

# 鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 28 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 10 月 26 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏扬聚利六个月债券
基金主代码	008501
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 1 月 20 日
报告期末基金份额总额	1,188,899,036.21 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、适度的杠杆投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略以及港股通标的股票投资策略等。本基金投资中将根据对宏观经济周期和市场环境的持续跟踪以及对经济政策的深入分析，灵活运用上述策略，构建债券组合并进行动态调整，以达成投资目标。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*5%+恒生指数收益率*5%。
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。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	招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	鹏扬聚利六个月债券 A	鹏扬聚利六个月债券 C
下属分级基金的交易代码	008501	008502
报告期末下属分级基金的份额总额	504,467,646.15 份	684,431,390.06 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7月1日—2020年9月30日）	
	鹏扬聚利六个月债券 A	鹏扬聚利六个月债券 C
1. 本期已实现收益	25,900,842.48	37,372,652.45
2. 本期利润	32,605,097.16	50,044,354.29
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0434	0.0448
4. 期末基金资产净值	521,726,707.12	705,882,847.49
5. 期末基金份额净值	1.0342	1.0313

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、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

鹏扬聚利六个月债券 A

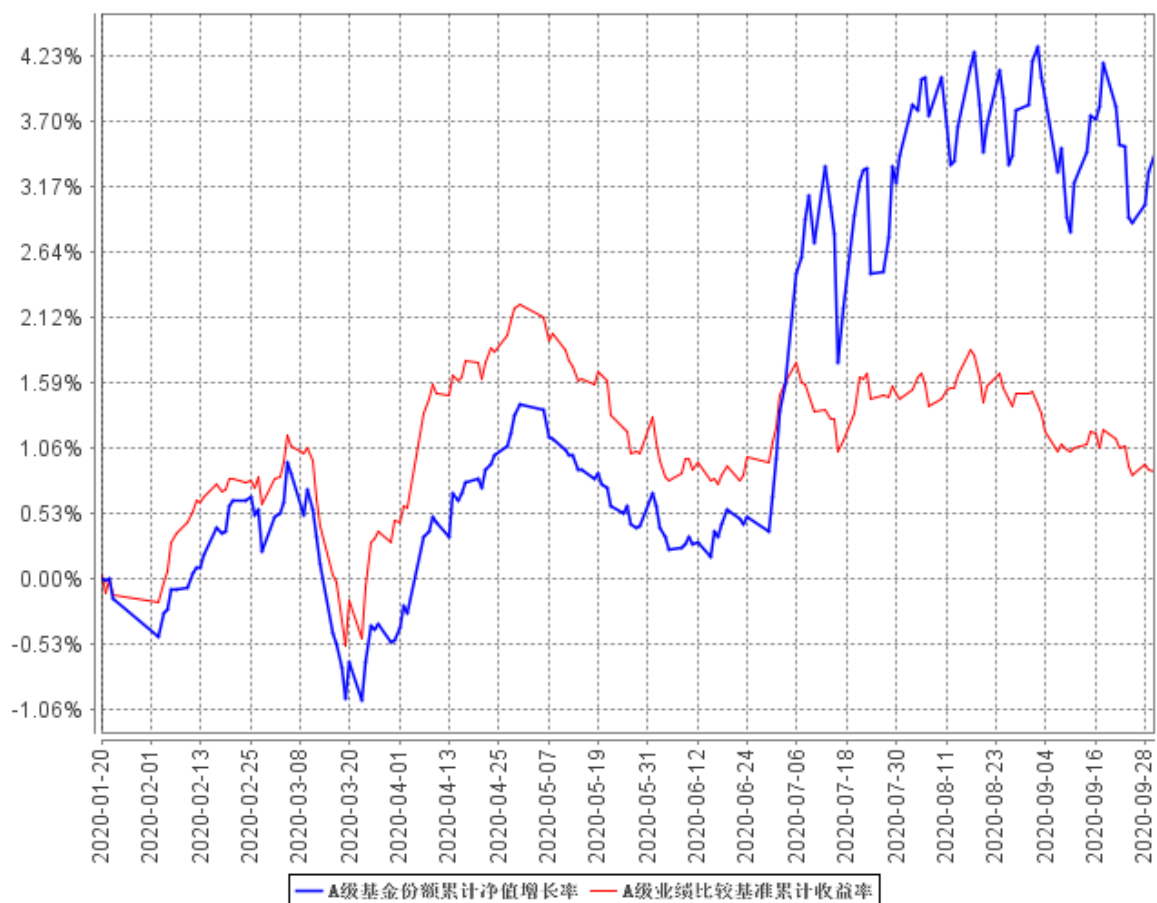
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.74%	0.36%	-0.22%	0.11%	2.96%	0.25%
过去六个月	3.93%	0.28%	0.40%	0.13%	3.53%	0.15%
自基金合同生效起至今	3.42%	0.26%	0.88%	0.14%	2.54%	0.12%

鹏扬聚利六个月债券 C

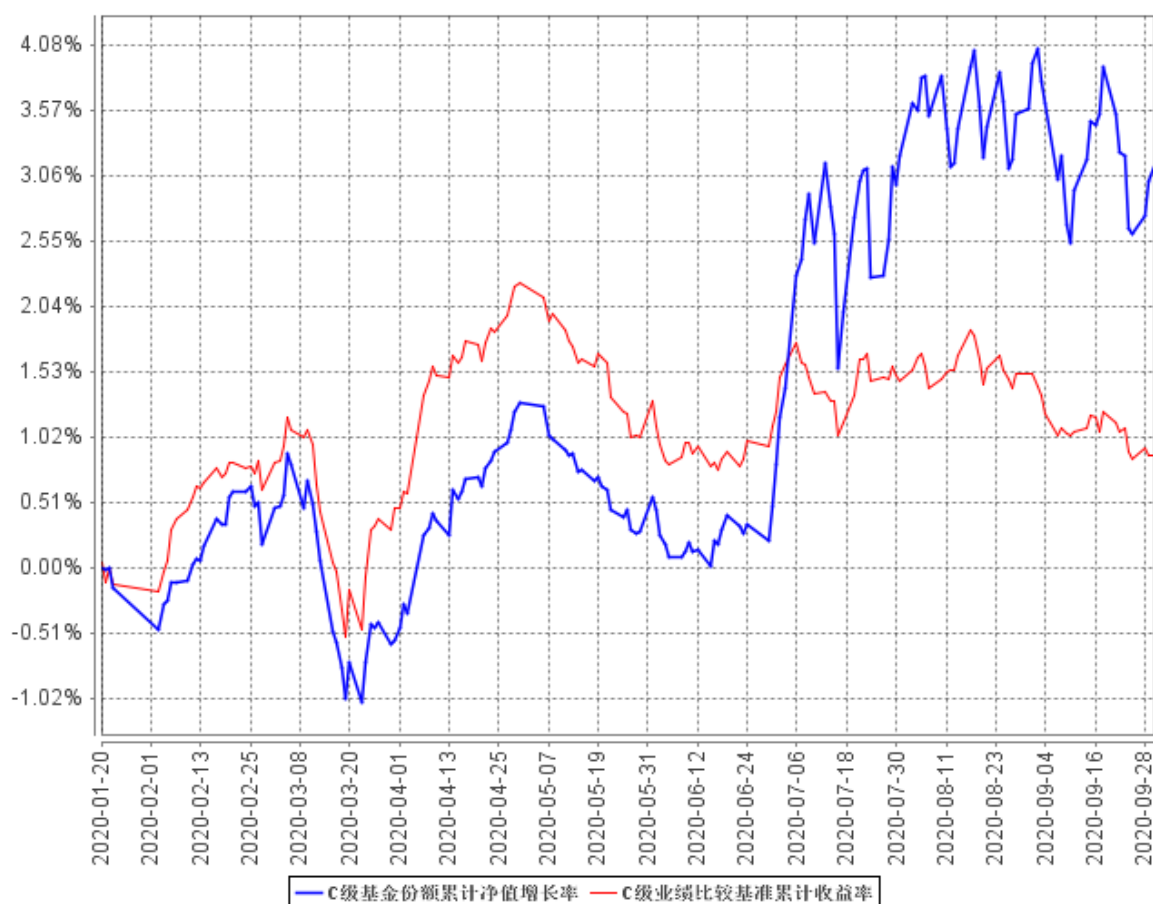
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.64%	0.36%	-0.22%	0.11%	2.86%	0.25%
过去六个月	3.72%	0.28%	0.40%	0.13%	3.32%	0.15%
自基金合同生效起至今	3.13%	0.26%	0.88%	0.14%	2.25%	0.12%

### 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 9 月 30 日。

（2）本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

（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。

## § 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		
李刚	副总经理、本基金基金经理	2020 年 1 月 20 日	-	18	中国社科院经济学博士，曾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。现任鹏扬基金管理有限公司副总经理。2019 年 1 月 4 日至 2020 年 3 月 20 日任鹏扬利泽债券型证券投资基金基金经理，

					2020 年 1 月 20 日至今任鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金基金经理，2020 年 3 月 16 日至今任鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金基金经理，2020 年 4 月 21 日至今任鹏扬景恒六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 24 日至今任鹏扬景惠六个月持有期混合型证券投资基金。
李沁	固定收益部利率及高等级策略总监、本基金基金经理	2020 年 1 月 20 日	-	7	北京大学西方经济学硕士、香港大学金融学硕士。曾任中债资信评估有限公司信用分析师、北京鹏扬投资管理有限公司信用分析师，鹏扬基金管理有限公司专户投资部信用分析师、投资组合经理、投资经理。现任鹏扬基金管理有限公司固定收益部利率及高等级策略总监。2019 年 8 月 29 日至今任鹏扬淳盈 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 12 日至今任鹏扬双利债券型证券投资基金基金经理。2020 年 1 月 20 日至今任鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金基金经理。2020 年 2 月 19 日至今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 4 月 21 日至今任鹏扬景恒六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 24 日至今任鹏扬景惠六个月持有期混合型证券投资基金。
张望	股票投资部副总监、本基金基金经理	2020 年 3 月 20 日	-	10	清华大学生物系理学硕士，曾任华夏基金管理有限公司化工行业研究员、研究部周期组组长，海宁拾贝投资管理合伙企业（有限合伙）

					周期组组长、基金经理。现任鹏扬基金管理有限公司股票投资部副总监、基金经理。2020 年 3 月 20 日至今任鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金基金经理。2020 年 7 月 2 日至今任鹏扬景惠六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 7 日至今任鹏扬景泓回报灵活配置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遵规守信情况的说明

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

三季度以来，全球疫情防控有所缓解但仍未出现拐点，美国、巴西、印度等国家新增确诊病例继续维持高位，进入 9 月甚至出现二次反弹态势，全球经济仍面临疫情带来的负面冲击，预计主要发达经济体经济增长在三季度仍难以转正但领先经济指标出现复苏趋势。货币政策方面，全球主要央行在二季度采取了宽松货币政策，在三季度总体货币政策没有进一步宽松进入观察期。美联储推出“平均通货膨胀目标制”的新货币政策框架。财政政策方面，美国两党围绕新一轮的财政刺激计划展开激烈的政治博弈；欧盟达成 7500 亿欧元的复兴基金计划，这是欧元区从宽货币转向宽财政的重要标志。全球金融市场总体平稳，中美两国股票市场涨幅较好，美元指数大幅走弱导致黄金、铜等硬商品大幅上涨，大豆、玉米等软商品价格也出现大幅上涨行情。债券方面，除人民币债券下跌外，全球主要债券市场均呈现上涨态势。

二季度中国经济在宽松货币政策和积极财政政策支持下大幅回升到 3.2% 的水平，同时通货膨胀水平稳步下降到 2.4%。进入三季度，货币政策边际收紧，银行间隔夜和 7 天回购利率水平在逐步回升到央行公开市场操作利率水平之上。信贷和社会融资总量扩张方面在宽信贷和宽财政的政策支持下继续维持较高的增长速度。从最新公布的一系列经济指标来看，三季度中国经济在房地产投资、基建投资和超预期的出口数据的支持下回升到 4.9% 的水平。

三季度债券市场持续走弱，中债综合全价指数下跌 1.48%。收益率曲线呈现熊市变平格局。1-5 年期限国债利率平均上升幅度约 50BP，7 年以上中长期国债利率上行幅度约 30-40BP。信用债券方面，1-3 年期限的 AAA 和 AA+ 信用债券利率上行幅度约 50BP，5 年期限利率上行幅度约 30BP。以国开债券为衡量标准，信用利差水平整体呈现压缩趋势。

三季度债券操作主要以中低久期防守操作为主。具体而言，7 月初在组合开放变现和对债市短端调整的双重考虑下，月初积极降低久期和仓位，组合久期从月初的 1.15 年下降至下旬的 0.57 年，此后随着赎回回升到 0.9 年附近。8 月久期主要维持在 0.9 年左右，其中上旬小幅加仓，中旬减仓，把握了波段机会。9 月提升组合久期到 1.55 年，主要加仓方向是一级市场部分定价较为合理的 3 年 AAA 信用债和相对价值较好、具有凸性保护的 30 年国债，同时为了控制组合总仓位和久期，减持了部分 1 年政金债和存单。转债方面，整体仓位在组合规模下降后被动提升，从季度初的 6.76% 提升至 13.89%，在持仓结构上 7 月将银行转债换仓为成长类转债；8 月持仓结构趋于均衡，主要持仓银行、券商为主，分散持有周期、成长类品种；9 月小幅减仓。整体看，纯债部分维持中低久期、以获取票息为主的策略符合市场主线，同时，维持中性以上的转债持仓为组合收益提供了增强。

三季度股票市场大幅回升，但行业分化严重。大盘价值风格上证 50 和沪深 300 分别上涨 9.87% 和 10.17%，代表中小盘成长风格的创业板指数和中小板指数大幅上涨 5.6% 和 8.19%。从行业板块来看，



受益于免税政策的休闲服务、国防军工、光伏设备、新能源汽车、食品饮料等继续涨幅居前，但通讯、计算机、传媒、医药等跌幅居前，银行、地产等偏周期板块在 7 月初短暂大幅估值修复后持续回落，季度涨幅继续落后。

股票方面，三季度我们主要减持了季度初上涨比较多的银行地产，此外把二季度加仓的消费和医药做了减持。从八月份底到 9 月份持续在加仓，加仓的方面主要是三个方面：1、顺周期，行业改善的行业，包括汽车、家电、化工、工程机械；2、科技行业，包括消费电子，新能源汽车，光伏；3、低估值，基本面明显改善的大金融，包括券商和保险。目前货币政策上虽然没有再放松，但是信用没有明显收缩，随着中美关系在美国大选后缓和以及人民币升值，会使得外资在四季度流入的概率比较大，从流动性上看四季度会相对宽松。从基本面上看，三季度顺周期行业会很有不错的复苏，并且复苏可以持续到明年上半年，而大部分顺周期行业估值也不是很高，所以有不错的机会。所以在配置上，主要是顺周期+科技+大金融，并且往年四季度会有低估值企业的估值切换的机会，值得关注。仓位上，在 8 月中旬做过一次建仓，在十一之前将仓位重新提升到中等偏上，继续看好四季度的投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬聚利六个月债券 A 基金份额净值为 1.0342 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.74%；截至本报告期末鹏扬聚利六个月债券 C 基金份额净值为 1.0313 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.64%；同期业绩比较基准收益率为-0.22%。

#### 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	212,515,344.62	13.61
	其中：股票	212,515,344.62	13.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,287,271,556.09	82.44
	其中：债券	1,287,271,556.09	82.44
	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	38,748,914.27	2.48
8	其他资产	22,953,427.92	1.47
9	合计	1,561,489,242.90	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 15,287,104.15 元，占期末基金资产净值比例为 1.25%。

## 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	164,468,483.19	13.40
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	1,514,940.00	0.12
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	7,425,046.28	0.60
J	金融业	23,819,771.00	1.94
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	197,228,240.47	16.07

### 5.2.2 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	2,686,906.08	0.22
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-

F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	908,596.48	0.07
I 电信服务	11,691,601.59	0.95
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	15,287,104.15	1.25

注：以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	601633	长城汽车	1,146,428	21,919,703.36	1.79
2	002475	立讯精密	236,131	13,490,164.03	1.10
3	002460	赣锋锂业	186,000	10,079,340.00	0.82
3	01772	赣锋锂业	81,000	2,686,906.08	0.22
4	000333	美的集团	150,900	10,955,340.00	0.89
5	000100	TCL 科技	1,623,300	9,983,295.00	0.81
6	600519	贵州茅台	5,900	9,844,150.00	0.80
7	600176	中国巨石	576,896	8,330,378.24	0.68
8	603659	璞泰来	76,200	8,274,558.00	0.67
9	601066	中信建投	165,600	8,250,192.00	0.67
10	300059	东方财富	314,000	7,532,860.00	0.61

### 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	45,758,000.00	3.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,146,000.00	4.08
	其中：政策性金融债	50,146,000.00	4.08
4	企业债券	458,606,000.00	37.36
5	企业短期融资券	60,066,000.00	4.89
6	中期票据	472,439,000.00	38.48
7	可转债（可交换债）	200,256,556.09	16.31
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,287,271,556.09	104.86

### 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	101563010	15 渝富 MTN002	1,000,000	101,020,000.00	8.23
2	175037	20 中证 17	1,000,000	99,820,000.00	8.13
3	101772015	17 大唐集 MTN003	800,000	80,872,000.00	6.59
4	101755029	17 陕煤化 MTN003	600,000	60,702,000.00	4.94
5	136014	15 福投债	600,000	60,036,000.00	4.89

### 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）					3,106.80
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

### 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

20 中证 17(175037.SH)、中信转债(113021.SH)为鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金的前十大持仓证券。交易商协会自律处分信息（2020 年第 5 次自律处分会议审议决定）：中信证券股份有限公司作为债务融资工具主承销商，在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本。依据相关自律规定，经 2020 年第 5 次自律处分会议审议，对中信证券予以警告，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。

中信转债(113021.SH)为鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2020 年 4 月 20 日中国银行保险监督管理委员会针对中信银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款合计 160 万元。中信银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：（一）理财产品数量漏报；（二）信贷资产转让业务漏报；（三）贸易融资业务漏报；（四）分户账明细记录应报未报；（五）分户账账户数据应报未报；（六）关键且应报字段漏报或填报错误。2020 年 2 月 20 日北京银保监局针对中信银行存在以下主要违法违规事实，责令中信银行股份有限公司改正，并给予合计 2020 万元罚款的行政处罚。主要违法违规事实如下：（一）中信银行股份有限公司违规发放土地储备贷款；（二）受托支付不符合监管规定；（三）信托消费贷款业务开展不审慎；（四）流动资金贷款被挪用于股权投资；（五）信贷资金被挪用流入房地产开发公司；（六）个人经营性贷款资金被挪用于购房；（七）非真实转让不良信贷资产；（八）未对融资人交易材料合理性进行必要的审查，资金被用于缴纳土地竞买保证金；（九）违规为房地产开发企业发放流动资金性质融资；（十）签署抽屉协议互投涉房信贷资产腾挪信贷规模；（十一）卖出回购信贷资产收益权，实现信贷规模阶段性出表；（十二）理财资金违规投向未上市房地产企业股权；（十三）理财资金被挪用于支付土地出让价款；（十四）违规向资本金不足的房地产开发项目提供融资；（十五）并购贷款真实性审核不足，借款人变相用于置换项目公司缴纳的土地出让价款；（十六）协助合作机构签署抽屉协议，规避相关监管规定；（十七）理财资金实际用于置换项目前期股东支付的土地出让金；（十八）违规为房地产企业支付土地购置费用提供融资；（十九）违规向四证不全的商业性房地产开发项目提供融资。

本基金投资 20 中证 09、中信转债的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 20 中证 09、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

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	387,482.67
2	应收证券清算款	3,855,387.74
3	应收股利	430.43
4	应收利息	18,710,127.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,953,427.92

### 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	113021	中信转债	50,388,900.60	4.10
2	110059	浦发转债	33,987,382.00	2.77
3	110053	苏银转债	30,849,012.20	2.51
4	132015	18 中油 EB	29,821,241.80	2.43
5	128065	雅化转债	19,381,170.69	1.58
6	113011	光大转债	7,776,120.00	0.63
7	127005	长证转债	6,468,000.00	0.53
8	110064	建工转债	6,310,357.20	0.51
9	128090	汽模转 2	2,306,000.00	0.19
10	128021	兄弟转债	283,528.08	0.02
11	113542	好客转债	136,396.20	0.01

### 5.10.5 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。

### 5.10.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏扬聚利六个月债券 A	鹏扬聚利六个月债券 C
报告期期初基金份额总额	1,248,269,333.07	1,961,988,245.92
报告期期间基金总申购份额	9,987,841.03	15,256,938.35
减：报告期期间基金总赎回份额	753,789,527.95	1,292,813,794.21
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	504,467,646.15	684,431,390.06

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。

## § 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

单位：份

项目	鹏扬聚利六个月债券 A	鹏扬聚利六个月债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期间买入/申购总份额	5,804,953.56	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,804,953.56	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.15	-

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	转换入	2020 年 8 月 27 日	5,804,953.56	6,000,000.00	-
合计			5,804,953.56	6,000,000.00	

注：根据本基金招募说明书相关规定，A 类基金份额申购金额大于等于 500 万元时，按固定费用每笔 1000 元收取申购费。上述适用此标准的交易，按此规定执行。

## § 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

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. 中国证监会核准鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬聚利六个月持有期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. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 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 10 月 28 日