

鹏扬汇利债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 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：2020 年 4 月 22 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 2020 年 4 月 20 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 2020 年 1 月 1 日起至 3 月 31 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	9,087,576,889.58 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	8,169,332,381.52 份	918,244,508.06 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（2020年1月1日—2020年3月31日）	
	鹏扬汇利债券 A	鹏扬汇利债券 C
1. 本期已实现收益	141,863,070.72	12,007,643.27
2. 本期利润	147,069.66	-4,935,468.37
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0000	-0.0065
4. 期末基金资产净值	8,690,350,976.79	974,242,045.14
5. 期末基金份额净值	1.0638	1.0610

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

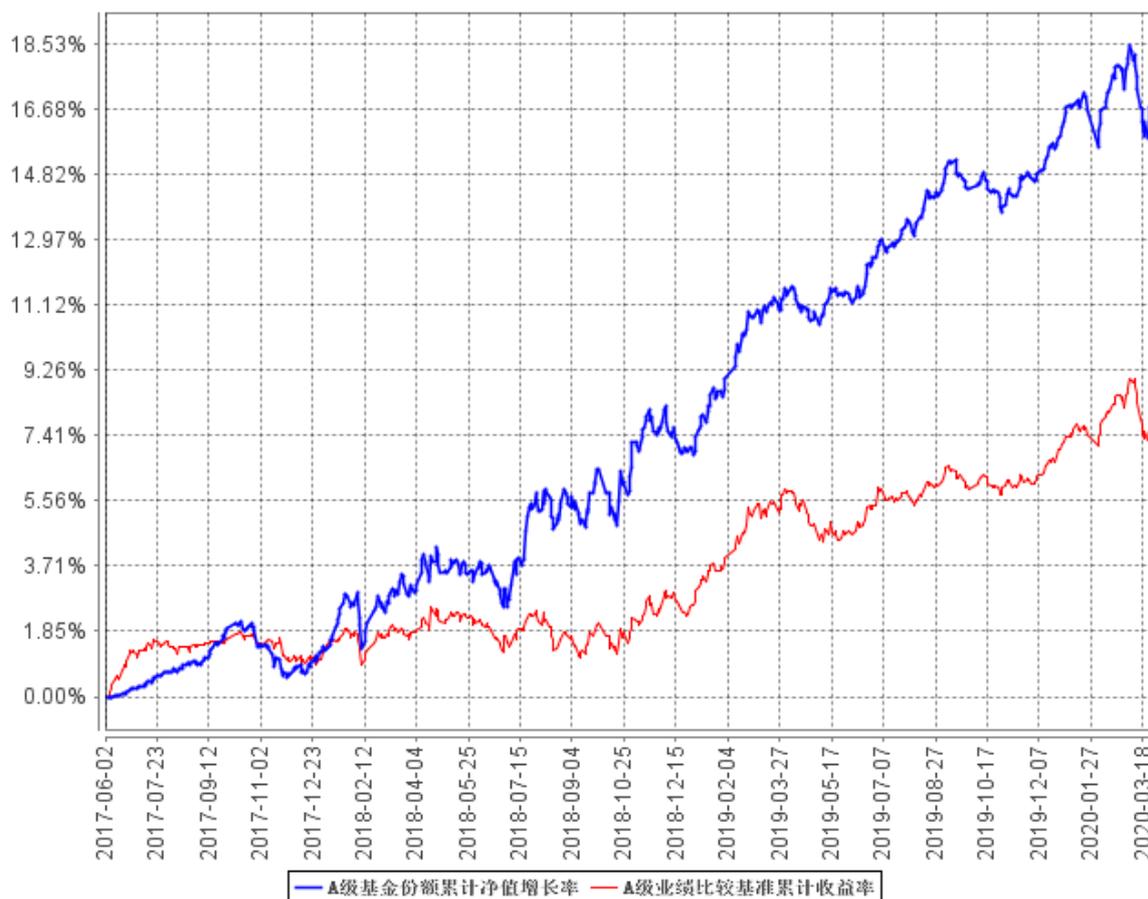
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.15%	0.25%	0.70%	0.16%	-0.55%	0.09%

鹏扬汇利债券 C

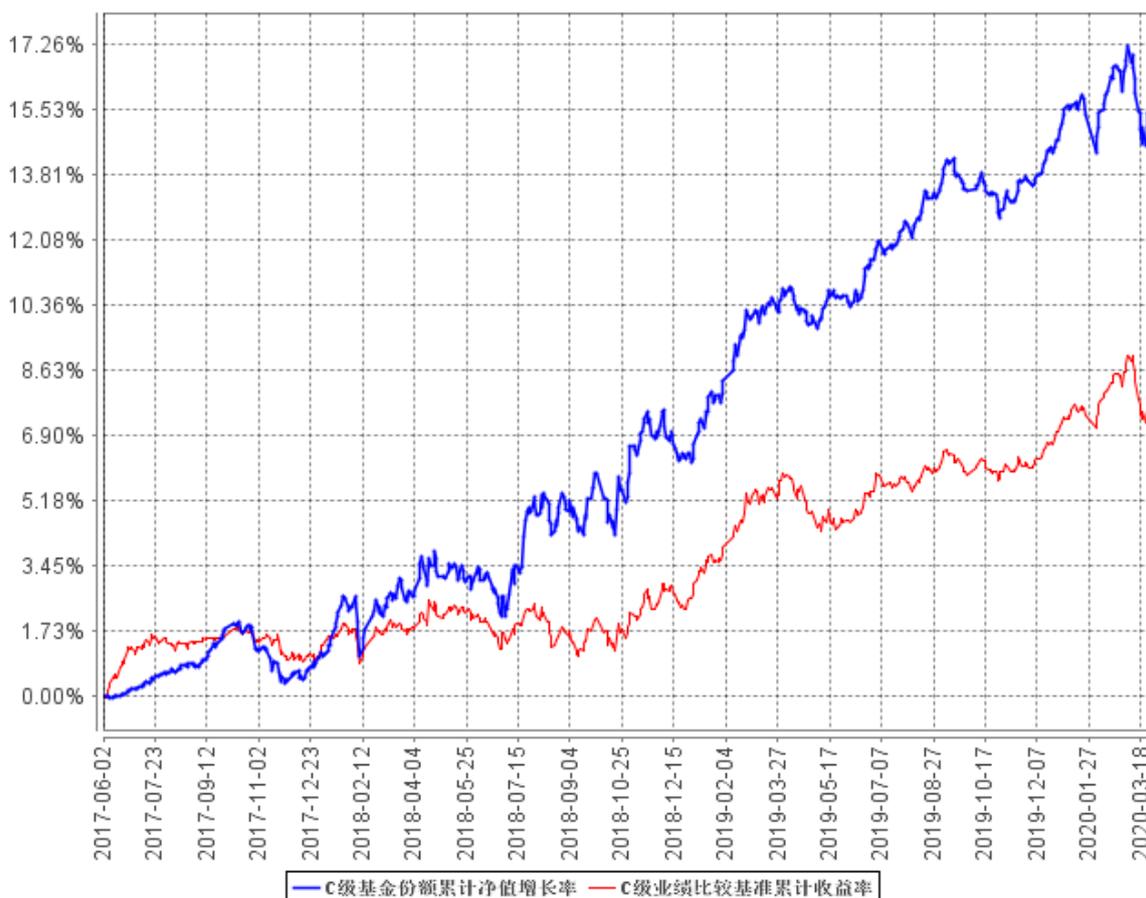
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.06%	0.25%	0.70%	0.16%	-0.64%	0.09%

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 2020 年 3 月 31 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	-	21	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。2019 年 8 月 15 日至今任鹏扬景欣混合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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《鹏扬基金管理有限公司公平交易制度》、《鹏扬基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，对公平对待公司管理的各类资产做了明确具体的规定并重视交易执行环节的公平交易措施。本报告期内，本公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，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

2020 年受新冠病毒疫情冲击，全球经济逆转企稳复苏格局，呈现大幅回落并陷入技术性衰退格局。受 3 月以来海外疫情快速扩散影响，主要发达经济体的股票市场普遍出现 30%左右的大幅下跌，同时原油价格受需求下降和沙俄价格战供给冲击暴跌幅度超过 60%，全球金融市场陷入大幅波动之中，风险偏好下降到历史极低水平。全球主要央行货币政策重回大幅宽松，美联储大幅降息 150BP 重回零利率，并且重启量化宽松规模不设上限，欧央行、日本央行重启量化宽松。3 月 26 日，全球 G20 会议，20 国宣布推出 5 万亿美元的政策刺激计划，期待稳定全球经济和金融市场。

2020 年一季度中国经济增长大概率为负增长。从 1-2 月数据上看，代表需求的固定资产投资和社会零售实际累计同比分别为 -24.5%和-23.7%，代表产出的 1-2 月工业增加值同比回落至 -13.5%。通货膨胀方面，受食品价格影响，2020 年 1-2 月我国 CPI 同比上涨 5.2%仍处于较高水平，但 3 个月环比折年率为 5.6%明显回落；非食品 CPI 同比上涨 0.9%，核心 CPI 同比上涨 1.0%，服务 CPI 同比上涨 0.6%，上述指标均较前值大幅回落，物价将逐步回落。2020 年 2 月我国工业生产者出厂价格指数（PPI）同比下降 0.4%，其中生产资料价格指数同比下降 1.0%。考虑到 3 月以

来石油价格暴跌，工业品通货紧缩风险有所上升。流动性方面，央行连续降准并结合公开市场操作保持流动性合理充裕，政策利率方面，央行下调公开市场操作利率 30BP，并将超额存款准备金利率从 0.72% 下降为 0.35%。

一季度债券市场大幅上涨，收益率曲线呈牛陡格局。3 年以内中短端品种受央行降准预期和宽松流动性支持，短端下行 60-70BP 左右，10 年以上长端下行幅度约 50-60BP。信用利差方面，除 1 年 AAA 品种受流动性支持，利差下降 10BP。受信用债券净供给大幅加大影响，AA+ 及以上的中高等级信用债券利差扩大约 15-20 BP 左右，AA 及以下的中低等级信用债券受经济下行压力和风险偏好下降，利差扩大 20-30BP。

操作上，本基金一季度规模继续稳步增长，考虑到货币政策总体保持宽松，组合主要执行中短端高等级信用债券杠杆套息策略。申购资金主要通过一级市场逢低增持定价有保护的 3-5 年高等级信用债券、二级市场增仓有明显相对价值的短期纯债性的可交换债券和 1 年左右高等级信用债券，1 年内行权的有博弈价值的可转债。在债券市场持续超预期上涨的过程中总体采取了逐步止盈降低组合久期的操作策略。在 3 月海外疫情爆发后高点全部清仓卖出组合持有的 30 年国债，逢高减仓组合持仓的剩余期限为 7-10 年高等级信用债券和 20 年铁道债。衍生品策略方面，在海外金融市场动荡引发国内债券市场流动性冲击的背景下，低位增加国债期货多头套保，适度提升组合久期，季末国债期货主力 T 合约受央行降低公开市场操作利率利好刺激回到月初高点，平仓多头套保。季末，组合降低久期到 1.7 年左右，杠杆水平提高到 15% 以上。

转债方面，坚持执行逢高减仓组合持仓的医药、信息技术、化工、汽车、电气设备等行业的中高溢价、中高绝对价格的可转换债券，取得较好的资本利得收益。在 3 月市场暴跌时期增仓新能源等行业可转换债券，并在反弹中止盈出局。考虑短期回购利率的持续下降，在季末战略性增仓到期收益率接近 2% 的大盘银行转债，提升组合可转换债券配置比例。

一季度股票市场先涨后跌，宽幅震荡，指数分化严重。大盘价值风格上证 50 和沪深 300 分别下跌 12.2% 和 10.02%，而中小盘成长风格的创业板指数和中小板指数上涨 4.1% 和下跌 1.94%。从行业板块来看，受益疫情防控的医药、政策刺激的新基建的通讯、线上经济的计算机、建筑材料以及农林牧渔等板块明显上涨。受风险偏好下降和疫情冲击的金融、周期、可选消费、休闲服务等大幅下跌，估值水平不断压缩。操作方面，组合主要增仓方向是受益于逆周期刺激政策逻辑下的绝对估值水平极低的国有股份制银行股、龙头地产股、基建股、业绩高增长但错杀的传媒股以及业绩继续稳步增长的消费股。主要减仓方向是受油价暴跌冲击的能源股、受益于疫情短期股价涨幅较大的医药股、黄金股以及一季度业绩可能低于预期的计算机等成长行业个股。对预计一季度业绩超预期的龙头证券股、代表市场成长方向的新能源、医疗信息化、计算机服务等科技成长个

股进行了低位增仓高位卖出的波段操作，获得较好的超额收益。低位适度增仓具备长线投资价值的电子股，保持组合一定的进攻性。考虑到股票的长期配置价值好于债券，低位提高组合权益仓位水平到基准以上，但持仓以低估值低贝塔的大盘价值股为主，总体权益风险波动可控。

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 1.0638 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.15%；截至本报告期末鹏扬汇利债券 C 基金份额净值为 1.0610 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.06%；同期业绩比较基准收益率为 0.70%。

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	1,689,462,498.64	14.85
	其中：股票	1,689,462,498.64	14.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,342,623,678.92	82.13
	其中：债券	9,342,623,678.92	82.13
	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	100,268,968.64	0.88
8	其他资产	243,551,521.08	2.14
9	合计	11,375,906,667.28	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	246,050,174.00	2.55
C	制造业	228,647,958.90	2.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,591,600.00	0.09
E	建筑业	117,201,970.01	1.21
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	102,000,000.00	1.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,150,730.09	0.22
J	金融业	835,347,369.64	8.64
K	房地产业	87,685,345.80	0.91
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	42,787,350.20	0.44
S	综合	-	-
	合计	1,689,462,498.64	17.48

注：以上行业分类以 2020 年 3 月 31 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	55,541,800	246,050,174.00	2.55
2	601328	交通银行	40,031,044	206,560,187.04	2.14
3	601939	建设银行	28,841,399	182,854,469.66	1.89
4	601818	光大银行	43,069,925	155,482,429.25	1.61
5	601668	中国建筑	22,239,463	117,201,970.01	1.21
6	601006	大秦铁路	15,000,000	102,000,000.00	1.06

7	600000	浦发银行	9,968,758	101,182,893.70	1.05
8	000002	万科 A	3,418,532	87,685,345.80	0.91
9	000725	京东方 A	22,000,000	81,620,000.00	0.84
10	600030	中信证券	3,000,000	66,480,000.00	0.69

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	57,914,760.00	0.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	584,833,894.60	6.05
	其中：政策性金融债	564,339,894.60	5.84
4	企业债券	1,540,640,400.00	15.94
5	企业短期融资券	1,222,683,000.00	12.65
6	中期票据	4,946,083,000.00	51.18
7	可转债（可交换债）	990,468,624.32	10.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,342,623,678.92	96.67

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	101766012	17 大唐集 MTN005	2,500,000	256,700,000.00	2.66
2	132013	17 宝武 EB	2,424,620	247,286,993.80	2.56
3	012000360	20 中化股 SCP004	2,000,000	200,020,000.00	2.07
4	101658004	16 陕高速 MTN001	1,700,000	172,006,000.00	1.78
5	110059	浦发转债	1,449,940	154,012,626.80	1.59

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/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）					1,828,834.95
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

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

光大银行（601818.SH）为鹏扬汇利债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2020 年 2 月 10 日中国人民银行针对光大银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款 1820 万元。主要违法违规事实如下：（一）未按规定履行客户身份识别义务；（二）未按规定保存客户身份资料和交易记录；（三）未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告；（四）与身份不明的客户进行交易。2019 年

12 月 27 日中国银行保险监督管理委员会针对光大银行存在以下主要违法违规事实,处以罚款 180 万元。主要违法违规事实如下:(一)授信审批不审慎;(二)为还款来源不清晰的项目办理业务;(三)总行对分支机构管控不力承担管理责任。

浦发转债(110059.SH)为鹏扬汇利债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2019 年 6 月 24 日中国银行保险监督管理委员会针对上海浦东发展银行存在以下主要违法违规事实,处以罚款合计 130 万元。主要违法违规事实如下:(一)对成都分行授信业务及整改情况严重失察;(二)重大审计发现未向监管部门报告;(三)轮岗制度执行不力。

建设银行(601939.SH)为鹏扬汇利债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2019 年 12 月 27 日中国银行保险监督管理委员会针对建设银行存在以下主要违法违规事实,处以罚款合计 80 万元。主要违法违规事实如下:(一)用于风险缓释的保证金管理存在漏洞;(二)国别风险管理不完善。

交通银行(601328.SH)为鹏扬汇利债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2019 年 12 月 27 日中国银行保险监督管理委员会针对交通银行存在以下主要违法违规事实,处以罚款合计 150 万元。主要违法违规事实如下:(一)授信审批不审慎;(二)总行对分支机构管控不力承担管理责任。2019 年 5 月 10 日中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对交通银行上海分行在 2016 年 10 月至 11 月期间,该分行超过某借款人实际资金需求发放贷款情况,责令改正,并处罚款 50 万元。

本基金投资光大银行、浦发转债、建设银行、交通银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除光大银行、浦发转债、建设银行、交通银行外,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

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	603,179.24
2	应收证券清算款	91,858,359.44
3	应收股利	-
4	应收利息	139,804,190.96
5	应收申购款	11,285,791.44

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	
9	合计	243,551,521.08

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	132013	17 宝武 EB	247,286,993.80	2.56
2	113021	中信转债	130,200,000.00	1.35
3	132015	18 中油 EB	128,327,729.40	1.33
4	110053	苏银转债	61,964,951.40	0.64
5	132009	17 中油 EB	46,172,164.20	0.48
6	127011	中鼎转 2	23,592,000.00	0.24
7	132008	17 山高 EB	19,655,685.00	0.20
8	113026	核能转债	16,357,681.20	0.17
9	128065	雅化转债	15,661,964.52	0.16
10	110057	现代转债	11,944,553.20	0.12
11	128028	赣锋转债	9,986,099.28	0.10
12	110048	福能转债	5,862,500.00	0.06
13	128058	拓邦转债	4,540,633.30	0.05
14	132011	17 浙报 EB	2,850,526.00	0.03
15	127012	招路转债	757,260.00	0.01
16	110051	中天转债	620,241.60	0.01
17	113025	明泰转债	549,628.20	0.01
18	113022	浙商转债	320,212.00	0.00
19	128057	博彦转债	303,960.00	0.00
20	113534	鼎胜转债	235,643.20	0.00
21	110056	亨通转债	218,952.00	0.00
22	113024	核建转债	209,925.10	0.00
23	110052	贵广转债	206,625.00	0.00
24	127013	创维转债	157,027.00	0.00
25	128075	远东转债	148,135.00	0.00
26	110058	永鼎转债	142,821.00	0.00
27	113530	大丰转债	129,686.20	0.00
28	123023	迪森转债	122,554.00	0.00
29	110055	伊力转债	81,095.70	0.00

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	6,991,795,511.86	437,612,216.26
报告期期间基金总申购份额	3,580,590,875.45	857,100,645.94
减：报告期期间基金总赎回份额	2,403,054,005.79	376,468,354.14
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	8,169,332,381.52	918,244,508.06

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

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

2020 年 4 月 22 日