

# 鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 23 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>17</b>
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45

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	46
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
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	51
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	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	53
<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	54
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	57
<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>58</b>
12.1	备查文件目录	58
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	鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金	
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	
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	666,830,084.59 份	
基金合同存续期	不定期	
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	552,499,052.59 份	114,331,032.00 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，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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏扬基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	宋震
	联系电话	400-968-6688
	电子邮箱	service@pyamc.com
客户服务电话	400-968-6688	400-61-95555
传真	010-68105915	0755-83195201
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 120 号 3 层 302 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址	北京市西城区复兴门外大街 A2 号 西城金茂中心 16 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100045	518040
法定代表人	杨爱斌	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.pyamc.com">http://www.pyamc.com</a>
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 号西城金茂中心 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	鹏扬数字经济先锋混合 A	鹏扬数字经济先锋混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	报告期（2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-11,348,531.37	-2,670,661.41
本期利润	-17,045,637.55	-3,631,553.26
加权平均基金份额本期利润	-0.0296	-0.0304
本期加权平均净值利润率	-6.02%	-6.31%
本期基金份额净值增长率	-5.68%	-6.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 6 月 30 日）	
期末可供分配利润	-287,361,452.46	-60,685,671.80
期末可供分配基金份额利润	-0.5201	-0.5308
期末基金资产净值	265,137,600.13	53,645,360.20
期末基金份额净值	0.4799	0.4692
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 6 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-52.01%	-53.08%

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）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) 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

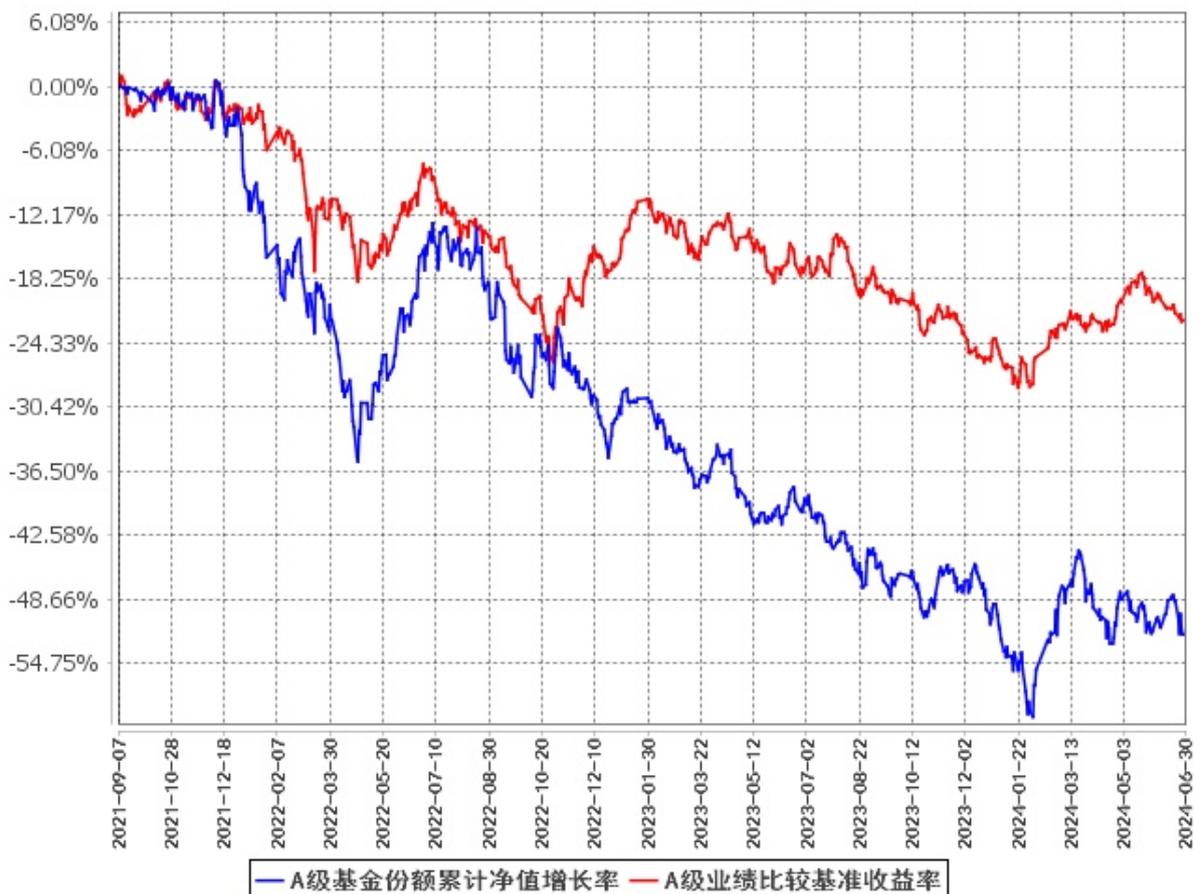
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.19%	1.74%	-2.20%	0.39%	1.01%	1.35%
过去三个月	-7.53%	1.75%	0.53%	0.61%	-8.06%	1.14%
过去六个月	-5.68%	2.16%	2.28%	0.74%	-7.96%	1.42%
过去一年	-21.13%	1.76%	-5.84%	0.73%	-15.29%	1.03%
自基金合同生效起至今	-52.01%	1.52%	-22.22%	0.87%	-29.79%	0.65%

鹏扬数字经济先锋混合 C

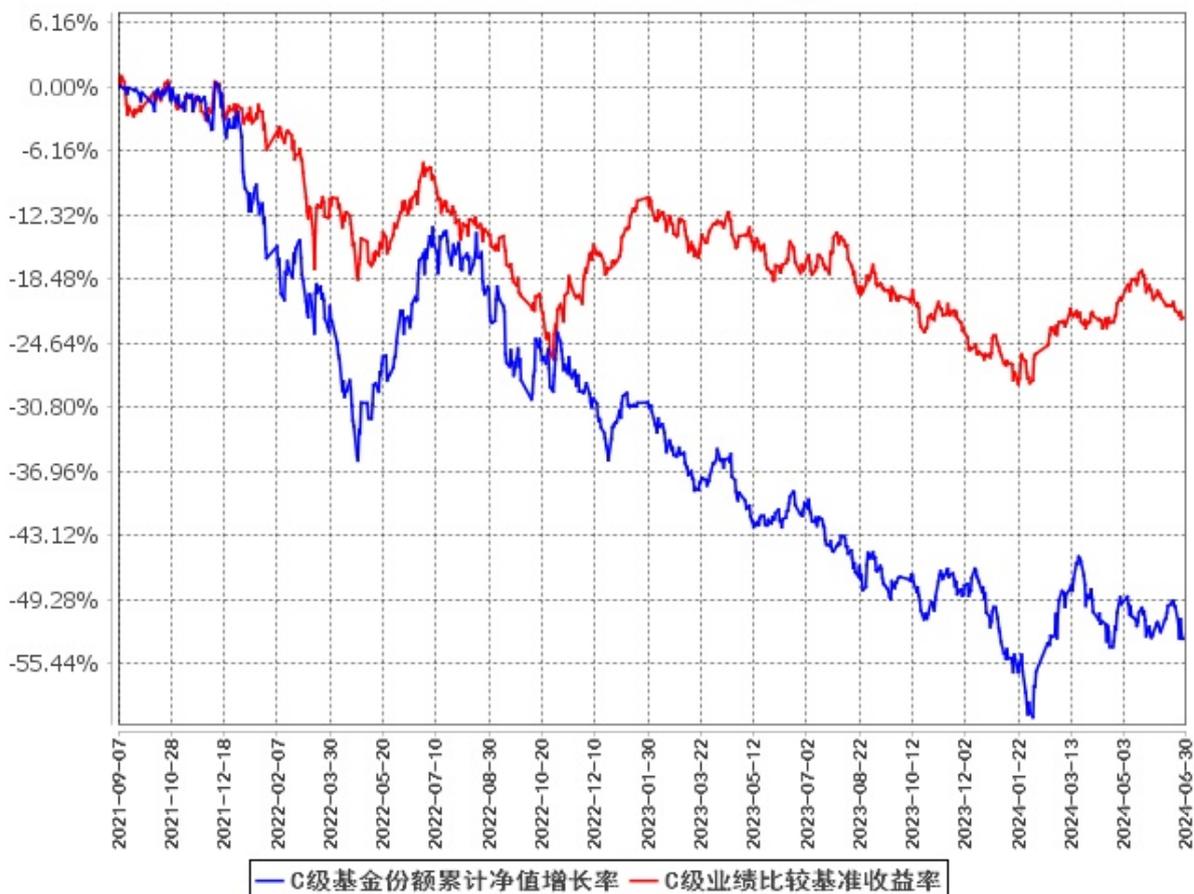
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.26%	1.74%	-2.20%	0.39%	0.94%	1.35%
过去三个月	-7.71%	1.75%	0.53%	0.61%	-8.24%	1.14%
过去六个月	-6.05%	2.16%	2.28%	0.74%	-8.33%	1.42%
过去一年	-21.77%	1.76%	-5.84%	0.73%	-15.93%	1.03%
自基金合同生效起至今	-53.08%	1.52%	-22.22%	0.87%	-30.86%	0.65%

### 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**  
(2021年9月7日至2024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**  
(2021年9月7日至2024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全国性公募基金公司,总部位于北京。截至2024年6月末,公司管理资产总规模1588亿元,非货公募资产总规模1055亿元,累计创造投资收益超202亿元,分红超86亿元。

公司践行高质量发展。在业务布局和人才战略方面,公司形成了固定收益、主动股票、指数量化、多资产四大业务板块,汇聚海内外优秀人才,致力于打造一支将服务投资者作为长期事业的人才队伍。公司核心投资人员均具有10年以上知名金融机构工作经历。公司致力于打造平台化、团队化、一体化的投研体系,实现“宏观、策略、行业、公司”的全维度研究覆盖,为客户提供“全天候”的资产管理解决方案。其中,固收团队持续提升宏观研究与资产配置、利率交易、信用研究、转债增强、国债期货等核心投资能力,力求为投资人获取长期、稳健的收益;股票团队致力于做深

度的个股研究和产业研究，遵循基本面理念严选个股，同时充分保留基金经理自身风格特点，在不同风格策略领域布局权益产品以适应客户的多元化需求；指数量化团队聚焦高质量核心资产，以科学方法深挖面向未来的行业主题和选股因子，努力为投资者提供具有长期良好持有体验的指数产品；多资产团队将基于大数据的定量研究和基于调研访谈的定性研究有机结合，为投资者提供便捷的多策略组合配置方案，有效分散投资风险，助力资产稳健增值。

公司坚持守法合规经营，高度注重风险管理，以金融科技赋能业务。公司严守法律合规的风险底线，在管理上树立全员风险防范意识；在业务流程上实现风险管理对投前、投中、投后的全流程覆盖；在评价方式上以结果为导向检验风险管理成效，杜绝风险事件的发生。公司成立以来对债券信用风险施行严格管控，投资的债券保持零违约。公司自主研发的金融科技成果“神灯智投”顺利通过了证监会资本市场金融科技创新（首批）试点项目评审，并转常态化投产运营，实现研究、投资、交易、风控的一体化，大幅提升资管全流程的运作效率，提升风险管理的有效性。

鹏扬基金作为一家有理想、有担当的公募基金公司，积极履行社会责任，书写“五篇金融大文章”。2024 年上半年，公司在云南省泸水市、陕西省延长县、北京市西城区等多地开展公益行动，覆盖乡村教育、消费助农、居民养老等领域。作为中国基金业协会投教专委会委员单位，公司积极联合各类媒体平台和行业机构力量，开展投资者教育和保护工作，为行业高质量发展建言献策。

鹏扬基金以“为客户创造价值，为美好生活助力”为使命，秉持“客户至上、勇于担当、拥抱变化、合作共赢”的价值观，以“专业稳健，回报信任”作为经营宗旨，专注于长期目标，寻求服务投资者的最佳方案，全力以赴争创一流投资机构，在大资管行业迈向高阶发展的进程中行稳致远。

#### 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, 权 益投资 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权益投资部总经理。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

					<p>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;</p> <p>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;</p> <p>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2024年1月17日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	-	19	<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2024年4月23日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</p>

				<p>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 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；2023 年 12 月 19 日至今任鹏扬消费量化选股混合型证券投资基金基金经理；2024 年 1 月 30 日至今任鹏扬国证财富管理</p>
--	--	--	--	---

					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；2024 年 3 月 19 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联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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 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公司旗下管理的所有投资组合，在本报告期内不同时间窗口下(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，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 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

2024 年上半年，美国财政政策继续保持扩张状态，大型科技公司对 AI 的大规模投资维持了美国经济的韧性。但美国政府债台高筑和利率高企意味着美国宽松财政政策的可持续性面临巨大挑战；AI 的巨额资本投入在应用端暂时没有看到杀手级应用，意味着该资本投入短期可能收效甚微。美联储维持偏高利率水平的可能时间太长，需要通过快速降低利率来避免经济陷入衰退的自我循环。

2024 年上半年，国内经济动能先回升后放缓。政策方面，总量政策强调“固本培元”；房地产政策从“三大工程”转为“放开限购+贷款收储”；货币政策受制于汇率稳定，宽松力度低于预期；财政政策在落实过紧日子要求、推进地方化债等因素影响下，强度低于预期。经济增长方面，出口与制造业投资在外需和政策的带动下保持较高增速，消费和基建投资的动能走弱，房地产销售与投资依然较弱。通货膨胀方面，上游资源品价格维持强势，中游制造和下游消费品价格延续低迷，核心原因是内需偏弱、外需偏强、上游产能受限以及中下游资本开支较大。流动性方面，受到汇率贬值压力的影响，降息预期落空，但资金利率基本保持平稳。信用扩张方面，央行在高质量信贷的目标下挤掉信贷水分，信贷和存款增速下滑；结构上，私人部门融资偏弱，政府部门融资回升。

2024 年上半年，海外股票市场整体保持强势。美国股市受益于人工智能提升大型科技股的盈利预期；印度股市受益于当期盈利高速增长；日本股市受益于汇率贬值以及公司股东回报提升。A 股市场整体表现低迷，市场呈现结构高度分化的特征，期间受政策发力和经济预期修复的驱动出现了超跌反弹的行情。从风格来看，红利和价值风格表现较好。

2024 年上半年，TMT 大板块中电子(申万一级)下跌 9.07%，计算机下跌 24.88%，通信上涨 3.63%，传媒下跌 21.33%。主题方面，上半年表现较好的细分概念是光模块、AI 芯片、消费电子等。受益于海外需求的板块表现更好，反之，与经济相关度高的环节，譬如受累于需求疲软、政企采购减少等因素的行业应用软件板块，年内跌幅已接近 30%。上半年我们还可以看到一些积极变化，一是以存储芯片为代表的电子产品价格有回升；二是半导体、消费电子等细分板块的 1 季报业绩整体可见回升，对中报的预期也开始走强。

操作方面，本基金本报告期内未对权益整体仓位做明显变动。行业配置方面，目前组合整体配置以电子、计算机、互联网板块为主。选股上，组合结合基本面研究和量化模型结果，重点配置了受益于产业趋势和经济复苏、盈利改善或具备中长期前景的优质数字经济类公司。具体操作上，1 月份市场大跌时，增配了通信与电子，并在 3 月份对持仓中浮盈较多的光模块做了止盈，同时加仓了年内跌幅相对较深的计算机和电子。4 月份增配了公司季报数据相对较好的电子行业，并在 5 月止盈了部分持仓。逢市场调整小幅加仓了通信板块。目前，组合权重行业依次为计算机、电子、通

信。总体上看，本基金的持仓聚焦在受益于人工智能产业趋势的方向，持仓风格偏成长。我们认为国内经济终将恢复向好，政策呵护资本市场的意愿较强。目前市场整体估值偏低，计算机板块明显跑输市场，电子板块年内也有明显跌幅，内在修复动能较强，同时海外市场存在降息预期，因此我们看好下半年数字经济板块的主题性机会。

#### 4.4.2 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 0.4799 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.68%；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 0.4692 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.05%；同期业绩比较基准收益率为 2.28%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，我们预计美国消费支出放缓、就业市场降温，美债利率中枢进一步回落。美国经济动能将放缓，但经济硬着陆的条件暂不具备，核心原因是居民部门资产负债表健康、利率操作空间较大以及美股泡沫化程度不够极致。

展望 2024 年下半年，国内政策方面，三中全会明确了政策主线是安全发展和培育经济新动能，财政和信贷资源向制造业和新质生产力倾斜，需求侧政策保持“固本培元”的思路。若下半年出现风险事件，货币、财政和房地产政策均有调整空间。中期最重要的是观察政策范式的转变何时到来，包括大幅度降息、财政资金参与收储商品房以及控制部分行业的产能扩张。经济增长方面，在政策范式转变前，国内经济动能总体承压，但也有局部亮点。2024 年以来工业生产与出口旺盛，预计出口将保持较高水平，但贸易摩擦风险将加大。居民部门资产负债表受损，低迷的新房需求对房企流动性形成压力，商品房收储在实践中仍有阻力，居民消费下滑压力有所加大。企业部门实际投资回报率较低，叠加地缘政治的不确定性，企业逆周期增加资本开支的意愿将减弱。政策部门的税收和土地收入下滑，政府隐性债务扩张受到严格监管，因此政府支出压力较大，但政府发行专项债和国债的空间较大。在高质量信贷政策倾向之下，金融部门总体处于紧信用状态。通货膨胀方面，考虑到制造业产能和劳动力供给充足、私人部门需求承压以及需求侧政策力度有限，通胀中枢大概率将保持偏低位置。

展望 2024 年下半年权益市场，预计市场结构表现继续分化。2023 年以来，数字经济板块内的行情主要集中在 AI 产业链，不同细分板块收益分化严重。后续我们看好在基本面和预期的驱动下行情走向扩散，我们也会持续关注低位板块的机会。

#### 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》、《资产

管理产品相关会计处理规定》、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、风险管理部、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历。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。定价服务机构按照协议约定提供定价服务。

#### 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

托管人声明：

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

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	5,814,961.50	9,056,583.17
结算备付金		2,851,371.87	1,500,225.28
存出保证金		177,060.96	121,596.71
交易性金融资产	6.4.7.2	320,651,144.32	366,089,606.39
其中：股票投资		299,402,693.80	343,924,949.40
基金投资		-	-
债券投资		21,248,450.52	22,164,656.99
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		5,943.76	13,679,331.81
应收股利		-	-
应收申购款		22,255.75	68,848.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		329,522,738.16	390,516,192.25
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		8,590,000.00	7,499,060.77
应付清算款		672,252.85	14,440,399.48

应付赎回款		188,365.82	361,589.19
应付管理人报酬		328,273.22	389,056.72
应付托管费		54,712.23	64,842.78
应付销售服务费		37,229.15	43,187.36
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.07	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	868,942.49	700,651.76
负债合计		10,739,777.83	23,498,788.06
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	666,830,084.59	723,654,036.89
未分配利润	6.4.7.8	-348,047,124.26	-356,636,632.70
净资产合计		318,782,960.33	367,017,404.19
负债和净资产总计		329,522,738.16	390,516,192.25

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 666,830,084.59 份，其中鹏扬数字经济先锋混合 A 基金份额净值 0.4799 元，基金份额总额 552,499,052.59 份；鹏扬数字经济先锋混合 C 基金份额净值 0.4692 元，基金份额总额 114,331,032.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-17,871,949.62	-60,416,025.06
1. 利息收入		46,741.09	148,146.99
其中：存款利息收入	6.4.7.9	44,055.36	89,024.43
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,685.73	59,122.56
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,276,671.78	-68,943,796.73
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-12,941,178.74	-72,136,736.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	208,434.89	164,797.00

资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,456,072.07	3,028,142.36
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-6,657,998.03	8,330,006.50
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	15,979.10	49,618.18
<b>减：二、营业总支出</b>		2,805,241.19	5,365,074.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,028,573.24	4,103,636.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	338,095.59	683,939.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	228,513.96	336,231.57
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		106,425.59	119,184.62
其中：卖出回购金融资产支出		106,425.59	119,184.62
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		9.67	234.24
8. 其他费用	6.4.7.19	103,623.14	121,848.73
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-20,677,190.81	-65,781,099.83
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-20,677,190.81	-65,781,099.83
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-20,677,190.81	-65,781,099.83

### 6.3 净资产变动表

会计主体：鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	723,654,036.89	-	-356,636,632.70	367,017,404.19
二、本期期初净资产	723,654,036.89	-	-356,636,632.70	367,017,404.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-56,823,952.30	-	8,589,508.44	-48,234,443.86
（一）、综合收益总额	-	-	-20,677,190.81	-20,677,190.81
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-56,823,952.30	-	29,266,699.25	-27,557,253.05
其中：1. 基金申购款	24,690,177.07	-	-12,678,519.20	12,011,657.87
2. 基金赎回款	-81,514,129.37	-	41,945,218.45	-39,568,910.92
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	666,830,084.59	-	-348,047,124.26	318,782,960.33
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	888,806,778.63	-	-281,407,148.22	607,399,630.41
二、本期期初净资产	888,806,778.63	-	-281,407,148.22	607,399,630.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-73,630,100.19	-	-38,879,314.91	-112,509,415.10
（一）、综合收益总额	-	-	-65,781,099.83	-65,781,099.83
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-73,630,100.19	-	26,901,784.92	-46,728,315.27
其中：1. 基金申购款	83,561,987.00	-	-29,920,947.28	53,641,039.72

2. 基金赎回款	-157,192,087.19	-	56,822,732.20	-100,369,354.99
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	815,176,678.44	-	-320,286,463.13	494,890,215.31

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

鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2021]1601号《关于准予鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由鹏扬基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金基金合同”)于2021年8月23日至2021年9月3日向社会公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集的有效净认购金额为人民币1,036,280,331.36元,有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币212,659.59元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2021)验字第61290365\_A17号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,本基金基金合同于2021年9月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,036,492,990.95份基金份额,其中认购资金利息折合212,659.59份基金份额。本基金的基金管理人为鹏扬基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定,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、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投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、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)、国债期货、股指期货、

股票期权、货币市场工具、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、资产支持证券、债券回购、信用衍生品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。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务。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。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 60% - 95%(其中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%),投资于本基金界定的数字经济主题相关股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、本基金基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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资产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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、财税[2012]85号《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》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会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[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利，按照上述规定计算纳税，持股时

间自解禁日起计算；解禁前取得的股息红利继续暂减按 50% 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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	5,814,961.50
等于：本金	5,814,336.16
加：应计利息	625.34
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	5,814,961.50

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	325,184,183.06	-	299,402,693.80	-25,781,489.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	150,724.12	21,248,450.52	161,117.40
	银行间市场	-	-	-
	合计	20,936,609.00	150,724.12	21,248,450.52
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	346,120,792.06	150,724.12	320,651,144.32	-25,620,371.86

### 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

无。

### 6.4.7.5 其他资产

无。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10.31
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	781,910.70
其中：交易所市场	781,910.70
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	87,021.48

合计	868,942.49
----	------------

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

鹏扬数字经济先锋混合 A		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	600,094,543.04	600,094,543.04
本期申购	5,250,463.67	5,250,463.67
本期赎回(以“-”号填列)	-52,845,954.12	-52,845,954.12
本期末	552,499,052.59	552,499,052.59

金额单位：人民币元

鹏扬数字经济先锋混合 C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	123,559,493.85	123,559,493.85
本期申购	19,439,713.40	19,439,713.40
本期赎回(以“-”号填列)	-28,668,175.25	-28,668,175.25
本期末	114,331,032.00	114,331,032.00

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。

### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

鹏扬数字经济先锋混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-285,115,374.06	-9,670,403.71	-294,785,777.77
本期期初	-285,115,374.06	-9,670,403.71	-294,785,777.77
本期利润	-11,348,531.37	-5,697,106.18	-17,045,637.55
本期基金份额交易产生的变动数	23,303,805.25	1,166,157.61	24,469,962.86
其中：基金申购款	-2,580,735.79	-83,761.84	-2,664,497.63
基金赎回款	25,884,541.04	1,249,919.45	27,134,460.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-273,160,100.18	-14,201,352.28	-287,361,452.46

单位：人民币元

鹏扬数字经济先锋混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-59,849,787.17	-2,001,067.76	-61,850,854.93
本期期初	-59,849,787.17	-2,001,067.76	-61,850,854.93
本期利润	-2,670,661.41	-960,891.85	-3,631,553.26
本期基金份额交易产生的变动数	4,759,082.04	37,654.35	4,796,736.39
其中：基金申购款	-9,639,058.00	-374,963.57	-10,014,021.57
基金赎回款	14,398,140.04	412,617.92	14,810,757.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-57,761,366.54	-2,924,305.26	-60,685,671.80

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
活期存款利息收入	17,072.65
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	25,898.53
其他	1,084.18
合计	44,055.36

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,140,657,199.49
减：卖出股票成本总额	1,151,108,847.29
减：交易费用	2,489,530.94
买卖股票差价收入	-12,941,178.74

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	206,492.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	1,942.24
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	208,434.89

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,006,062.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	21,606,212.76
减：应计利息总额	397,907.97
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	1,942.24

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,456,072.07
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	1,456,072.07

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-6,657,998.03
——股票投资	-6,774,261.19
——债券投资	116,263.16
——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	-6,657,998.03

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
基金赎回费收入	15,394.34
基金转出费收入	584.76
合计	15,979.10

#### 6.4.7.18 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
审计费用	27,349.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00

银行费用	6,121.20
港股通证券组合费	1,480.46
合计	103,623.14

#### 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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 2024年1月1日 至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日 至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,028,573.24	4,103,636.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	930,679.65	1,954,558.48
应支付基金管理人的净管理费	1,097,893.59	2,149,077.74

注：（1）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1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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

(2) 根据本基金管理人 2023 年 7 月 29 日发布的《鹏扬基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 31 日起，本基金管理费率由 1.50% 年费率调至 1.20% 年费率。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	338,095.59	683,939.39

注：(1) 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 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

(2) 根据本基金管理人 2023 年 7 月 29 日发布的《鹏扬基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 31 日起，本基金托管费率由 0.25% 年费率调至 0.20% 年费率。

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏扬数字经济先锋混合 A	鹏扬数字经济先锋混合 C	合计
鹏扬基金	-	1,630.87	1,630.87
招商银行	-	103,426.21	103,426.21
合计	-	105,057.08	105,057.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏扬数字经济先锋混合 A	鹏扬数字经济先锋混合 C	合计
鹏扬基金	-	2,417.43	2,417.43
招商银行	-	154,414.90	154,414.90
合计	-	156,832.33	156,832.33

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。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

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 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 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
基金合同生效日（2021 年 9 月 7 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 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 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
基金合同生效日（2021 年 9 月 7 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	118,343.20	-

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	118,343.20	-
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	-	-

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。

（3）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。

#### 6.4.10.5.2 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
招商银行	5,814,961.50	17,072.65	20,158,309.07	57,050.46

#### 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（2024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	受限期	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

301589	诺瓦星云	2024年2月1日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	126.89	188.01	217	27,535.13	40,798.17	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	86.96	174.93	126	10,956.96	22,041.18	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
688709	成都华微	2024年1月31日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	15.69	18.79	645	10,120.05	12,119.55	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	22.66	15.89	528	11,964.48	8,389.92	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	16.20	15.96	513	8,310.60	8,187.48	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024年3月26日	上市后六个月	新股锁定期流	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-

				通受限						
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	
603341	龙旗科技	2024年2月23日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	26.00	37.49	179	4,654.00	6,710.71	
688695	中创股份	2024年3月6日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	
688530	欧莱新材	2024年4月29日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	
301588	美新科技	2024年3月6日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	
301502	华阳智能	2024年1月26日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	
603344	星德胜	2024年3月13日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	
603325	博隆技术	2024年1月3日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	72.46	68.06	60	4,347.60	4,083.60	
001359	平安电工	2024年3月19日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	
603381	永臻股份	2024年6月19日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	23.35	25.13	148	3,455.80	3,719.24	
603312	西典新能	2024年1月4日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	
603082	北自科技	2024年1月23日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	
001379	腾达科技	2024年1月11日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	
603375	盛景微	2024年1月17日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	
603285	键邦股	2024年6月	上市后六个月	新股锁	18.65	18.65	129	2,405.8	2,405.8	

	份	28 日	月	定期流 通受限				5	5	
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	上市后六个 月	新股锁 定期流 通受限	20.56	20.56	106	2,179.3 6	2,179.3 6	
001387	雪祺电 气	2024 年 1 月 4 日	上市后六个 月	新股锁 定期流 通受限	15.38	15.25	133	2,045.5 4	2,028.2 5	
603285	键邦股 份	2024 年 6 月 28 日	5 个交易日	新股未 上市流 通受限	18.65	18.65	1,158	21,596. 70	21,596. 70	
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	5 个交易日	新股未 上市流 通受限	20.56	20.56	945	19,429. 20	19,429. 20	
301589	诺瓦星 云	-	上市后六个 月	锁定期 送/转股	-	188.01	173	-	32,525. 73	
301538	骏鼎达	-	上市后六个 月	锁定期 送/转股	-	91.24	43	-	3,923.3 2	
001387	雪祺电 气	-	上市后六个 月	锁定期 送/转股	-	15.25	40	-	610.00	

#### 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

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 8,590,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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收的合规风险、操作风险等风险进行管理。从风险监控层面，公司督察长、风险管理人員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內。

### 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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	18,928,263.65	19,979,686.03
合计	18,928,263.65	19,979,686.03

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）未评级债券包括国债、政策性金融债、央票、地方政府债、短期融资券、公司债等。

（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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	2,320,186.87	2,184,970.96
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	2,320,186.87	2,184,970.96

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）未评级债券包括国债、政策性金融债、央票、地方政府债、中期票据、公司债等。

（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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,814,961.50	-	-	-	5,814,961.50
结算备付金	2,851,371.87	-	-	-	2,851,371.87
存出保证金	177,060.96	-	-	-	177,060.96
交易性金融资产	18,928,263.65	2,320,186.87	-	299,402,693.80	320,651,144.32
应收清算款	-	-	-	5,943.76	5,943.76
应收申购款	-	-	-	22,255.75	22,255.75
资产总计	27,771,657.98	2,320,186.87	-	299,430,893.31	329,522,738.16
负债					
卖出回购金融资产款	8,590,000.00	-	-	-	8,590,000.00
应付清算款	-	-	-	672,252.85	672,252.85
应付赎回款	-	-	-	188,365.82	188,365.82
应付管理人报酬	-	-	-	328,273.22	328,273.22
应付托管费	-	-	-	54,712.23	54,712.23
应付销售服务费	-	-	-	37,229.15	37,229.15
应交税费	-	-	-	2.07	2.07
其他负债	-	-	-	868,942.49	868,942.49
负债总计	8,590,000.00	-	-	2,149,777.83	10,739,777.83
利率敏感度缺口	19,181,657.98	2,320,186.87	-	297,281,115.48	318,782,960.33
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,056,583.17	-	-	-	9,056,583.17
结算备付金	1,500,225.28	-	-	-	1,500,225.28
存出保证金	121,596.71	-	-	-	121,596.71
交易性金融资产	19,979,686.03	2,184,970.96	-	343,924,949.40	366,089,606.39
应收清算款	-	-	-	13,679,331.81	13,679,331.81
应收申购款	-	-	-	68,848.89	68,848.89
资产总计	30,658,091.19	2,184,970.96	-	357,673,130.10	390,516,192.25
负债					
卖出回购金融资产款	7,499,060.77	-	-	-	7,499,060.77
应付清算款	-	-	-	14,440,399.48	14,440,399.48

应付赎回款	-	-	-	361,589.19	361,589.19
应付管理人报酬	-	-	-	389,056.72	389,056.72
应付托管费	-	-	-	64,842.78	64,842.78
应付销售服务费	-	-	-	43,187.36	43,187.36
其他负债	-	-	-	700,651.76	700,651.76
负债总计	7,499,060.77	-	-	15,999,727.29	23,498,788.06
利率敏感度缺口	23,159,030.42	2,184,970.96	-	341,673,402.81	367,017,404.19

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早进行分类。

#### 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-31,027.74	-15,409.64
	市场利率下降 25 个基点	31,134.58	15,433.79

#### 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 2024 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	-	16,489,495.43	-	16,489,495.43
资产合计	-	16,489,495.43	-	16,489,495.43
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	-	16,489,495.43	-	16,489,495.43
项目	上年度末 2023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	-	47,731,568.00	-	47,731,568.00
资产合计	-	47,731,568.00	-	47,731,568.00
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	-	47,731,568.00	-	47,731,568.00

#### 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	港币相对人民币升值 5%	824,474.77	2,386,578.40
	港币相对人民币贬值 5%	-824,474.77	-2,386,578.40

#### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	299,402,693.80	93.92	343,924,949.40	93.71
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	299,402,693.80	93.92	343,924,949.40	93.71

#### 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场基准上升 5%	21,184,049.69	16,446,093.62
	市场基准下降 5%	-21,184,049.69	-16,446,093.62

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 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	301,377,854.19	345,065,754.25
第二层次	18,973,874.76	19,979,686.03
第三层次	299,415.37	1,044,166.11
合计	320,651,144.32	366,089,606.39

### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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，其账面价值与公允价值相差很小。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	299,402,693.80	90.86
	其中：股票	299,402,693.80	90.86

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,248,450.52	6.45
	其中：债券	21,248,450.52	6.45
	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	8,666,333.37	2.63
8	其他各项资产	205,260.47	0.06
9	合计	329,522,738.16	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 16,489,495.43 元，占期末基金资产净值的比例为 5.17%。

## 7.2 报告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

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	143,084,632.08	44.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	133,795,408.81	41.97
J	金融业	6,024,970.00	1.89
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,187.48	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	282,913,198.37	88.75

### 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	16,375,897.80	5.14
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	79,609.43	0.02
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	33,988.20	0.01
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	16,489,495.43	5.17

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	169,543	23,376,588.84	7.33
2	300394	天孚通信	224,240	19,827,300.80	6.22
3	300624	万兴科技	371,800	19,731,426.00	6.19
4	688041	海光信息	277,900	19,541,928.00	6.13
5	688111	金山办公	83,203	18,928,682.50	5.94
6	03690	美团-W	161,500	16,375,897.80	5.14
7	002230	科大讯飞	362,600	15,573,670.00	4.89
8	688256	寒武纪	77,291	15,355,402.97	4.82
9	688072	拓荆科技	124,287	14,928,111.57	4.68
10	300604	长川科技	480,100	13,044,317.00	4.09
11	688012	中微公司	91,903	12,982,217.78	4.07
12	603383	顶点软件	396,300	12,709,341.00	3.99
13	688095	福昕软件	276,729	12,676,955.49	3.98
14	300559	佳发教育	1,259,500	12,053,415.00	3.78
15	688037	芯源微	134,934	12,009,126.00	3.77
16	688120	华海清科	55,838	10,585,768.04	3.32
17	301236	软通动力	256,700	9,038,407.00	2.84
18	688008	澜起科技	116,500	6,659,140.00	2.09
19	600845	宝信软件	198,680	6,343,852.40	1.99
20	300418	昆仑万维	190,200	6,132,048.00	1.92
21	300033	同花顺	58,100	6,024,970.00	1.89
22	603986	兆易创新	57,700	5,517,274.00	1.73

23	300496	中科创达	114,100	5,201,819.00	1.63
24	688017	绿的谐波	39,663	3,256,332.30	1.02
25	688361	中科飞测	20,000	946,000.00	0.30
26	301589	诺瓦星云	390	73,323.90	0.02
27	09877	健世科技-B	12,400	45,155.76	0.01
28	09926	康方生物	1,000	34,453.67	0.01
29	00700	腾讯控股	100	33,988.20	0.01
30	002371	北方华创	100	31,989.00	0.01
31	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
32	688692	达梦数据	126	22,041.18	0.01
33	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
34	300502	新易盛	200	21,110.00	0.01
35	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
36	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
37	300054	鼎龙股份	600	13,608.00	0.00
38	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
39	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
40	688552	航天南湖	782	12,668.40	0.00
41	688709	成都华微	645	12,119.55	0.00
42	600941	中国移动	100	10,750.00	0.00
43	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
44	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
45	300236	上海新阳	300	9,342.00	0.00
46	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
47	688584	上海合晶	528	8,389.92	0.00
48	601033	永兴股份	513	8,187.48	0.00
49	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
50	002475	立讯精密	200	7,862.00	0.00
51	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
52	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
53	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
54	603341	龙旗科技	179	6,710.71	0.00
55	603650	彤程新材	200	5,910.00	0.00
56	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
57	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
58	601138	工业富联	200	5,480.00	0.00
59	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
60	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
61	688268	华特气体	80	4,128.80	0.00
62	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
63	603325	博隆技术	60	4,083.60	0.00
64	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
65	603381	永臻股份	148	3,719.24	0.00

66	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
67	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
68	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
69	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
70	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
71	601728	中国电信	200	1,230.00	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	002920	德赛西威	38,939,736.35	10.61
2	300624	万兴科技	29,225,359.92	7.96
3	002241	歌尔股份	26,806,324.50	7.30
4	300394	天孚通信	26,564,842.00	7.24
5	688041	海光信息	25,600,642.49	6.98
6	688008	澜起科技	25,098,993.60	6.84
7	300782	卓胜微	24,070,830.20	6.56
8	002475	立讯精密	23,882,971.00	6.51
9	601138	工业富联	23,348,844.00	6.36
10	300559	佳发教育	22,482,455.94	6.13
11	688095	福昕软件	22,124,615.89	6.03
12	300308	中际旭创	21,836,387.04	5.95
13	300454	深信服	20,930,224.00	5.70
14	688256	寒武纪	19,821,915.97	5.40
15	688111	金山办公	19,452,851.73	5.30
16	03690	美团-W	19,171,509.88	5.22
17	300604	长川科技	17,981,752.00	4.90
18	600845	宝信软件	17,958,203.00	4.89
19	09926	康方生物	17,416,618.83	4.75
20	600895	张江高科	17,122,328.78	4.67
21	000034	神州数码	17,103,841.69	4.66
22	688072	拓荆科技	16,872,034.38	4.60
23	300033	同花顺	16,478,219.30	4.49
24	300496	中科创达	16,072,611.00	4.38
25	002153	石基信息	15,743,201.70	4.29
26	002368	太极股份	15,731,926.76	4.29
27	688012	中微公司	15,458,557.02	4.21
28	002230	科大讯飞	15,155,362.00	4.13
29	09868	小鹏汽车-W	14,850,890.31	4.05

30	688502	茂莱光学	14,570,667.06	3.97
31	300115	长盈精密	14,003,430.70	3.82
32	688025	杰普特	13,915,606.59	3.79
33	603383	顶点软件	13,740,862.80	3.74
34	600941	中国移动	13,616,446.00	3.71
35	300045	华力创通	13,351,906.00	3.64
36	301236	软通动力	13,346,203.00	3.64
37	688017	绿的谐波	13,045,761.57	3.55
38	688037	芯源微	12,807,832.09	3.49
39	300687	赛意信息	11,013,998.00	3.00
40	300430	诚益通	10,424,100.00	2.84
41	688496	清越科技	10,210,499.62	2.78
42	301153	中科江南	9,637,589.68	2.63
43	688120	华海清科	9,561,602.28	2.61
44	300418	昆仑万维	9,385,869.00	2.56
45	002432	九安医疗	9,038,303.00	2.46
46	600498	烽火通信	8,914,112.00	2.43
47	300054	鼎龙股份	8,655,613.00	2.36
48	688382	益方生物	7,991,389.23	2.18
49	688378	奥来德	7,781,254.44	2.12
50	600536	中国软件	7,732,120.80	2.11
51	603501	韦尔股份	7,396,162.05	2.02

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	002920	德赛西威	44,109,717.37	12.02
2	002475	立讯精密	38,272,488.10	10.43
3	300782	卓胜微	33,189,301.07	9.04
4	300394	天孚通信	31,726,777.52	8.64
5	300502	新易盛	31,535,135.77	8.59
6	300308	中际旭创	29,896,878.86	8.15
7	601138	工业富联	29,015,507.00	7.91
8	688008	澜起科技	26,646,088.92	7.26
9	603501	韦尔股份	26,394,787.15	7.19
10	002241	歌尔股份	26,087,813.00	7.11
11	09926	康方生物	22,734,714.13	6.19
12	300624	万兴科技	21,762,173.00	5.93
13	03690	美团-W	21,416,220.53	5.84
14	300454	深信服	19,075,677.80	5.20

15	002368	太极股份	18,917,274.13	5.15
16	00700	腾讯控股	17,705,613.94	4.82
17	600895	张江高科	16,851,928.30	4.59
18	000034	神州数码	16,737,372.00	4.56
19	002153	石基信息	15,005,412.20	4.09
20	300687	赛意信息	14,468,749.50	3.94
21	300045	华力创通	14,118,749.00	3.85
22	300033	同花顺	14,087,355.00	3.84
23	09868	小鹏汽车-W	13,697,955.37	3.73
24	600941	中国移动	13,528,991.00	3.69
25	300115	长盈精密	13,340,246.39	3.63
26	688095	福昕软件	13,212,191.50	3.60
27	688041	海光信息	13,144,225.20	3.58
28	002463	沪电股份	12,881,315.00	3.51
29	688111	金山办公	12,516,188.90	3.41
30	600536	中国软件	12,507,418.31	3.41
31	688025	杰普特	12,220,862.75	3.33
32	688777	中控技术	12,216,637.66	3.33
33	688502	茂莱光学	11,739,376.09	3.20
34	600845	宝信软件	11,330,835.00	3.09
35	688496	清越科技	11,117,866.39	3.03
36	300559	佳发教育	10,931,831.00	2.98
37	300430	诚益通	10,697,499.00	2.91
38	300496	中科创达	10,097,092.70	2.75
39	688012	中微公司	9,666,011.01	2.63
40	688017	绿的谐波	9,427,358.46	2.57
41	300054	鼎龙股份	9,352,619.00	2.55
42	002432	九安医疗	9,093,967.80	2.48
43	301153	中科江南	9,077,898.02	2.47
44	600498	烽火通信	9,021,221.00	2.46
45	688498	源杰科技	8,151,009.93	2.22
46	688072	拓荆科技	7,669,934.12	2.09
47	688378	奥来德	7,647,935.13	2.08
48	688256	寒武纪	7,613,809.99	2.07
49	300136	信维通信	7,470,754.00	2.04

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	1,113,360,852.88
卖出股票收入（成交）总额	1,140,657,199.49

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	18,928,263.65	5.94
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）	2,320,186.87	0.73
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,248,450.52	6.67

### 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	019698	23 国债 05	149,000	15,082,576.03	4.73
2	019733	24 国债 02	29,000	2,931,118.99	0.92
3	113052	兴业转债	21,440	2,320,186.87	0.73
4	019709	23 国债 16	7,000	710,930.55	0.22
5	019727	23 国债 24	2,000	203,638.08	0.06

### 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 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金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是否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

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	177,060.96
2	应收清算款	5,943.76
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,255.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	205,260.47

### 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	113052	兴业转债	2,320,186.87	0.73

### 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
鹏扬数字经济先锋混合 A	6,148	89,866.47	-	-	552,499,052.59	100.00%
鹏扬数字经济先锋混合 C	8,381	13,641.69	-	-	114,331,032.00	100.00%
合计	14,529	45,896.49	-	-	666,830,084.59	100.00%

### 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏扬数字经济先锋混合 A	1,777,220.27	0.3217%
	鹏扬数字经济先锋混合 C	86,455.77	0.0756%
	合计	1,863,676.04	0.2795%

### 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	鹏扬数字经济先锋混合 A	>100
	鹏扬数字经济先锋混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏扬数字经济先锋混合 A	>100
	鹏扬数字经济先锋混合 C	0
	合计	>100

## § 9 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
基金合同生效日（2021 年 9 月 7 日）基金份额总额	888,933,049.09	147,559,941.86
本报告期期初基金份额总额	600,094,543.04	123,559,493.85
本报告期基金总申购份额	5,250,463.67	19,439,713.40
减：本报告期基金总赎回份额	52,845,954.12	28,668,175.25
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	552,499,052.59	114,331,032.00

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：

本基金管理人于 2024 年 3 月 22 日发布《鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告》，李净女士自 2024 年 3 月 21 日起担任鹏扬基金管理有限公司副总经理。

#### 2、基金托管人托管部门：

本报告期内基金托管人无重大人事变动。

### 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

### 10.6.1 管理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。

### 10.6.2 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，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	
东北证券	2	859,200,093.42	38.15%	640,321.14	38.78%	
长江证券	2	256,709,856.24	11.40%	190,276.26	11.52%	
华泰证券	2	243,808,008.14	10.82%	181,229.89	10.98%	
天风证券	2	158,452,957.45	7.03%	118,430.75	7.17%	
中信建投	2	153,934,497.53	6.83%	115,101.41	6.97%	
中信证券	2	139,226,196.88	6.18%	104,546.10	6.33%	
光大证券	2	118,884,195.71	5.28%	87,270.45	5.29%	
广发证券	2	97,519,074.02	4.33%	72,135.82	4.37%	
长城证券	2	79,837,589.48	3.54%	58,113.53	3.52%	
中金公司	3	76,133,326.05	3.38%	33,417.25	2.02%	
中银国际证券	2	68,739,682.23	3.05%	50,244.47	3.04%	
湘财证券	2	-	-	-	-	
瑞银证券	2	-	-	-	-	
第一创业证券	2	-	-	-	-	
中泰证券	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、市场服务报告等。

(2)基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后

与被选择的证券经营机构签订协议。

(3) 本基金本报告期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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东北证券	4,909,417.00	11.60%	515,586,000.00	41.98%	-	-	-	-
长江证券	500,700.00	1.18%	95,540,000.00	7.78%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	186,730,000.00	15.21%	-	-	-	-
天风证券	2,603,402.00	6.15%	112,220,000.00	9.14%	-	-	-	-
中信建投	602,618.00	1.42%	59,330,000.00	4.83%	-	-	-	-
中信证券	601,290.00	1.42%	53,950,000.00	4.39%	-	-	-	-
光大证券	1,203,256.00	2.84%	25,000,000.00	2.04%	-	-	-	-
广发证券	-	-	34,100,000.00	2.78%	-	-	-	-
长城证券	501,385.00	1.19%	36,400,000.00	2.96%	-	-	-	-
中金公司	300,924.00	0.71%	56,980,000.00	4.64%	-	-	-	-
中银国际证券	31,086,133.00	73.47%	52,200,000.00	4.25%	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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高级管理人员变更公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 3 月 22 日
2	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳前海微众银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 2 月 26 日
3	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳市前海排排网基金销售有限责任公司费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 6 月 7 日
4	鹏扬基金管理有限公司关于深圳分公司办公地址变更的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 5 月 9 日
5	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	2024 年 4 月 16 日
6	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	2024 年 5 月 23 日
7	鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 1 月 19 日
8	鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金 2023 年年度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 3 月 29 日
9	鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 19 日
10	鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金 (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	2024 年 6 月 27 日
11	鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金 (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	2024 年 6 月 27 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。

### 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

2024 年 8 月 29 日