15,341,346.10 | 3.70 |
| 5 | 002555 | 三七互娱 | 569,700 | 12,362,490.00 | 2.98 |
| 6 | 688036 | 传音控股 | 82,500 | 12,023,550.00 | 2.90 |
| 7 | 688072 | 拓荆科技 | 50,430 | 12,012,930.30 | 2.89 |
| 8 | 002920 | 德赛西威 | 80,200 | 11,519,928.00 | 2.78 |
| 9 | 002368 | 太极股份 | 374,700 | 11,465,820.00 | 2.76 |
| 10 | 000938 | 紫光股份 | 476,640 | 11,234,404.80 | 2.71 |

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 | 24,209,921.10 | 5.83 |
| 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） | 2,212,473.49 | 0.53 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 26,422,394.59 | 6.37 |

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 | 019703 | 23 国债 10 | 210,000 | 21,168,632.88 | 5.10 |
| 2 | 019694 | 23 国债 01 | 30,000 | 3,041,288.22 | 0.73 |
| 3 | 113052 | 兴业转债 | 21,440 | 2,212,473.49 | 0.53 |
| 4 | - | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - | - |

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，三七互娱网络科技集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券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 | 155,999.44 |
| 2 | 应收证券清算款 | 365,624.53 |
| 3 | 应收股利 | 636,266.24 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 53,031.77 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,210,921.98 |

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 | 113052 | 兴业转债 | 2,212,473.49 | 0.53 |

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 | 鹏扬数字经济先锋混合 A | 鹏扬数字经济先锋混合 C |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 681,546,035.98 | 133,630,642.46 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,833,043.67 | 11,113,133.76 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 40,908,153.59 | 14,772,539.76 |
| 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 | 644,470,926.06 | 129,971,236.46 |

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数字经济先锋混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬数字经济先锋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

2023 年 10 月 25 日