

鹏扬汇利债券型证券投资基金

更新的招募说明书摘要

(2019 年第 1 号)

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

截止日：**2019 年 6 月 2 日**

【重要提示】

1、本基金根据2017年4月12日中国证券监督管理委员会《关于准予鹏扬汇利债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]499号）进行募集。本基金的基金合同于2017年6月2日正式生效，自该日起基金管理人正式开始管理本基金。

2、基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

3、投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。投资人需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、本基金特有的风险及其他风险。此外，本基金以1元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在基金份额净值跌破1元初始面值的风险。

4、本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。

5、本基金可投资国债期货，国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来较大损失。

6、基金不同于银行储蓄与债券，投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及《基金合同》。

7、基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

8、基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

9、本基金目标客户不包括特定的机构投资者。

10、本招募说明书所载内容截止日为2019年6月2日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2019年3月31日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：鹏扬基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 120 号 3 层 302 室

办公地址：北京市西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 16 层

邮政编码：100045

法定代表人：杨爱斌

成立日期：2016 年 7 月 6 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2016]1453 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.18 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：李雯婷

联系电话：010-68105888

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

范勇宏先生：董事长，经济学博士。现任香山财富研究院联席理事长、宏实资本管理有限公司执行董事兼总经理。曾先后在中国建设银行、华夏证券股份有限公司、华夏基金管理有限公司、中国人寿资产管理有限公司等单位工作。从事金融工作近 30 年，具有比较丰富的金融工作经历。

杨爱斌先生：董事，复旦大学国际金融专业经济学硕士。现任鹏扬基金管理有限公司总经理。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

姜山先生：董事，美国印第安纳大学商学院工商管理硕士。现任上海华石投资有限公司执行董事兼总经理，北京鹏扬企业管理有限公司执行董事兼总经理。历任安达信华强会计师事务所审计师、美国 Sara Lee 公司内部审计师、瑞银投资银行董事、高盛亚洲有限公司执行董事、美国德州太平洋集团董事及北京代表处首席代表、摩根士丹利华鑫证券有限责任公司投资银行部董事总经理。

李刚先生：董事，中国社科院经济学博士。现任鹏扬基金管理有限公司副总经理。历任中国农业银行资产负债管理部交易员、资金营运部高级交易员、金融市场部处长、副总经理。

董建瑾女士：独立董事，美国伊利诺伊理工学院肯特法学院法学硕士。现任北京观韬律师事务所合伙人。历任北京市新闻出版局科员、北京高华证券有限公司执行董事、上海国际

能源交易中心首席律师、北京市君泽君律师事务所合伙人。

邱峻女士：独立董事，美国波士顿学院工商管理硕士。现任信达金誉（上海）投资管理有限公司财务总监。历任安永会计师事务所美国纽约分所高级审计师、高级经理、安永华明会计师事务所上海分所高级经理、蓝山投资咨询（北京）有限公司财务总监。

王鹤菲女士：独立董事，美国斯坦福大学商学院金融系哲学博士。现任中国人民大学国际学院金融学教授。历任美国伊利诺伊大学芝加哥分校商学院金融系助理教授、美联储芝加哥银行访问经济学家、清华大学经济管理学院金融系访问学者、中国投资有限责任公司风险管理部访问经济学家、中国人民大学汉青研究院金融系副教授、副系主任。

2、基金管理人监事会成员

王徽先生：监事，江苏大学经济学学士。现任中钰资本管理（北京）股份有限公司合伙人、首席风控官。历任中国华晶电子集团会计、爱韩华电子（无锡）电子有限公司财务经理、江苏苏亚会计师事务所南方分所审计经理、北京中星微电子有限公司财务经理、无锡东林会计师事务所合伙人、利安达会计师事务所（特殊普通合伙）合伙人。王徽先生现担任北京注册会计师协会经济责任审计专业委员会专家委员及北京总会计师协会理事。

吉瑞女士：监事（职工监事），对外经济贸易大学管理学学士。现任鹏扬基金管理有限公司监察稽核部总监。历任安永华明会计师事务所金融审计部审计师，毕马威华振会计师事务所风险咨询部助理经理及高瓴资本管理有限公司法律合规部高级经理。

曹铮女士：监事（职工监事），北京大学经济学学士。现任鹏扬基金管理有限公司人力资源及行政管理部总监。历任国家电网公司监察局文员、北京科舵整合创意咨询有限公司人事助理、索尼爱立信（中国）有限公司人事专员、微软亚洲研究院人事经理、北京鹏扬投资管理公司人力资源及行政管理部总监。

3、高级管理人员

杨爱斌先生：总经理，复旦大学国际金融专业经济学硕士。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

李刚先生：副总经理，中国社科院经济学博士。历任中国农业银行股份有限公司资产负债管理部交易员、资金运营部高级交易员、金融市场部处长、副总经理。

卢安平先生：副总经理兼首席投资官，清华大学工商管理硕士。历任全国社保基金理事会资产配置处长、风险管理处长，中国平安保险（集团）股份有限公司委托与绩效评估部总经理，平安人寿保险股份有限公司委托投资部总经理。

宋震先生：督察长，北京大学数学学院理学学士，中国经济研究中心经济学双学士，北京大学信息科学技术学院工学硕士，曾任 Schlumberger Ltd 工程师、龙翌创富顾问有限公司副总裁、中国证监会北京监管局主任科员。

4、本基金基金经理

杨爱斌先生：总经理，复旦大学国际金融专业经济学硕士。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。鹏扬泓利债券型证券投资基金基金经理（2018年12月12日起任职）。

焦翠女士：固定收益部基金经理，中国人民大学金融学硕士，曾任北京鹏扬投资管理有限公司交易管理部债券交易员。2016年8月加入鹏扬基金管理有限公司，历任交易管理部债券交易员、固定收益部投资组合经理。鹏扬景兴混合型证券投资基金基金经理（2018年3月16日起任职）、鹏扬利泽债券型证券投资基金基金经理（2018年8月23日起任职）、鹏扬泓利债券型证券投资基金基金经理（2019年1月4日起任职）、鹏扬淳享债券型证券投资基金基金经理（2019年3月22日起任职）。

历任基金经理情况：徐冶丹先生，管理期间为2017年6月2日至2017年7月13日。

5、投资决策委员会成员情况

（1）固定收益投资决策委员会

王华先生：固定收益总监、固定收益投资决策委员会主任委员，清华大学理学学士，CFA、FRM，历任银河期货有限公司研究员，银河期货有限公司自营子公司固定收益部总经理，北京鹏扬投资管理有限公司衍生品策略部总经理。

杨爱斌先生：总经理，复旦大学国际金融专业经济学硕士。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

李刚先生：副总经理，中国社科院经济学博士。历任中国农业银行股份有限公司资金运营部高级交易员、资金运营部高级交易员、金融市场部处长、副总经理。

陈钟闻先生：固定收益部执行总经理、现金策略总监，北京理工大学工商管理硕士。曾任北京鹏扬投资管理有限公司交易主管、投资经理。

（2）股票投资决策委员会

卢安平先生：副总经理兼首席投资官，股票投资决策委员会主任委员，清华大学工商管理硕士，西安交通大学工学学士。曾任全国社保基金理事会资产配置处长、风险管理处长，中国平安保险（集团）股份有限公司委托与绩效评估部总经理，平安人寿保险股份有限公司委托投资部总经理。

杨爱斌先生：总经理，复旦大学国际金融专业经济学硕士。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

张望先生：股票投资部研究总监，清华大学生物系理学硕士。历任华夏基金化工行业研究员、研究部周期组组长。2015年加入拾贝投资并担任基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

成立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

（1）鹏扬基金管理有限公司直销柜台

办公地址：北京市西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 16 层

法定代表人：杨爱斌

全国统一客户服务电话：4009686688

联系人：吴瑞

传真：010-68105966

（2）鹏扬基金管理有限公司电子直销交易

客服电话：4009686688

网址：www.pyamc.com

2、其他销售机构

（1）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：周嘉谊

电话：0755-83271192

传真：0755-83195049

客户服务电话：95555

网址: www.cmbchina.com

(2) 兴业银行股份有限公司

注册地址: 福建省福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址: 上海市江宁路 168 号兴业大厦

法定代表人: 高建平

联系人: 李玮琳

电话: 021-52629999-211054

传真: 021-62565787

客户服务电话: 95561

网址: www.cib.com.cn

(3) 中信建投证券股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 18 层

法定代表人: 王常青

联系人: 刘芸

电话: 010-85156310

传真: 010-65182261

客户服务电话: 95587/4008-888-108

网址: www.csc108.com

(4) 国都证券股份有限公司

注册地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人: 王少华

联系人: 黄静

电话: 010-84183389

传真: 010-84183311-3389

客户服务电话: 400-818-8118

网址: www.guodu.com

(5) 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

联系人: 郑慧

电话: 010-60838888

传真：010-6083 6029

客户服务电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

(6) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

联系人：刘晓明

电话：0531-89606165

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

(7) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

电话：010-60833754

传真：0755-83217421

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

(8) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：何薇

电话：010-65980380-8011

客户服务电话：95021 / 4001818188

网址：<http://www.1234567.com.cn>

(9) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：徐超逸

电话：021-20613988-6671

传真：021-68596919

客户服务电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(10) 济安财富（北京）资本管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：010-65309516

传真：010-65330699

客户服务电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

(11) 万家财富基金销售（天津）有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层

法定代表人：李修辞

联系人：王芳芳

电话：18519215322

传真：021-38909659

客户服务电话：010-59013825

网址：www.wanjiawealth.com

(12) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：鲍东华

联系人：程晨

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

(13) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人：江卉

联系人：黄立影

电话：010-89188345

客户服务电话：95118（个人业务）；400 088 8816（企业业务）

网址：<http://fund.jd.com>

（14）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：张彦

联系人：文雯

电话：010-83363101

客户服务电话：400-116-1188

网址：8.jrj.com.cn

（15）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

客户服务电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com

（16）一路财富（北京）基金销售股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室

法定代表人：吴雪秀

联系人：吕晓歌

电话：(010)88312877

客户服务电话：400-001-1566

网址：<http://www.yilucaifu.com>

（17）通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼

法定代表人：马刚

联系人：杨徐霆

电话：021-60818249

客户服务电话：400-66-95156

网址：<https://www.tonghuafund.com>

(18) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人：钟斐斐

联系人：侯芳芳

电话：15910450297

客户服务电话：4000-618-518

网址：<http://danjuanapp.com>

(19) 凤凰金信（银川）基金销售有限公司

注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402(750000)

办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院朝来高科技产业园18号楼(100000)

法定代表人：程刚

联系人：张旭

电话：010-58160168

客户服务电话：400-810-5919

网址：www.fengfd.com

(20) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人：毛淮平

联系人：仲秋玥

电话：010-88066632

客户服务电话：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

(21) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部

科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

联系人：吴翠

电话：010-62675369

客户服务电话：010-62675369

网址：www.xincai.com

(22) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户服务电话：020-89629066

网址：<https://www.yingmi.cn/>

(23) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

电话：0755-89460500

传真：

客户服务电话：400-684-0500

网址：<https://www.ifastps.com.cn>

(24) 浦领基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招弟

联系人：李艳

电话：010-59497361

客户服务电话：400-876-9988

网址：<http://www.zscffund.com/>

(25) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：胡燕亮

联系人：孙琦

电话：021-50810687

客户服务电话：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

（26）嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

联系人：余永健

电话：010-85097570

客户服务电话：400-021-8850

网址：<https://www.harvestwm.cn/>

（27）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：中国杭州市西湖区西溪路 556 号蚂蚁 Z 空间

法定代表人：陈柏青

联系人：傅强

电话：13811165370

客户服务电话：95188

网址：<http://www.antfortune.com/>

（28）上海朝阳永续基金销售有限公司

注册地址：浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室

办公地址：上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼

法定代表人：廖冰

联系人：裘爱萍

电话：021-80234888-6693

客服电话：400 - 699 - 1888

网址：www.998fund.com

（29）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

注册资本：2000 万元人民币

联系人：吴鸿飞

电话：021-65370077*268

客户服务电话：4008205369

网址：<https://www.jiyufund.com.cn/>

（30）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

联系人：郑向溢

客服电话：95517

网址：www.essence.com.cn

（31）长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14 楼、16 楼、17 楼

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14 楼、16 楼、17 楼

法定代表人：丁益

联系人：金夏

电话：0755-83516289

电子邮件：jinxia@cgws.com

客服电话：4006666888

网址：www.cgws.com

（32）国开证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街 29 号 1-9 层

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 29 号 1-9 层

法定代表人：张宝荣

联系人：孟妍

电话：010-88300999

电子邮件：mengyan@gkzq.com.cn

客服电话：4008895593

网址：<http://www.gkzq.com.cn/>

（33）华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

(34) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：拉萨市北京中路101号

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

电话：021-23586603

客服电话：95357

网址：www.18.cn

(35) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

客户服务电话：95321

网址：www.cindasc.com

(36) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

代理法定代表人：毕明建

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

传真：010-85679203

客户服务电话：400-910-1166

网址：www.cicc.com

(37) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第4、18层至21层

法定代表人：高涛

联系人：万玉琳

电话：0755-82026907

客户服务电话：95532

网址：www.china-invs.cn

(38) 广州银行股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 30 号

办公地址：广州市天河区珠江东路 30 号

法定代表人：黄子励

联系人：陈振华

电话：020-28302433

客户服务电话：4008396699

网址：<http://www.gzcb.com.cn>

(39) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

联系人：张佳乐

电话：021-61162071

客户服务电话：95528

网址：<http://www.spdb.com.cn/>

(40) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

联系人：王晓琳

电话：010-89937325

客户服务电话：95558

网址：<http://bank.ecitic.com>

(41) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

电话：021-52822063

客服电话：400-166-6788

网址：www.66liantai.com

(42) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人：戎兵

联系人：魏晨

电话：010-52413385

客服电话：400-6099-200

网址：www.yixinfund.com

(43) 腾安基金销售（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦

法定代表人：刘明军

联系人：郑骏锋

联系电话：0755-86013388-77386

客服电话：95017

网址：www.tenganxinxi.com

(44) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

联系人：洪泓

联系电话：0571-88911818-8659

客服电话：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

(45) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 1108 号

法定代表人：王伟刚

联系人：王骁骁

电话：010-56251471

客服电话：400-619-9059

网址：www.hcjijin.com

(46) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

办公地址：上海市花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

电话：021-20315290

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(47) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：姜昧军

联系人：王雯

电话：0755-83199599

客服电话：4008323000

网址：www.csco.com.cn

(48) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：南京市鼓楼区中环国际 1413 室

法定代表人：吴言林

联系人：林伊灵

电话：025-6604 6166（分机号转 810）

客服电话：025-66046166

网址：www.huilinbd.com

(49) 联储证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 27 层

法定代表人：吕春卫

联系人：丁倩云

电话：010-86499427

客服电话：4006206868

网址：www.lczq.com

（二）登记机构

名称：鹏扬基金管理有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 16 层

法定代表人：杨爱斌

全国统一客户服务电话：4009686688

联系人：韩欢

传真：010-68105932

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：021- 51150298

传真：021- 51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、范佳斐

（四）会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：（010）58153000

传真电话：（010）85188298

经办注册会计师：王珊珊、贺耀

联系人：贺耀

四、基金的名称

鹏扬汇利债券型证券投资基金

五、基金的运作方式和类型

契约型开放式、债券型

六、基金的投资目标

本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资人提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。

七、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、公开发行的次级债券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、可转换债券、可分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、债券质押式及买断式回购、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、国债期货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（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%。投资于股票、权证等资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金以及到期日在 1 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。

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。

八、基金的投资策略

本基金的投资策略包括买入持有策略、久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属和板块轮换策略、骑乘策略、价值驱动的个人券选择策略、可转债/可交换债投资策略、国债期货投资策略、适度的融资杠杆策略、资产支持证券投资策略以及股票投资策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。

1、买入持有策略

以简单、低交易成本为原则，挑选符合投资需求的标的债券，持有到期后再转而投资新的标的债券。

2、久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。

3、收益率曲线配置

在久期确定的基础上，根据对收益曲线形状变化的预测，确定采用子弹型策略、哑铃型策略和梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

4、板块轮换策略

根据国债、金融债、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持相对低估的板块，减持相对高估的板块，借以取得较高收益。

5、骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，随着所持有债券的剩余期限下降，债券的到期收益率将下降，从而获得资本利得。

6、个券选择策略

用自下而上的方法选择价值相对低估的债券。通过考察收益率曲线的相对位置和形状，对比不同信用等级、在不同市场交易债券的到期收益率等方法，结合票息、税收、可否回购、嵌入期权等其他决定债券价值的因素，从而发现市场中个券的价值相对低估状况。

7、可转债/可交换债投资策略

综合分析可转债/可交换债的债性特征、股性特征等因素的基础上，利用 BS 公式或二叉树定价模型等量化估值工具评定其投资价值，重视对可转债/可交换债对应股票的分析与研究，选择那些公司和行业景气趋势回升、成长性好、安全边际较高的品种进行投资。对于含回售及赎回选择权的债券，本基金将利用债券市场收益率数据，运用期权调整利差（OAS）模型分析含赎回或回售选择权的债券的投资价值，作为此类债券投资的主要依据。

8、国债期货投资策略

在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，并积极采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

9、融资杠杆策略

通过分析回购品种之间的利差及其变动，结合对年末效应和长假效应的灵活使用，进行中长期回购品种的比例配置，同时在严格控制风险的基础上利用跨市场套利和跨期限套利的机会。

10、资产支持证券投资策略

重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

11、股票投资策略

主要选择有良好增值潜力的股票以及有良好现金流、经营业绩持续增长、估值合理的防御类股票构建股票投资组合。在资金运作初期，轻度参与股票投资，在基金份额净值高于基金面值，具有一定风险承受能力后，当判断股票市场趋好时，增大股票资产以获得更高的收益率，当判断股票市场形势不好时，减少对股票投资。

九、业绩比较基准

中债综合指数收益率 *90%+沪深 300 指数收益率 *10%

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数,或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布时,本基金管理人在与基金托管人协商一致,可调整或变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金,属于中低风险/收益的产品。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)

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2019年4月16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。

以下内容摘自本基金2019年第1季度报告,所列财务数据未经审计。

11.1 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	320,805,846.57	8.11
	其中:股票	320,805,846.57	8.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,495,355,916.34	88.41
	其中:债券	3,495,355,916.34	88.41
	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	41,547,784.35	1.05
8	其他资产	95,911,024.92	2.43
9	合计	3,953,620,572.18	100.00

11.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.2.1 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	89,142,100.00	2.72
C	制造业	72,722,364.28	2.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,719,580.00	0.85
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	61,398,304.49	1.87
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	49,590,584.00	1.51
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	20,232,913.80	0.62
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	320,805,846.57	9.79

注：以上行业分类以 2019 年 3 月 31 日的证监会行业分类标准为依据。

11.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

11.3 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	600028	中国石化	11,170,000	64,115,800.00	1.96
2	601607	上海医药	1,698,058	35,115,839.44	1.07
3	601288	农业银行	9,000,000	33,570,000.00	1.02
4	000598	兴蓉环境	5,961,200	27,719,580.00	0.85
5	601899	紫金矿业	7,130,000	25,026,300.00	0.76
6	600196	复星医药	810,000	24,121,800.00	0.74
7	002027	分众传媒	3,226,940	20,232,913.80	0.62
8	002867	周大生	503,715	17,665,285.05	0.54
9	600535	天士力	745,463	16,787,826.76	0.51
10	000581	威孚高科	702,278	16,215,599.02	0.49

11.4 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	109,695,107.20	3.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	700,573,647.00	21.38
	其中：政策性金融债	538,681,647.00	16.44
4	企业债券	667,100,200.00	20.36
5	企业短期融资券	140,747,000.00	4.29
6	中期票据	1,822,727,000.00	55.62
7	可转债（可交换债）	54,512,962.14	1.66
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,495,355,916.34	106.66

11.5 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	160205	16 国开 05	3,300,000	315,414,000.00	9.62
2	1828016	18 民生银行 01	1,000,000	101,130,000.00	3.09
3	101900292	19 首创集 MTN001	900,000	90,315,000.00	2.76
4	108901	农发 1801	859,990	86,291,396.60	2.63
5	101900304	19 武汉地产 MTN001	800,000	80,216,000.00	2.45

11.6 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

11.7 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

11.8 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

11.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

11.9.1 本期国债期货投资政策

根据风险管理原则，本基金以套期保值为主要目的，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。制定国债期货套期保值策略时，基金管理人通过对宏观经济和债券市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，并根据基金现券资产利率风险敞口采用流动性好、交易活跃的期货合约。基金管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，规避利率风险以达到降低投资组合的整体风险的目的。

11.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					2,892,621.35
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-1,247,300.00

注 1：本基金本报告期末未持有国债期货。

注 2：本期国债期货投资本期收益为未扣手续费收益。

11.9.3 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期内以套期保值为主要目的进行了国债期货投资。通过对宏观经济和债券市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型，并与现券资产进行匹配，较好地对冲了利率风险、流动性风险对基金的影响，降低了基金净值的波动。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

11.10 投资组合报告附注

11.10.1 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

18 民生银行 01(1828016. IB)为鹏扬汇利债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2018 年 11 月 9 日中国银行保险监督管理委员会针对民生银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款 3160 万元。主要违法违规事实：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）同业投资违规接受担保；（三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）个人理财资金违规投资；（六）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；（七）为非保本理财产品提供保本承诺。2018 年 11 月 9 日中国银行保险监督管理委员会针对民生银行贷款业务严重违反审慎经营规则，处以罚款 200 万元。

18 兴业绿色金融 02(1828017. IB)为鹏扬汇利债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2018 年 4 月 19 日中国银行保险监督管理委员会针对兴业银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款 5870 万元。主要违法违规事实：（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。

本基金投资 18 民生银行 01、18 兴业绿色金融 02 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 18 民生银行 01、18 兴业绿色金融 02 外，本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

11.10.2 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。

11.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	197,633.33
2	应收证券清算款	41,771,774.85
3	应收股利	-
4	应收利息	48,454,115.84
5	应收申购款	5,487,500.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	95,911,024.92

11.10.4 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	132008	17山高EB	19,009,991.00	0.58

11.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

11.10.6 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。

十二、基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。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。

本基金合同生效日为2017年6月2日，基金合同生效以来（截至2019年3月31日）的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

鹏扬汇利债券 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
自基金合同生效之日—2017年12月31日	1.25%	0.08%	1.08%	0.08%	0.17%	0.00%
2018年1月1日—2018年12月31日	5.76%	0.23%	1.51%	0.14%	4.25%	0.09%
2019年1月1日—2019年3月31日	3.93%	0.17%	3.06%	0.15%	0.87%	0.02%
基金合同生效日至2019年3月31日	11.29%	0.19%	5.74%	0.12%	5.55%	0.07%

鹏扬汇利债券 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
自基金合同生效之日—2017年12月31日	1.03%	0.08%	1.08%	0.08%	-0.05%	0.00%
2018年1月1日-2018年12月31日	5.35%	0.23%	1.51%	0.14%	3.84%	0.09%
2019年1月1日-2019年3月31日	3.82%	0.17%	3.06%	0.15%	0.76%	0.02%
基金合同生效日至2019年3月31日	10.50%	0.19%	5.74%	0.12%	4.76%	0.07%

十三、基金费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、账户开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费率，C类基金份额的年销售服务费率为0.40%，本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

本基金C类基金份额销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人自动于次月首日起三个工作日内从基金财产中一次性支付至登记机构，基金管理人无需再出具资金划拨指令。销售服务费由登记机构代收并按照相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述“一、基金费用的种类”中第4—10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

（五）与基金销售有关的费用

1、申购费率

（1）本基金A类基金份额在申购时收取申购费用，申购费率最高不超过0.80%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

申购金额（M）	申购费率
M < 100万	0.80%
100万 ≤ M < 300万	0.50%
300万 ≤ M < 500万	0.20%
M ≥ 500万	每笔1000元

（2）本基金C类基金份额不收取申购费用。

（3）申购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，投资人一天内有多笔申购A类基金份额的，须按每次申购所应对的费率档次分别计费。

2、赎回费率

本基金A类，C类基金份额的赎回费率见下表。

持有期间（Y）	赎回费率
Y < 7天	1.50%
7 ≤ Y < 30天	0.20%
Y ≥ 30天	0

注：本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于持有期少于7日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产，对于持有期不少于7日但少于30日的投资人收取的赎回费的25%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更，基金管理人最迟应在新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及《鹏扬汇利债券型证券投资基金基金合同》，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2019年1月8日刊登的本基金的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”部分更新了招募说明书截止日期、财务数据截止日期等相关内容；
- 2、在“第三部分 基金管理人”部分，更新了基金管理人的相关信息；
- 3、在“第四部分 基金托管人”部分，更新了基金托管人的相关信息；
- 4、在“第五部分 相关服务机构”部分，增加了新的销售机构及其相关信息，相关事项均已公告；
- 5、在“第九部分 基金的投资”部分，更新了投资范围、投资限制、基金的投资组合报告部分的相关内容；
- 6、在“第十部分 基金的业绩”部分，更新了“基金的业绩”的相关内容；
- 7、更新了“第二十二部分 其他应披露事项”这一部分内容，列示了本基金招募说明书更新期间，本基金及基金管理人的有关公告；

鹏扬基金管理有限公司

2019年7月3日