鹏扬稳健优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）
2026 年第 3 季度报告

2026 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 26 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 22 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 2026 年 7 月 1 日起至 2026 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	鹏扬稳健优选一年持有混合（FOF）	
基金主代码	015131	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 8 月 2 日	
报告期末基金份额总额	48,668,816.83 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、基金投资策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略。	
业绩比较基准	中债-新综合财富（总值）指数收益率*77%+中证 800 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率*3%+活期存款基准利率*5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期风险和收益水平高于债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金中基金。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	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鹏扬稳健优选一年持有混合（FOF）A	鹏扬稳健优选一年持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	015131	015132

报告期末下属分级基金的份额总额	21,672,250.82 份	26,996,566.01 份

注：本基金自 2026 年 7 月 27 日起变更业绩比较基准为“中债-新综合财富（总值）指数收益率*77%+中证 800 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率*3%+活期存款基准利率*5%”。

§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（2026 年 7 月 1 日—2026 年 9 月 30 日）	
	鹏扬稳健优选一年持有混合（FOF）A	鹏扬稳健优选一年持有混合（FOF）C
1.本期已实现收益	-8,659.88	-35,863.36
2.本期利润	-454,415.39	-551,821.58
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0204	-0.0208
4.期末基金资产净值	22,004,375.62	26,962,594.81
5.期末基金份额净值	1.0153	0.9987

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）T 日的基金份额净值在 T+2 日内计算，并在 T+3 日内公告。

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

鹏扬稳健优选一年持有混合（FOF）A

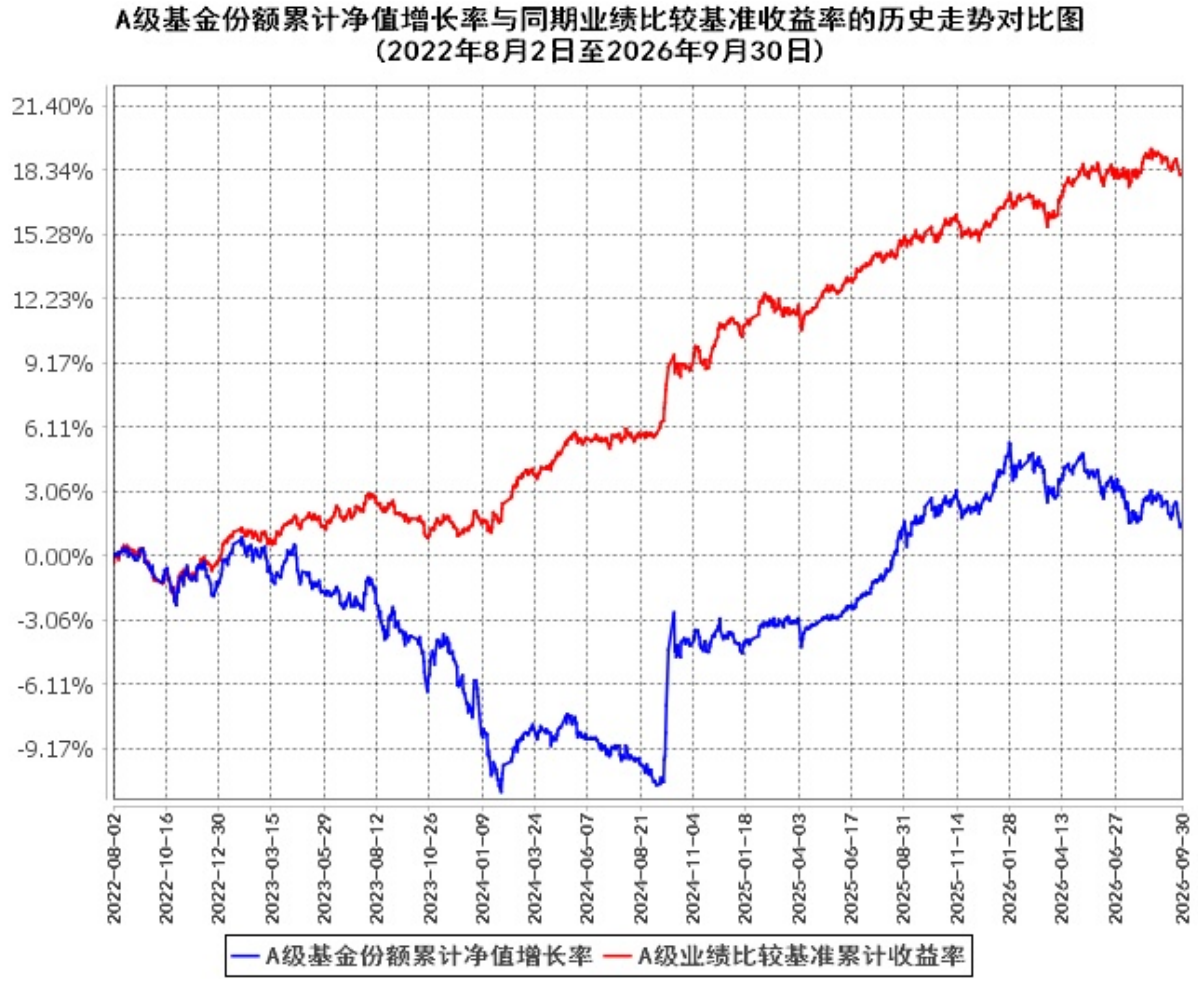
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.04%	0.25%	-0.18%	0.17%	-1.86%	0.08%
过去六个月	-1.30%	0.25%	1.80%	0.18%	-3.10%	0.07%
过去一年	-0.78%	0.26%	2.43%	0.17%	-3.21%	0.09%
过去三年	5.56%	0.31%	16.11%	0.17%	-10.55%	0.14%
自基金合同生效起至今	1.53%	0.29%	18.17%	0.16%	-16.64%	0.13%

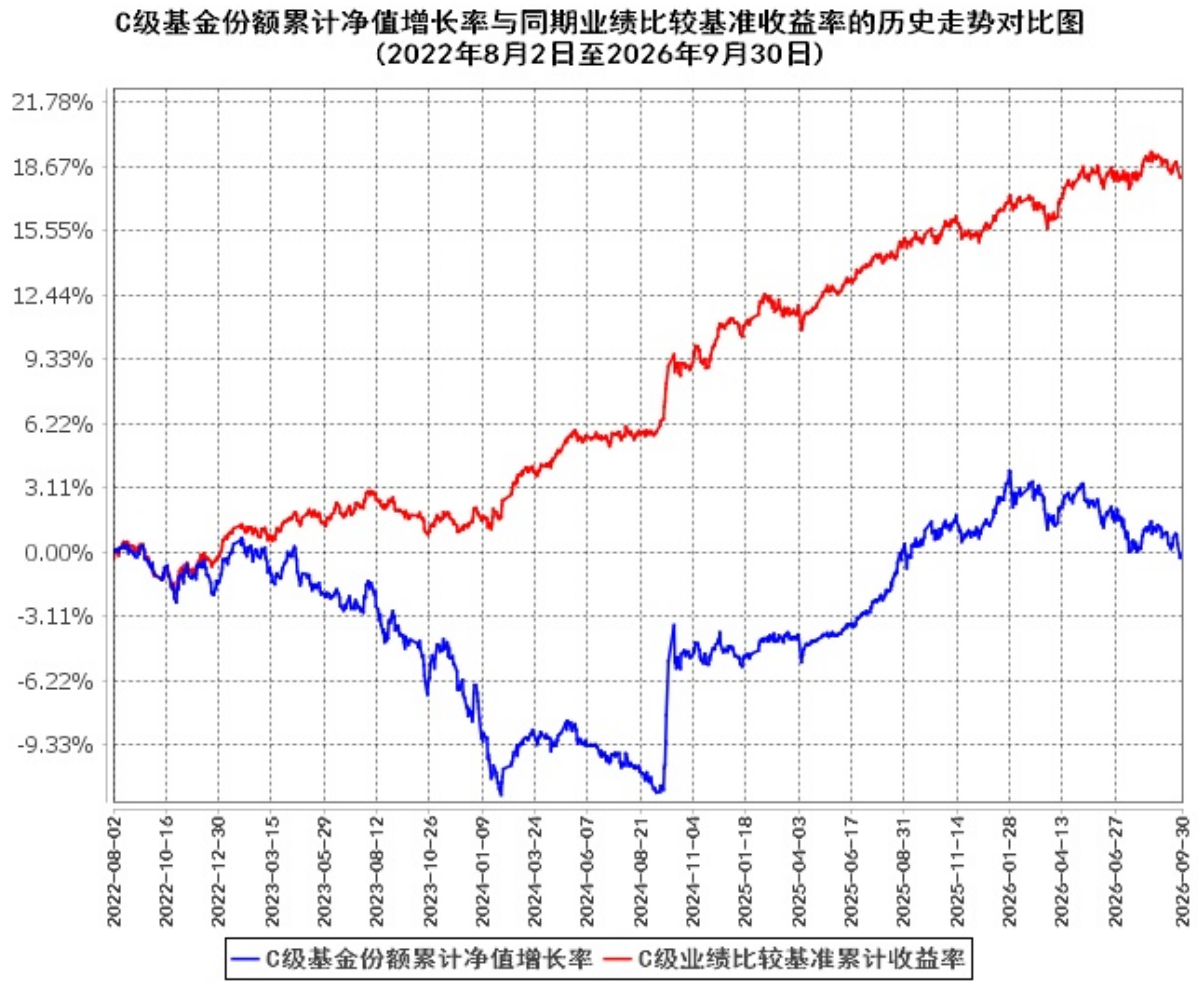
鹏扬稳健优选一年持有混合（FOF）C

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	-2.14%	0.25%	-0.18%	0.17%	-1.96%	0.08%
过去六个月	-1.50%	0.25%	1.80%	0.18%	-3.30%	0.07%
过去一年	-1.16%	0.26%	2.43%	0.17%	-3.59%	0.09%
过去三年	4.32%	0.31%	16.11%	0.17%	-11.79%	0.14%
自基金合同生效起至今	-0.13%	0.29%	18.17%	0.16%	-18.30%	0.13%

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





§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		
赵会龙	本基金基金经理，多资产策略部执行总经理	2024 年 1 月 5 日	-	15	上海交通大学高级金融学院工商管理硕士。曾任德勤国际注册会计师事务所税务分析师，朗润投资集团投资经理，瑞讯华识（上海）投资咨询有限公司研究员，平安国际融资租赁有限公司战略与研究经理，华宝基金管理有限公司高级产品经理、高级分析师、基金经理助理、投资经理。现任鹏扬基金管理

					有限公司多资产策略部执行总经理。2023 年 12 月 4 日至今任鹏扬平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理；2024 年 1 月 5 日至今任鹏扬稳健优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理；2026 年 1 月 23 日至今任鹏扬稳健融选三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理；2026 年 3 月 27 日至今任鹏扬多元均衡三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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《中华人民共和国证券投资基金法》、《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

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，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

2026 年三季度，全球经济供给矛盾进一步加剧。中东冲突带来的能源供给扰动延续，能源成本重新纳入全球通胀定价逻辑；与此同时，AI 资本开支并未因融资环境收紧而明显降温，投资重心由芯片领域向数据中心、电力、输配电、冷却设备和能源供应环节延伸。AI 由此从科技行业的结构性景气，演变为影响全球投资、能源需求和通胀水平的宏观变量。随着算力基础设施快速扩张，电力供给、电网容量和能源价格逐渐成为新的增长约束，AI 投资对全球经济的影响也从单纯拉动资本开支，进一步转向推升资源需求和边际通胀。美国经济呈现消费和资本开支共同支撑需求、通胀回落进程受阻的格局，货币政策重新趋于收紧，全球流动性环境由上半年的边际改善再次转弱。总体而言，三季度海外经济形成“AI 投资扩张—能源需求上升—通胀粘性增强—货币政策收紧”的新传导链条，全球经济增长并未明显失速，但增长模式愈发具有资本密集和通胀性的特征。

2026 年三季度，国内经济“供强需弱”的结构性失衡状况未有明显缓解。生产端主要由高技术制造、设备更新和出口产业链支撑，地产、基建及一般制造业投资相对偏弱，经济增长动能进一步向先进制造和外需集中。消费内部同样呈现分化：商品消费整体偏弱，服务、文旅、信息和品质型消费韧性相对更强，居民需求逐步由耐用品消费向服务消费迁移，但尚不足以抵消地产调整和居民收入预期偏弱的影响。与此同时，制造业生产和订单出现阶段性改善，但库存有所累积、企业招聘仍较谨慎，表明生产端改善尚未顺畅传导至居民收入和最终需求。价格结构的变化尤其明显，PPI 回升更多来自能源和原材料涨价，以及“反内卷”推动部分工业品价格和利润率修复，而终端企业定价能力仍然偏弱，上游成本向消费端的传导有限。因此，当前价格回升并非典型的需求型再通胀，更多体现为“上游价格修复、下游需求偏弱”的结构性再通胀。综合来看，三季度国内经济表现为“先进制造和出口强、传统投资和商品消费弱，上游价格修复快于终端需求”的格局，经济对外需和新产业的依赖有所提高。

2026 年三季度，全球权益市场呈现高波动与风格再平衡特征。美联储重启加息、美元与美债利率走强、AI 叙事阶段性降温，共同主导市场表现。美股方面，长端美债利率突破前期高点，高利率压制传统经济与利率敏感板块；道琼斯指数收跌、标普 500 与纳斯达克指数温和收涨。7 月 AI 叙事转向后，全球科技硬件板块经历一轮明显的估值去杠杆，AI 板块相对收益明显收窄。国内方面，A 股整体震荡走弱，前期强势的科技成长方向出现深度回撤，创业板指跌幅显著大于主板权重指数；恒生指数在红利资产与南向资金的支撑下逆势收涨，价值风格明显占优。风格与行业方面，三季度市场呈现与上半年近乎镜像的高低切换：煤炭、石油石化、银行、农林牧渔等资源及红利板块领涨，在海外利率上行、全球风险偏好回落的环境下，高股息资产的配置价值再度得到验证；前期涨幅巨

大、估值与交易拥挤度处于高位的电子、通信等硬科技板块跌幅居前。市场成交额逐月回落，存量博弈特征明显，市场广度偏弱，超跌反弹与防御轮动交替演绎，缺乏持续性主线。整体来看，三季度国内权益市场受三大核心变量驱动：全球流动性拐点实际兑现、AI 产业叙事阶段性降温及国内基本面弱修复，权益资产呈现显著的均值回归特征。后续需持续关注科技景气的业绩兑现节奏、美联储政策路径对全球流动性的影响，以及国内增量政策的落地效果。

2026 年三季度，国内债券收益率整体震荡下行，主要源自市场对基本面弱修复格局延续、内需压力未解及货币政策呵护取向的定价。短端方面，资金面总体维持充裕，政策利率保持稳定，短端利率围绕政策利率窄幅波动；长端方面，经济与金融数据偏弱，叠加机构配置资金持续入场，共同推动长端利率下行，超长端品种表现尤为突出，期限利差进一步压缩，曲线呈平坦化特征。信用债市场延续资产荒格局，信用利差在低位基础上进一步收窄，中长端与部分弱资质品种补涨明显，但当前利差安全垫已相当有限，信用下沉的性价比有所下降，需关注理财回表与低利差环境下的潜在波动风险。转债方面，正股深度回撤与估值压缩形成双重压制，中证转债指数逐月走低，高弹性品种调整幅度更大，低价与高等级品种相对抗跌，整体仍受风险偏好回落与估值偏高的双重约束。整体而言，债券市场已较为充分地定价“内需偏弱、通胀温和、政策呵护”这一宏观组合。长端利率下行与曲线平坦化，反映市场对传统经济修复力度偏弱与资产荒逻辑延续的确认。后续债市走势取决于增量政策发力与政府债供给节奏的边际变化、基本面修复的持续性、美联储政策路径对国内货币政策空间的约束，以及机构配置行为的动态变化，需重点跟踪观察。

基金操作方面，本基金的权益类资产配置比例在本季度大部分时间里保持在中性水平，在 9 月提升至中性略偏高。在资产配置层面，我们继续保持对国内债券、中国股市、海外债券、海外股市、黄金、商品等众多大类资产的跟踪研究，并动态调整配置比例，以此分散组合风险，控制组合回撤，优化投资者持有体验。在权益类资产内部结构上，价值投资策略（包括红利和现金流策略）和均衡型基金依旧是我们的底仓；在底仓之外，我们基于宏观分析、产业趋势、估值性价比、资金面情况等因素，灵活把握科技、周期、消费等细分板块的投资机会。

本基金的投资目标兼顾追求长期回报和控制回撤，因此会在合同允许的范围内，围绕基准，进行大类资产配置，以期在收益和波动之间取得平衡。本基金以精选基金为核心投资策略，在权益类资产内部精选了投资策略明确、相关性低的基金，加以分散配置；在固收类资产内部，在转债基金、纯债基金和短债基金等基金类别上分别精选基金，并根据市场观点动态配置。未来运作中，我们将继续利用 FOF 产品多元配置的优势，在更广泛的市场中寻找低相关、多样化的收益来源。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬稳健优选一年持有混合（FOF）A 的基金份额净值为 1.0153 元，本报告期基

金份额净值增长率为-2.04%；截至本报告期末鹏扬稳健优选一年持有混合（FOF）C 的基金份额净值为 0.9987 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.14%；同期业绩比较基准收益率为-0.18%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间系从 2026 年 5 月 12 日至 2026 年 7 月 17 日。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	109,580.00	0.22
	其中：股票	109,580.00	0.22
2	基金投资	45,606,740.01	92.69
3	固定收益投资	3,012,352.60	6.12
	其中：债券	3,012,352.60	6.12
	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	465,518.29	0.95
8	其他资产	9,951.27	0.02
9	合计	49,204,142.17	100.00

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	109,580.00	0.22
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	109,580.00	0.22

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

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	688825	长鑫科技	2,000	109,580.00	0.22
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

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	3,012,352.60	6.15
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）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	3,012,352.60	6.15

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	019835	26 国债 09	30,000	3,012,352.60	6.15
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约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约定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,609.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	17.98
6	其他应收款	324.08
7	其他	-
8	合计	9,951.27

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	007564	鹏扬淳明债券 A	契约型开放式	6,754,063.68	7,484,177.96	15.28	是
2	007408	鹏扬淳开债券 A	契约型开放式	5,587,878.79	6,040,496.97	12.34	是
3	006055	鹏扬淳合债券 A	契约型开放式	3,800,000.00	4,063,720.00	8.30	是
4	008497	鹏扬浦利中短债 A	契约型开放式	2,925,117.00	3,105,011.70	6.34	是
5	006829	鹏扬利沣短债 A	契约型开放式	2,556,890.82	2,809,767.32	5.74	是
6	511880	银华日利	交易型开放式	25,000.00	2,521,375.00	5.15	否
7	006513	鹏扬淳享债券 A	契约型开放式	2,300,000.00	2,412,930.00	4.93	是
8	021429	中泰安弘债券 A	契约型开放式	1,938,644.82	2,115,643.09	4.32	否
9	518880	华安黄金 ETF	交易型开放式	170,000.00	1,467,610.00	3.00	否
10	159934	易方达黄金 ETF	交易型开放式	150,000.00	1,353,300.00	2.76	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用	其中：交易及持有基金管理人

	2026 年 7 月 1 日至 2026 年 9 月 30 日	以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	7,116.15	943.93
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	46,198.39	22,089.45
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	10,317.43	5,513.26
当期交易所交易基金产生的交易费用（元）	4,312.49	261.72

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的(ETF 除外)，应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费(按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外)、销售服务费（如有）等销售费用。申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏扬稳健优选一年持有混合（FOF）A	鹏扬稳健优选一年持有混合（FOF）C
报告期期初基金份额总额	21,757,559.98	23,593,825.96
报告期期间基金总申购份额	1,928,208.71	3,535,026.74
减：报告期期间基金总赎回份额	2,013,517.87	132,286.69
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	21,672,250.82	26,996,566.01

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。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 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。

8.2 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。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2026 年 6 月 26 日发布《鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2026 年 7 月 27 日起，本公司决定变更鹏扬稳健优选一年持有期混合型基金中基金(FOF)的业绩比较基准，由“中债综合财富(总值)指数收益率×85%+中证 800 指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%”调整为“中债-新综合财富(总值)指数收益率*77%+中证 800 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率*3%+活期存款基准利率*5%”。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1.中国证监会准予鹏扬稳健优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）注册的文件；

2.《鹏扬稳健优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；

3.《鹏扬稳健优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）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中国证监会规定媒介上披露的各项公告。

10.2 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。

10.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人和/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

2026 年 10 月 26 日