

鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告

2021 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：2021 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 2021 年 4 月 21 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 2021 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	2,630,007,912.20 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	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	1,033,249,336.48 份	1,596,758,575.72 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 (2021 年 1 月 1 日 — 2021 年 3 月 31 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	13,515,939.83	20,631,763.54
2. 本期利润	-13,176,876.66	-20,249,029.39
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0141	-0.0137
4. 期末基金资产净值	1,123,947,164.13	1,728,654,804.28
5. 期末基金份额净值	1.0878	1.0826

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	-0.70%	0.40%	0.92%	0.15%	-1.62%	0.25%
过去六个月	5.18%	0.36%	3.51%	0.12%	1.67%	0.24%
过去一年	9.32%	0.32%	3.92%	0.13%	5.40%	0.19%
自基金合同 生效起至今	8.78%	0.30%	4.42%	0.14%	4.36%	0.16%

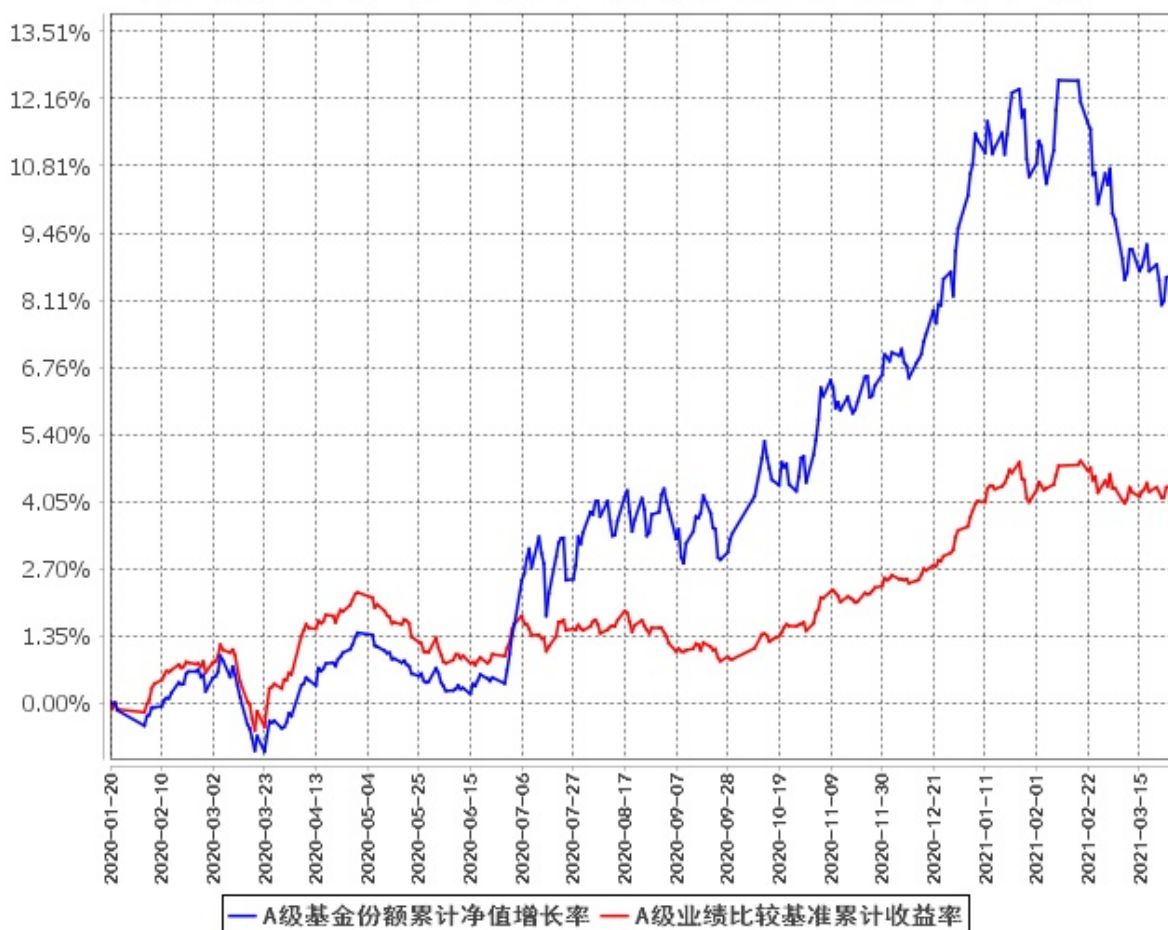
鹏扬聚利六个月债券 C

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	-0.80%	0.40%	0.92%	0.15%	-1.72%	0.25%
过去六个月	4.97%	0.36%	3.51%	0.12%	1.46%	0.24%

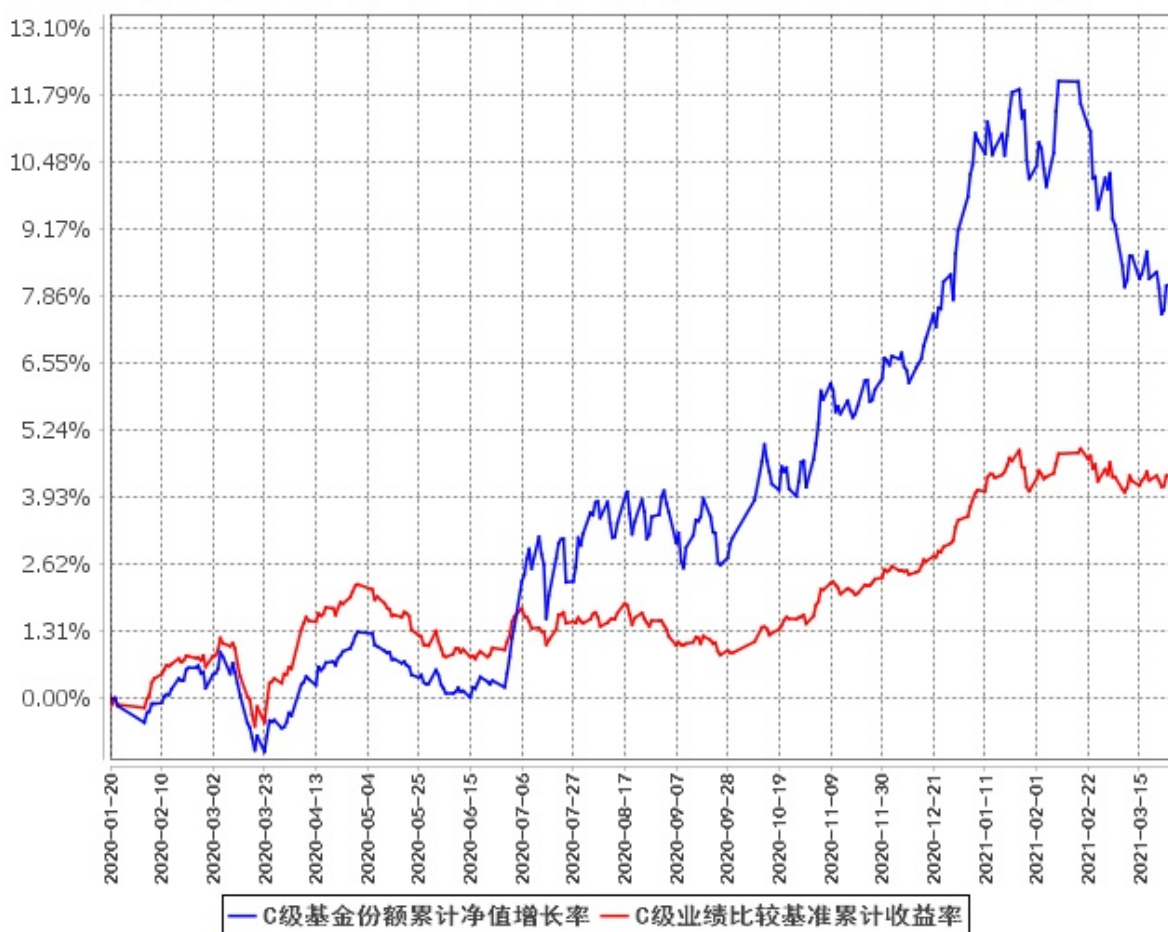
过去一年	8.88%	0.32%	3.92%	0.13%	4.96%	0.19%
自基金合同生效起至今	8.26%	0.30%	4.42%	0.14%	3.84%	0.16%

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 2021 年 3 月 31 日。

(2) 本基金合同于 2020 年 1 月 20 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	本基金基金经理, 副总经理	2020 年 1 月 20 日	-	18	中国社会科学院经济学博士，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

				<p>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；2020 年 11 月 4 日至今任鹏扬景合六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 1 月 12 日至今任鹏扬景明一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 3 月 9 日至今任鹏扬景源一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 3 月 23 日至今任鹏扬景安一年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p>
李沁	本基金基金经理, 固定收益部利率及高等级策略总监	2020 年 1 月 20 日	-	<p>7</p> <p>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</p>

				<p>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基金经理；2020 年 11 月 4 日至今任鹏扬景合六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 3 月 23 日至今任鹏扬景安一年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p>
张望	本基金基金经理, 股票投资部副总监	2020 年 3 月 20 日	-	<p>11</p> <p>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；2020 年 11 月 27 日至今任鹏扬景创混合型证券投资基金基金经理。</p>

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年 1 季度，在超预期的出口增长和房地产投资的支持下，中国经济继续保持温和扩张向好趋势，实现了 18.3% 的高速增长；通货膨胀方面，CPI 和 PPI 同比保持低位，但环比总体回升，市场对通货膨胀回升的担忧有所上升；流动性方面，央行通过灵活适度的公开市场操作，逐步实现了货币政策的正常化，货币市场流动性先紧后松；信用扩张方面，1-2 月社会融资总量增速仍超市场预期保持在较高水平，但在宏观稳杠杆的预期下，预计今年社会融资总量增速逐步见顶。

2021 年 1 季度，债券市场继续维持弱势震荡格局，中债综合全价指数小幅上涨 0.2%。年初受资金面较紧和通货再膨胀预期升温影响，债券市场快速调整；本季度末受资金面重回宽松、股票市场大幅调整、外围环境变化等多重因素影响，债券市场小幅回升。收益率曲线变化整体呈现小幅熊市变平格局。信用利差方面，受流动性和政策支持的影响，信用市场整体利差有所收窄，但信用市场

继续分化，低评级信用债券流动性风险和利差扩大风险继续上升。

债券操作方面，本基金本报告期内灵活参与波段交易，1 季度以来组合整体久期在 1-2.5 年区间内波动。具体而言，1 月初资金面从去年底的宽松状态逐步转紧，我们采取了逢高减仓逐步获利了结的操作，将久期从 2.5 年左右降低至 1.5 年左右，2 月继续降低至 1 年左右，同时降低了组合的杠杆。3 月份在资金面宽松、风险资产下跌等因素的综合影响下，我们判断债券有阶段性的交易机会，于是将组合久期重新提升至 2-2.5 年。在具体品种方面，本基金本报告期内进行了结构调整，减持了信用利差保护不足或资质偏弱的信用债券，增持了绝对收益率较高的银行永续债。可转债方面，组合总体策略是逢高减仓，降低转债的风险暴露。

2021 年 1 季度，股票市场受流动性趋紧和通货膨胀预期上升影响冲高回落，基金抱团股明显下跌，价值风格大幅领先成长风格。代表大盘价值风格的上证 50 指数和沪深 300 指数分别下跌 2.78% 和 3.13%；代表中小盘成长风格的创业板指数和中小板指数分别下跌 7.00% 和 6.86%。从行业板块来看，受益于“碳达峰和碳中和”主题的钢铁、公用事业和后疫情的休闲服务以及低估值顺周期的银行、建筑装饰等行业涨幅居前；而国防军工、非银金融、通信、计算机等行业跌幅居前。

权益操作方面，本基金本报告期内整体上仓位逐渐下降，资产配置向顺周期行业倾斜。具体来看，我们在 1 月初保持了比较高的仓位，在指数震荡时期，开始进行缓慢减仓，向业绩更确定和景气度更高的行业做了倾斜，减持了较多军工和银行股、部分非银股及适量的光伏和新能源股票，加仓了机械和化工股。另外，我们也配置了港股中性价比较好、2021 年有增长的消费、互联网和制造业行业的股票，提升了组合中港股的占比。2 月份组合仓位整体维持小幅略降，主要是降低了估值较高板块，如光伏、新能源汽车的持仓，增持了化工、机械等受益于 PPI 上行、在 1-2 季度有较好业绩的行业股票，在标的的选择上也以业绩导向为主。3 月份组合继续小幅减仓，结构没有太多变化。

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 的基金份额净值为 1.0878 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.70%；截至本报告期末鹏扬聚利六个月债券 C 的基金份额净值为 1.0826 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.80%；同期业绩比较基准收益率为 0.92%。

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	359,352,134.76	10.42
	其中：股票	359,352,134.76	10.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,939,530,185.06	85.22
	其中：债券	2,939,530,185.06	85.22
	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	110,226,323.84	3.20
8	其他资产	40,099,960.22	1.16
9	合计	3,449,208,603.88	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 34,013,170.37 元，占期末基金资产净值比例为 1.19%。

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	11,100,518.00	0.39
C	制造业	219,596,236.71	7.70
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	7,904,680.00	0.28
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	4,363,468.00	0.15
J	金融业	77,373,577.68	2.71
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	2,257,220.00	0.08
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	2,743,264.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	325,338,964.39	11.40

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	8,726,584.92	0.31
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	4,277,540.50	0.15
D 能源	-	-
E 金融	13,921,940.19	0.49
F 医疗保健	3,969,506.20	0.14
G 工业	3,117,598.56	0.11
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	34,013,170.37	1.19

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	601166	兴业银行	1,718,601	41,401,098.09	1.45
2	002460	赣锋锂业	186,000	17,532,360.00	0.61
2	01772	赣锋锂业	108,800	8,726,584.92	0.31
3	000001	平安银行	1,036,559	22,814,663.59	0.80
4	601636	旗滨集团	1,515,100	19,590,243.00	0.69
5	601012	隆基股份	205,700	18,101,600.00	0.63
6	300750	宁德时代	55,700	17,944,869.00	0.63
7	600519	贵州茅台	8,100	16,272,900.00	0.57
8	002415	海康威视	264,000	14,757,600.00	0.52
9	01398	工商银行	2,952,000	13,921,940.19	0.49
10	600176	中国巨石	615,996	11,827,123.20	0.41

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	585,267,000.00	20.52
2	央行票据	-	-

3	金融债券	411,035,000.00	14.41
	其中：政策性金融债	150,683,000.00	5.28
4	企业债券	760,634,580.00	26.66
5	企业短期融资券	310,368,000.00	10.88
6	中期票据	696,677,000.00	24.42
7	可转债（可交换债）	78,528,605.06	2.75
8	同业存单	97,020,000.00	3.40
9	其他	-	-
10	合计	2,939,530,185.06	103.05

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	200016	20 付息国债 16	2,800,000	281,932,000.00	9.88
1	019646	20 国债 16	600,000	60,402,000.00	2.12
2	210002	21 付息国债 02	1,400,000	140,308,000.00	4.92
3	2128012	21 浦发银行 01	1,400,000	140,014,000.00	4.91
4	101800450	18 皖投集 MTN001	1,200,000	121,044,000.00	4.24
5	200215	20 国开 15	1,000,000	100,640,000.00	3.53

注：对于同时在交易所和银行间上市的债券，合并计算公允价值参与排序，并按照不同市场分别披露投资明细。

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

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

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

报告期内基金投资的前十名证券除 20 中证 17(175037), 21 浦发银行 01(2128012), 20 国开 15(200215), 21 国君 S2(163862), 21 中国银行 CD015(112104015), 21 光大银行小微债(2128010)外其他证券的发行主体本期未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。中国银行间市场交易商协会对中信证券股份有限公司启动自律调查, 中国证券业协会 2020 年 7 月 19 日对中信证券股份有限公司启动自律调查, 中国证监会 2020 年 12 月 24 日对中信证券股份有限公司进行处罚, 深圳证监局 2021 年 02 月 10 日对中信证券股份有限公司进行处罚(深圳证监局[2021]5 号), 国家外汇管理局上海市分局 2020 年 11 月 26 日对上海浦东发展银行股份有限公司进行处罚(上海汇管罚字【2020】20200007 号), 中国银保监会消费者权益保护局 2020 年 04 月 16 日对上海浦东发展银行股份有限公司进行处罚(银保监消保发(2020)4 号), 上海银保监局 2020 年 08 月 10 日对上海浦东发展银行股份有限公司进行处罚(沪银保监银罚决字(2020)12 号), 银保监会 2020 年 12 月 25 日对国家开发银行进行处罚(银保监罚决字(2020)67 号), 国家外汇管理局北京外汇管理部 2020 年 10 月 26 日对国家开发银行进行处罚(京汇罚(2020)33 号), 国家外汇管理局北京外汇管理部 2020 年 10 月 26 日对国家开发银行进行处罚(京汇罚(2020)32 号), 福建证监局 2020 年 04 月 30 日对国泰君安证券股份有限公司进行处罚(福建证监局[2020]13 号), 中国证券业协会对国泰君安证券股份有限公司启动自律调查, 上海证监局 2020 年 11 月 10 日对国泰君安证券股份有限公司进行处罚(沪证监决[2020]173 号), 银保监会 2020 年 12 月 01 日对中国银行股份有限公司进行处罚(银保监罚决字(2020)60 号), 银保监会 2020 年 04 月 20 日对中国银行股份有限公司进行处罚(银保监罚决字(2020)4 号), 中国银行间市场交易商协会对中国光大银行股份有限公司进行处罚, 中国银行间市场交易商协会 2020 年第 18 次自律处分会议审议决定对中国光大银行股份有限公司进行处罚, 中国银行间市场交易商协会 2020 年第 11 次自律处分会议审议决定对中国光大银行股份有限公司进行处罚, 国家外汇管理局北京外汇管理部 2020 年 08 月 25 日对中国光大银行股份有限公司进行处罚(京汇罚(2020)18 号), 银保监会 2021 年 02 月 03 日对中国光大银行股份有限公司进行处罚(银保监消保发(2021)3 号), 国家外汇管理局北京外汇管理部 2020 年 10 月 20 日对中国光大银行股份有限公司进行处罚(京汇罚(2020)30 号), 国家外汇管理局北京外汇管理部 2020 年 10 月 20 日对中国光大银行股份有限公司进行处罚(京汇罚(2020)29 号), 银保监会 2020 年 04 月 20 日对中国光大银行股份有限公司进行处罚(银保监罚决字(2020)5 号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作, 上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

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	236,470.71
2	应收证券清算款	507,051.58
3	应收股利	-
4	应收利息	37,886,985.63
5	应收申购款	1,469,452.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,099,960.22

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	132015	18 中油 EB	30,303,243.60	1.06
2	110053	苏银转债	26,058,723.60	0.91
3	113011	光大转债	5,753,680.00	0.20
4	127005	长证转债	5,736,500.00	0.20

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	764,230,690.45	1,211,436,948.87
报告期期间基金总申购份额	354,513,234.42	502,734,516.36
减：报告期期间基金总赎回份额	85,494,588.39	117,412,889.51
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	1,033,249,336.48	1,596,758,575.72

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

	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	5,804,953.56	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
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 (%)	0.22	-

7.2 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。

§ 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. 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

2021 年 4 月 22 日