

# 鹏扬汇利债券型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告

2019 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

报告送出日期：2019 年 7 月 16 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 2019 年 7 月 12 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 2019 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|                 |  |                 |
|-----------------|--|-----------------|
| 基金简称            | 鹏扬汇利债券   |                 |
| 交易代码            | 004585   |                 |
| 基金运作方式          | 契约型、开放式  |                 |
| 基金合同生效日         | 2017 年 6 月 2 日   |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 4,461,028,467.60 份   |                 |
| 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。  |                 |
| 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。 |                 |
| 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%   |                 |
| 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。  |                 |
| 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   |                 |
| 下属分类基金的基金简称     | 鹏扬汇利债券 A   | 鹏扬汇利债券 C        |
| 下属分类基金的交易代码     | 004585   | 004586          |
| 报告期末下属分类基金的份额总额 | 4,370,065,497.38 份   | 90,962,970.22 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（2019年4月1日—2019年6月30日） |               |
|-----------------|---------------------------|---------------|
|                 | 鹏扬汇利债券 A                  | 鹏扬汇利债券 C      |
| 1. 本期已实现收益      | 63,587,323.38             | 1,775,401.47  |
| 2. 本期利润         | 39,670,727.23             | 731,956.13    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0125                    | 0.0080        |
| 4. 期末基金资产净值     | 4,705,556,466.87          | 97,615,570.62 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0768                    | 1.0731        |

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

(2) 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 本报告期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

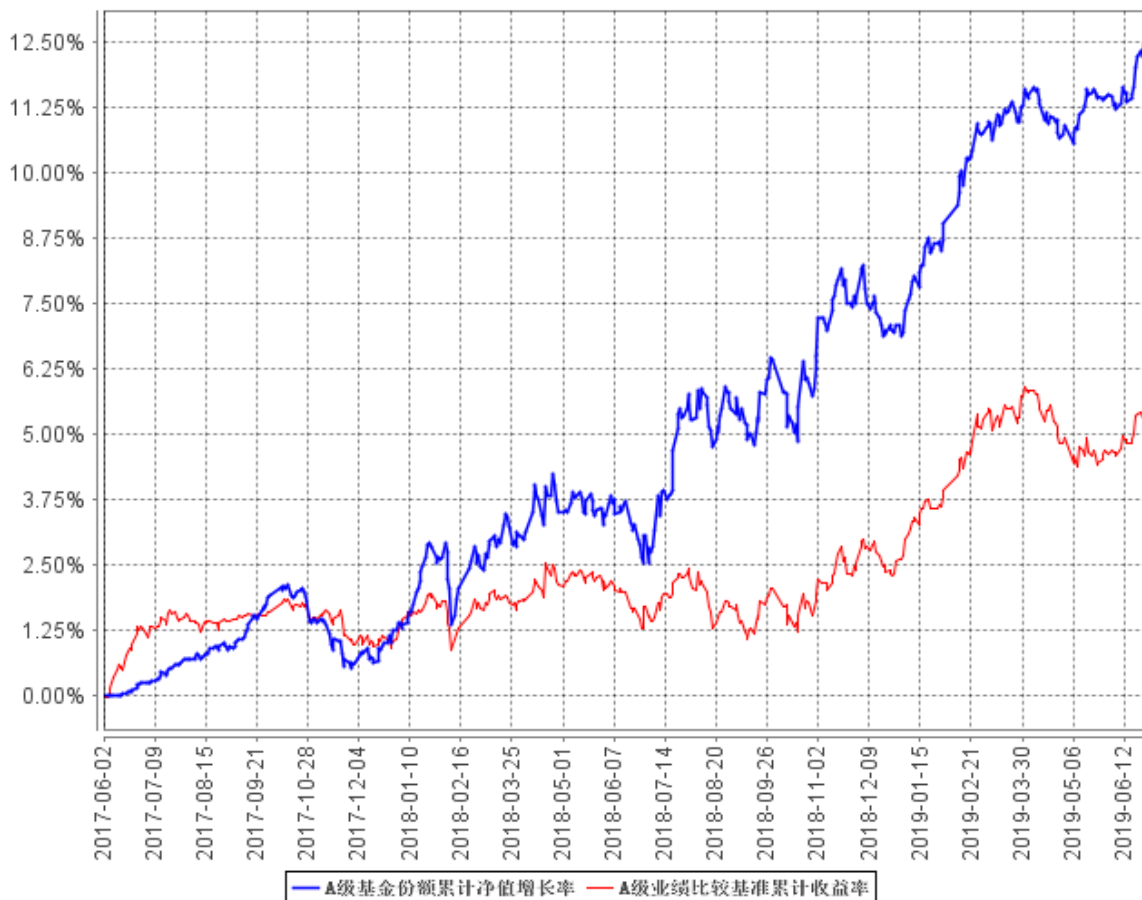
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④    |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 1.05%  | 0.13%     | -0.27%     | 0.14%         | 1.32% | -0.01% |

鹏扬汇利债券 C

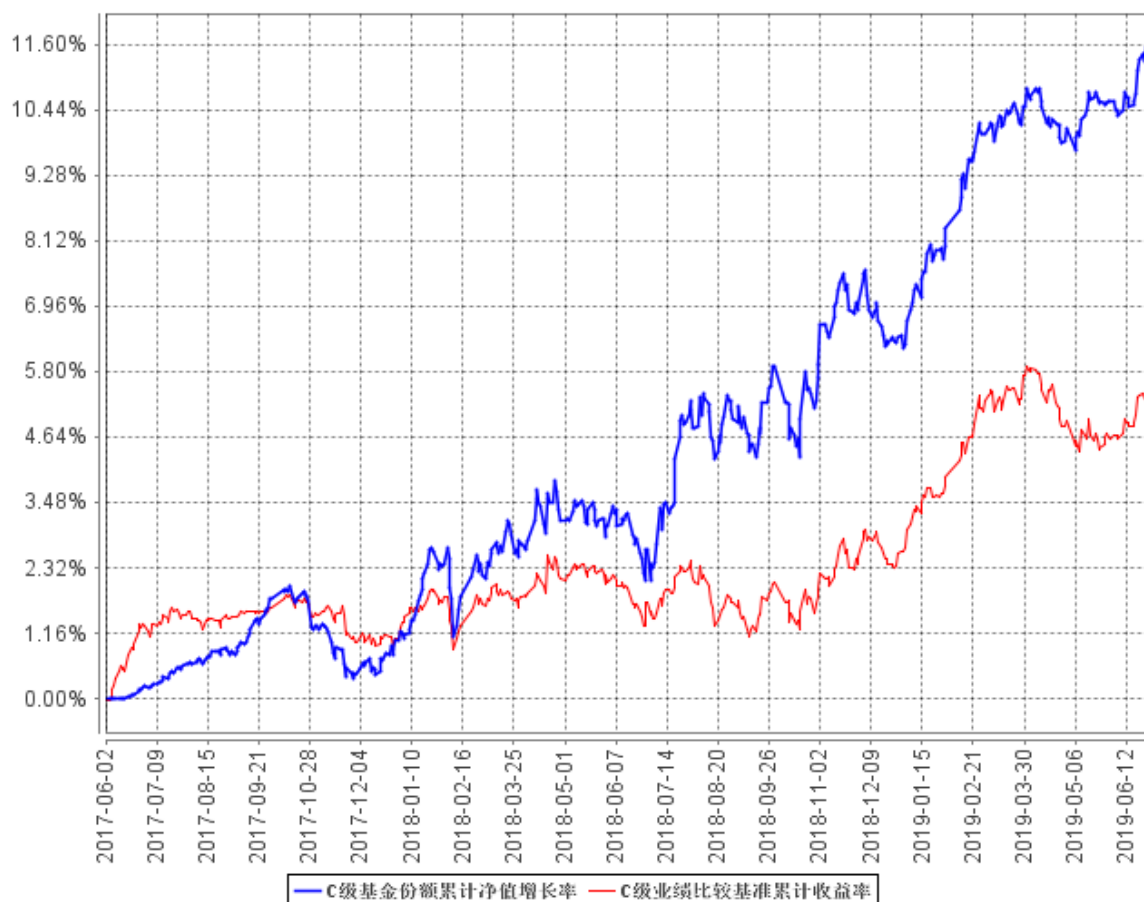
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④    |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.95%  | 0.13%     | -0.27%     | 0.14%         | 1.22% | -0.01% |

### 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



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



注：（1）上图基金净值表现及业绩比较基准截止日期为 2019 年 6 月 30 日。

（2）本基金合同于 2017 年 6 月 2 日生效。

（3）按基金合同规定，本基金的建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围，四、投资限制”的有关规定。

### 3.3 其他指标

注：无

## § 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 |        |                                     |
| 杨爱斌 | 总经理、本基金基金经理 | 2017 年 6 月 2 日 | -    | 20     | 复旦大学国际金融专业经济学硕士，曾任中国平安保险（集团）股份有限公司组 |

|    |       |                 |   |   |   |
|----|-------|-----------------|---|---|---|
|    | 理     |                 |   |   | 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等职务。自 2016 年 7 月起任鹏扬基金管理有限公司董事、总经理。2017 年 6 月 2 日至今任鹏扬汇利债券型证券投资基金基金经理；2017 年 6 月 15 日至 2019 年 1 月 4 日任鹏扬利泽债券型证券投资基金基金经理；2018 年 12 月 12 日至今任鹏扬泓利债券型证券投资基金基金经理。                                      |
| 焦翠 | 本基金经理 | 2018 年 3 月 16 日 | - | 6 | 中国人民大学金融硕士，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。2018 年 3 月 16 日至今任鹏扬景兴混合型证券投资基金、鹏扬汇利债券型证券投资基金基金经理；2018 年 8 月 23 日至今任鹏扬利泽债券型证券投资基金基金经理；2019 年 1 月 4 日至今任鹏扬泓利债券型证券投资基金基金经理；2019 年 3 月 22 日至今任鹏扬淳享债券型证券投资基金基金经理。 |

注：1. 此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为保护投资者利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合。公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《鹏扬基金管理有限公司公平交易制度》、《鹏扬基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，对公平对待公司管理的各类资产做了明确具体的规定并重视交易执行环节的公平交易措施。本报告期内，本公司公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年二季度经合组织领先指标显示，全球主要发达经济体均面临明显经济下行压力，同时通货膨胀低于预期，主要央行货币政策重新转为宽松，美联储暂停加息，市场预期下半年降息 2 次，发达经济体国债收益率大幅下行，在宽松货币政策预期下，风险资产重新大幅上涨，美股重新创出历史新高，但商品价格大幅回落。

二季度受中美贸易摩擦重新升级和货币信贷政策边际收紧影响，中国经济领先指标重新出现走弱的迹象，市场对下半年经济企稳回升的预期有所降低。从每月需求数据来看，支持中国经济增长的主要因素是房地产投资继续回升，但制造业投资持续回落，基建投资在一季度“早投放、早实施、早见效”的积极财政政策支持下，出现小幅回升迹象但面临后续乏力的压力。受减税降费政策的实施，消费需求出现回升，企业盈利增长也有所好转。通货膨胀方面，受猪肉和水果等食品价格上涨影响，CPI 出现明显回升，但核心 CPI 和 PPI 小幅回落，通货膨胀预期不强。流动性方面，4 月政治局会议后，央行适度回收流动性，但包商接管事件后，为对冲金融同业流动性收缩风险，央行通过公开市场投放巨额流动性，但流动性在大型金融机构和中小金融机构之间出现明显分层迹象，交易对手风险明显上升。

二季度债券市场先抑后扬，4 月受一季度经济增长和融资数据超预期影响，债券市场大幅调整，曲线短端受降准预期落空和流动性边际收紧大幅回升，曲线长端也出现明显回升。5 月，受

中美贸易战再次升级和不利的经济数据等刺激小幅上涨，债券市场企稳回升，6月在央行流动性重回宽松的支持下，债券市场继续回升，曲线短端下降幅度大于曲线长端。信用利差方面，5月前信用利差持续压缩，但包商事件后受同业流动性分化影响，中低评级主体信用利差明显回升。操作上，在4月初组合主要采取降久期和降杠杆，重点大幅减仓票息低的中短期商业金融债券和高等级信用债券。4月底利空债券市场的经济数据公布后，逆势逢低增仓中长期利率债券，并积极通过超长期国开债和长期利率债券的交替置换操作降低逆势建仓对组合的冲击。4月在一级市场积极申购新发行的定价较好的中高等级信用债券，获得宝贵的高票息优质信用债券持仓，组合久期重新大幅提升。5月市场大幅反弹后，兑现4月高位增仓的部分筹码，同时趁股票市场调整之际，减仓资金抄底大幅下跌的可转换债和可交换债券，提高组合的风险资产比例，但保持组合良好的抗跌性。6月初，组合出于对信用利差扩大的担忧，进一步降低组合信用资质一般的债券持仓，优化组合的信用质量，降低组合信用风险暴露。6月下旬，受持续申购影响，组合继续增仓相对低估的超长期政策性金融债券和一级市场高等级信用债券的配置。

二季度股票市场先扬后抑，大盘价值风格上证50和沪深300大幅跑赢中小盘成长风格的创业板指数和中证500指数。行业涨幅来看，以食品饮料为代表的消费股和金融股明显跑赢受贸易战冲击的TMT成长股。操作方面，组合在4月经济超预期数据公布后主要采取逐步降低权益类风险暴露的策略，降低组合Beta，清仓高价偏股转债。部分策略性减持类债券的公用事业股，继续逢低增仓银行、石油行业价值股作为底仓配置。5月减仓超额收益巨大的银行股和零售药店及医疗器械股，高点清仓黄金有色股，6月战略性低位大幅增仓传媒行业长线低估成长股和高端制造业个股。转债方面，组合5月下旬以来逢低大幅增加绝对价格低的可交换债和可转换债券和低价、正股估值很低且股价有一定价格弹性的转债，在6月底权益市场反弹过程受益于风险资产上涨。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬汇利债券A基金份额净值为1.0768元，本报告期基金份额净值增长率为1.05%；截至本报告期末鹏扬汇利债券C基金份额净值为1.0731元，本报告期基金份额净值增长率为0.95%；同期业绩比较基准收益率为-0.27%。

#### 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              | 386,229,922.61   | 7.78         |
|    | 其中：股票             | 386,229,922.61   | 7.78         |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 4,122,103,890.53 | 83.05        |
|    | 其中：债券             | 4,122,103,890.53 | 83.05        |
|    | 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          | 230,000,220.00   | 4.63         |
|    | 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      | 100,779,673.51   | 2.03         |
| 8  | 其他资产              | 124,103,966.30   | 2.50         |
| 9  | 合计                | 4,963,217,672.95 | 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              | 98,704,104.22 | 2.05         |
| C  | 制造业              | 93,673,820.44 | 1.95         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,650,000.00 | 0.28         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 58,390,132.55 | 1.22         |
| 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              | 54,374,092.80 | 1.13         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 17,070,512.60 | 0.36         |
| 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     | 50,367,260.00  | 1.05 |
| S | 综合            | -              | -    |
|   | 合计            | 386,229,922.61 | 8.04 |

注：以上行业分类以 2019 年 6 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

### 5.2.2 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标的股票。

### 5.3 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 | 18,044,626 | 98,704,104.22 | 2.05         |
| 2  | 300251 | 光线传媒 | 7,406,950  | 50,367,260.00 | 1.05         |
| 3  | 601607 | 上海医药 | 2,197,758  | 39,889,307.70 | 0.83         |
| 4  | 601939 | 建设银行 | 4,405,120  | 32,774,092.80 | 0.68         |
| 5  | 300124 | 汇川技术 | 1,255,764  | 28,769,553.24 | 0.60         |
| 6  | 300633 | 开立医疗 | 990,300    | 28,282,968.00 | 0.59         |
| 7  | 601288 | 农业银行 | 6,000,000  | 21,600,000.00 | 0.45         |
| 8  | 600196 | 复星医药 | 810,000    | 20,493,000.00 | 0.43         |
| 9  | 002027 | 分众传媒 | 3,226,940  | 17,070,512.60 | 0.36         |
| 10 | 002867 | 周大生  | 497,515    | 17,010,037.85 | 0.35         |

### 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      | 58,691,542.00    | 1.22         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 625,812,873.40   | 13.03        |
|    | 其中：政策性金融债 | 575,302,873.40   | 11.98        |
| 4  | 企业债券      | 817,447,000.00   | 17.02        |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 1,997,679,000.00 | 41.59        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 622,473,475.13   | 12.96        |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 4,122,103,890.53 | 85.82        |

**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  | 160205    | 16 国开 05       | 3,300,000 | 318,318,000.00 | 6.63         |
| 2  | 113021    | 中信转债           | 1,644,610 | 170,940,763.40 | 3.56         |
| 3  | 132009    | 17 中油 EB       | 1,073,120 | 106,120,836.80 | 2.21         |
| 4  | 1980199   | 19 深圳能源绿色债 02  | 1,000,000 | 100,400,000.00 | 2.09         |
| 5  | 101900851 | 19 华电股 MTN002A | 1,000,000 | 100,060,000.00 | 2.08         |

**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**

注：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**

注：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**

注：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国债期货交易情况说明****5.9.1 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。

**5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/ | 合约市值 | 公允价值变 | 风险指标说明 |
|----|----|--------|------|-------|--------|
|----|----|--------|------|-------|--------|

|                   | 卖) | (元) | 动(元) |            |
|-------------------|----|-----|------|------------|
| 公允价值变动总额合计(元)     |    |     |      | 0.00       |
| 国债期货投资本期收益(元)     |    |     |      | 205,048.54 |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) |    |     |      | 0.00       |

注 1: 买入持仓量以正数表示, 卖出持仓量以负数表示。

注 2: 本期国债期货投资本期收益为未扣手续费收益。

### 5.9.3 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。

### 5.10 投资组合报告附注

#### 5.10.1 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

中信转债(113021.SH)为鹏扬汇利债券型证券投资基金的前十大持仓证券。中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)作为江苏宏图高科技股份有限公司(以下简称“宏图高科”)相关债务融资工具的主承销商, 在后续管理工作中存在以下违反银行间市场自律管理规则的行为: 一、宏图高科于 2018 年 11 月 26 日披露了《江苏宏图高科技股份有限公司关于“15 宏图 MTN001”与投资人达成一致的的公告》, 其中“已与‘15 宏图 MTN001’全部投资人就延期兑付方案达成一致”的表述与实际不符。中信银行作为“15 宏图 MTN001”的主承销商, 在知悉上述不真实内容的情况下, 未督导发行人就不真实内容予以纠正, 对发行人的督导职责履行不到位。二、中信银行于 2018 年 12 月 6 日召集召开了“18 宏图高科 SCP002”持有人会议, 相关召集公告披露不及时, 持有人会议议案披露不完整。三、2018 年 9 月和 11 月, 宏图高科主体评级下调事项触发了“18 宏图高科 SCP002”投资者保护的事先约束条款, 中信银行作为召集人未及时召开持有人会议。依据相关自律规定, 经 2019 年第 4 次自律处分会议审议, 给予中信银行通报批评处分, 责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

本基金投资中信转债的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除中信转债外, 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。

**5.10.2 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**

注：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。

**5.10.3 其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额（元）          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 275,383.11     |
| 2  | 应收证券清算款 | -              |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 50,307,584.54  |
| 5  | 应收申购款   | 73,520,998.65  |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 124,103,966.30 |

**5.10.4 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  | 132009 | 17 中油 EB | 106,120,836.80 | 2.21         |
| 2  | 132013 | 17 宝武 EB | 99,747,115.80  | 2.08         |
| 3  | 132008 | 17 山高 EB | 19,028,982.00  | 0.40         |
| 4  | 113019 | 玲珑转债     | 17,033,483.70  | 0.35         |
| 5  | 113008 | 电气转债     | 12,785,953.60  | 0.27         |
| 6  | 110048 | 福能转债     | 5,569,000.00   | 0.12         |
| 7  | 123004 | 铁汉转债     | 4,473,067.69   | 0.09         |
| 8  | 128046 | 利尔转债     | 4,424,376.60   | 0.09         |
| 9  | 132011 | 17 浙报 EB | 2,729,104.00   | 0.06         |
| 10 | 127007 | 湖广转债     | 1,994,445.14   | 0.04         |
| 11 | 113518 | 顾家转债     | 1,601,734.20   | 0.03         |

**5.10.5 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情况。

**5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

注：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                        | 鹏扬汇利债券 A         | 鹏扬汇利债券 C       |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 2,953,096,894.65 | 122,729,760.33 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,772,614,185.20 | 26,700,213.52  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 355,645,582.47   | 58,467,003.63  |
| 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               | 4,370,065,497.38 | 90,962,970.22  |

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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

注：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

注：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

注：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

注：无

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准鹏扬汇利债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬汇利债券型证券投资基金基金合同》；

3. 《鹏扬汇利债券型证券投资基金基金托管协议》；
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

2019 年 7 月 16 日