

鹏扬泓利债券型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 21 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 19 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|--|--------------------|
| 基金简称 | 鹏扬泓利债券 | |
| 基金主代码 | 006059 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018 年 12 月 12 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 5,160,732,511.56 份 | |
| 投资目标 | 本基金在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者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 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 鹏扬泓利债券 A | 鹏扬泓利债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 006059 | 006060 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,650,933,596.87 份 | 2,509,798,914.69 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 4 月 1 日 — 2021 年 6 月 30 日) | |
|-----------------|--|------------------|
| | 鹏扬泓利债券 A | 鹏扬泓利债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 35,874,805.03 | 29,013,524.79 |
| 2. 本期利润 | 11,913,083.74 | 8,073,160.69 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0045 | 0.0035 |
| 4. 期末基金资产净值 | 2,813,902,078.31 | 2,658,903,215.28 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0615 | 1.0594 |

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

鹏扬泓利债券 A

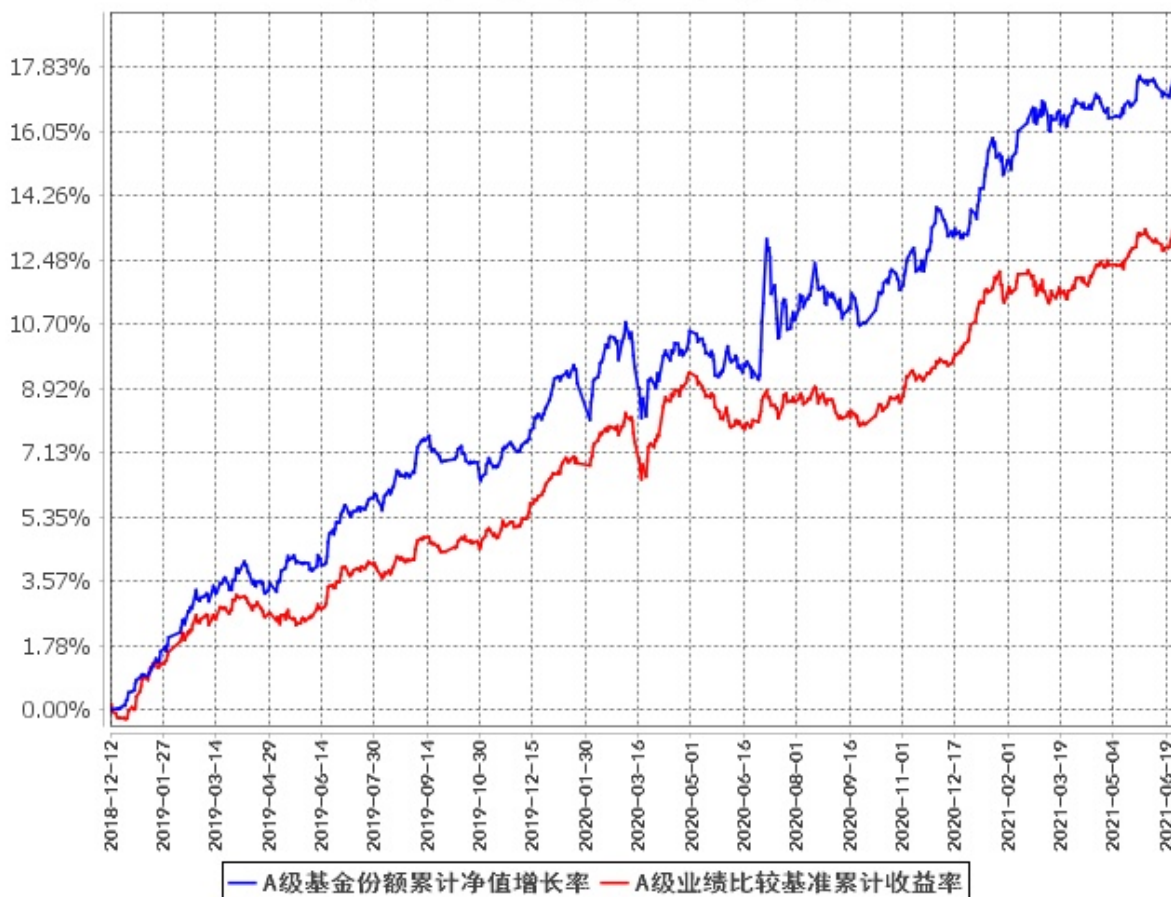
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基准 收益率③ | 业绩比较基准收 益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.44% | 0.11% | 1.39% | 0.09% | -0.95% | 0.02% |
| 过去六个月 | 3.00% | 0.17% | 2.31% | 0.12% | 0.69% | 0.05% |
| 过去一年 | 7.31% | 0.23% | 4.71% | 0.11% | 2.60% | 0.12% |
| 自基金合同 生效起至今 | 17.28% | 0.19% | 13.25% | 0.12% | 4.03% | 0.07% |

鹏扬泓利债券 C

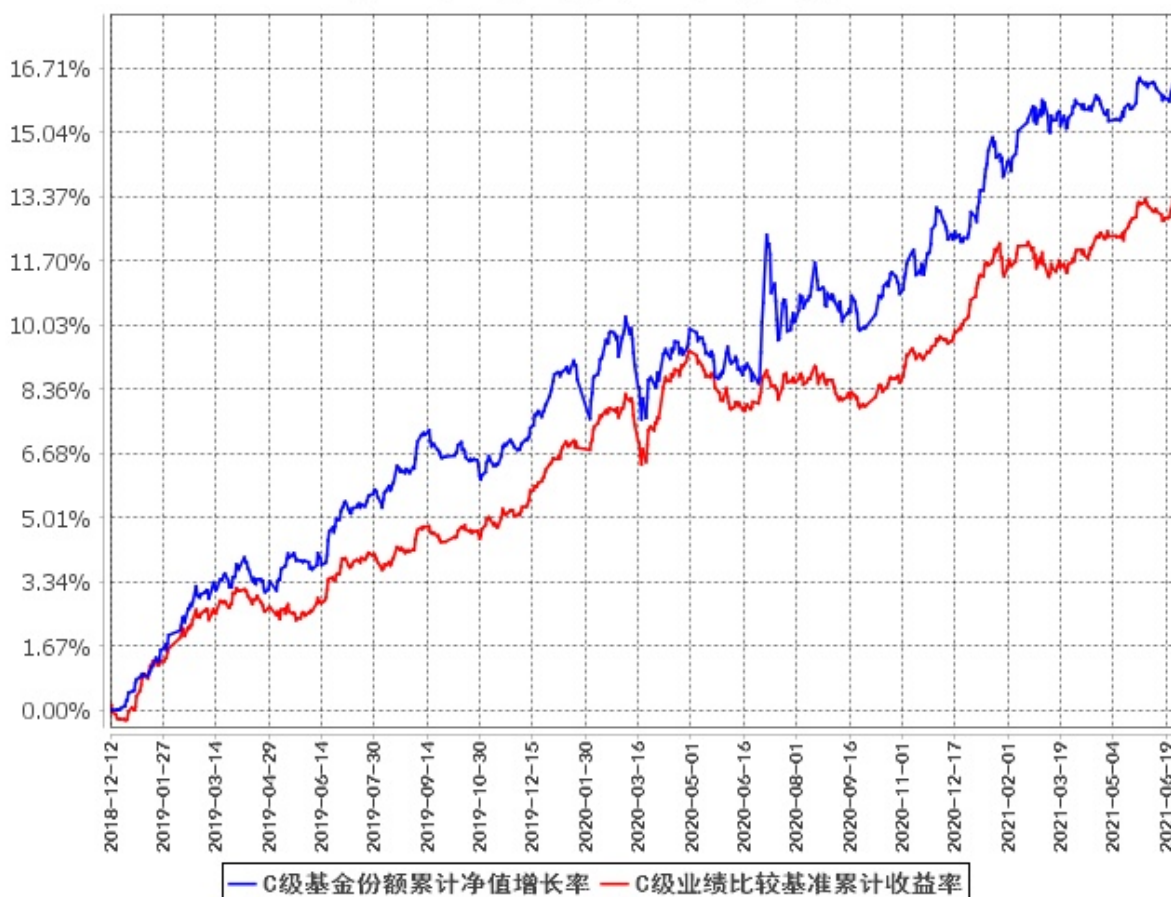
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基准 收益率③ | 业绩比较基准收 益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.34% | 0.11% | 1.39% | 0.09% | -1.05% | 0.02% |
| 过去六个月 | 2.79% | 0.17% | 2.31% | 0.12% | 0.48% | 0.05% |
| 过去一年 | 6.88% | 0.23% | 4.71% | 0.11% | 2.17% | 0.12% |
| 自基金合同 生效起至今 | 16.12% | 0.19% | 13.25% | 0.12% | 2.87% | 0.07% |

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
(2018年12月12日至2021年6月30日)**



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
(2018年12月12日至2021年6月30日)



§ 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 | 本基金基金经理, 总经理 | 2018年12月12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；2020 年 8 月 11 日至今任鹏扬景沅六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。 |
| 焦翠 | 本基金基金经理 | 2019 年 1 月 4 日 | - | 7 | 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，现任鹏扬基金管理有限公司现金管理部基金经理。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；2021 年 3 月 18 日至今任鹏扬景创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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年 2 季度，全球经济总体处于分步复苏状态，美国经济受疫情缓解和拜登财政刺激政策影响复苏进程明显加快。中国经济增长在出口和房地产投资的支持下仍处于扩张周期，但受上游原材料价格大幅上涨和财政支出后置的影响，总需求增长出现小幅放缓迹象；通货膨胀方面，CPI 同比保持低位，PPI 同比大幅上升并保持高位，通货膨胀上行风险有所扩大但总体可控；流动性方面，通过央行灵活适度的公开市场操作，总体保持中性偏宽松局面；信用扩张方面，受票据短贷、企业债、政府债、非标的压缩影响，2 季度社会融资规模存量增速快速回落，对总需求扩张带来不利影响。

2021 年 2 季度，债券市场触底回升，中债综合全价指数小幅上涨 0.45%。市场回升主要有两个驱动因素，其一，4 月政治局会议明确提出“要用好稳增长压力较小的窗口期”和“要防范化解经济金融风险”，政策方向从“稳增长”转为“深化供给侧结构性改革”；其二，专项债发行进度延后和信用债券市场的净发行减少导致债券市场供不应求。受短期资金面较为宽松的影响，收益率曲线整体呈现小幅牛市变陡格局。信用利差方面，在资产荒背景下，信用市场整体利差进一步收窄，部分 AA(2) 城投债下行幅度较大，推动中低等级利差有所收窄。

操作方面，本季度组合总体执行保持低久期和提升组合信用质量的防御型投资策略。组合在利率品种上操作不多，主要是以超短久期高质量的 SCP 作为填仓或流动性管理，同时增仓部分中上资质区域的优质城投债，逐步减持部分产业投资类国有企业债券，不断提升组合在极端情况下信用质量的风险防范能力。可转债方面，组合总体操作不多，主要持有纯债溢价率不高的大盘银行类转债作为防御，持有中低价位和低转股溢价的有色转债作为进攻。

2021 年 2 季度，全球股票市场“再通胀”交易降温，美债收益率明显下行和美国经济复苏前景推动美国大型科技股票大幅回升。国内股票市场 A 股成长风格大幅跑赢价值风格，代表大盘价值风格的上证 50 指数下跌 1.15%，沪深 300 指数上涨 3.48%；代表中小盘成长风格的创业板指数和中小板指数分别上涨 26.05%和 11.29%。从行业板块来看，新能源、半导体、生物医药等科技成长行业景气度较高，业绩增长预期较快，行业涨幅居前；而受损于上游成本大幅上涨的家电，受政策不利影响的房地产、建筑装饰和受猪价明显下跌影响的农林牧渔等行业跌幅居前。

操作方面，本季度组合总体执行逐步降低权益仓位和行业结构调整策略。组合继续超配银行股，主要逢低增仓低位滞涨、安全边际高、具有一定负贝塔属性的国有大行作为低配债券资产的替代，同时兼顾对冲组合持有的成长风格资产波动风险，对持仓的股份制银行进行了个股调整。组合逢低回补了 1 季度卖出但受益于长期通货膨胀风险上行估值较低的保险股。周期股方面，组合逐步减仓化工股。消费股方面，组合减仓涨幅达到止盈目标的啤酒股，增仓估值合理的优质白马消费股。科技成长股方面，组合 4 月份增仓新能源和超跌的电子股，6 月随着新能源大幅回升，逐步执行止盈操作，逢低增仓优质估值合理的港股互联网龙头个股和半导体制造股。生物医药方面，组合显著增持短期利空超跌的医药零售股，同时对部分高弹性的生物制药股进行灵活交易。目前组合形成以金融为主，消费、科技为辅的持仓结构。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬泓利债券 A 的基金份额净值为 1.0615 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.44%；截至本报告期末鹏扬泓利债券 C 的基金份额净值为 1.0594 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.34%；同期业绩比较基准收益率为 1.39%。

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 | 932,347,287.99 | 16.27 |
| | 其中：股票 | 932,347,287.99 | 16.27 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 4,521,039,183.73 | 78.89 |
| | 其中：债券 | 4,521,039,183.73 | 78.89 |
| | 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 | 54,900,000.00 | 0.96 |
| | 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 | 120,775,882.08 | 2.11 |
| 8 | 其他资产 | 101,600,757.10 | 1.77 |
| 9 | 合计 | 5,730,663,110.90 | 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 126,868,642.14 元，占期末基金资产净值的比例为 2.32%。

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 | 6,540,000.00 | 0.12 |
| C | 制造业 | 192,739,730.41 | 3.52 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 32,550,000.00 | 0.59 |
| F | 批发和零售业 | 27,353,853.00 | 0.50 |
| 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 | 31,912,846.44 | 0.58 |
| J | 金融业 | 514,382,216.00 | 9.40 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| 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 | 805,478,645.85 | 14.72 |

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 | - | - |
| B 消费者非必需品 | - | - |
| C 消费者常用品 | 18,930,910.02 | 0.35 |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | 48,978,997.96 | 0.89 |
| F 医疗保健 | - | - |
| G 工业 | 13,070,437.45 | 0.24 |
| H 信息技术 | 26,450,907.91 | 0.48 |
| I 电信服务 | 19,437,388.80 | 0.36 |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 126,868,642.14 | 2.32 |

注：以上行业分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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 | 601288 | 农业银行 | 73,000,000 | 221,190,000.00 | 4.04 |
| 2 | 601658 | 邮储银行 | 20,460,000 | 102,709,200.00 | 1.88 |
| 3 | 601818 | 光大银行 | 11,290,000 | 42,676,200.00 | 0.78 |
| 3 | 06818 | 中国光大银行 | 1,300,000 | 3,429,001.68 | 0.06 |
| 4 | 601398 | 工商银行 | 8,600,000 | 44,462,000.00 | 0.81 |
| 5 | 02601 | 中国太保 | 1,500,000 | 30,516,534.00 | 0.56 |
| 5 | 601601 | 中国太保 | 299,000 | 8,662,030.00 | 0.16 |
| 6 | 600000 | 浦发银行 | 3,799,913 | 37,999,130.00 | 0.69 |
| 7 | 601668 | 中国建筑 | 7,000,000 | 32,550,000.00 | 0.59 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 867,202 | 31,939,049.66 | 0.58 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 9 | 000001 | 平安银行 | 1,260,000 | 28,501,200.00 | 0.52 |
| 10 | 601577 | 长沙银行 | 3,152,400 | 28,182,456.00 | 0.51 |

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 | 355,099,400.00 | 6.49 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 9,929,000.00 | 0.18 |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 534,437,000.00 | 9.77 |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,631,524,000.00 | 29.81 |
| 6 | 中期票据 | 1,561,414,000.00 | 28.53 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 428,635,783.73 | 7.83 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,521,039,183.73 | 82.61 |

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 | 019640 | 20 国债 10 | 2,130,000 | 213,000,000.00 | 3.89 |
| 2 | 110059 | 浦发转债 | 1,750,000 | 179,252,500.00 | 3.28 |
| 3 | 019649 | 21 国债 01 | 1,420,000 | 142,099,400.00 | 2.60 |
| 4 | 012102049 | 21 东航 SCP009 | 1,300,000 | 129,987,000.00 | 2.38 |
| 5 | 012101525 | 21 中化股 SCP015 | 1,000,000 | 100,090,000.00 | 1.83 |

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浦发转债(110059),农业银行(601288),邮储银行(601658)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。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),上海银保监局 2021 年 04 月 23 日对上海浦东发展银行股份有限公司进行处罚(沪银保监罚决字(2021)29 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 07 月 13 日对中国农业银行股份有限公司进行处罚(银保监罚决字(2020)36 号),银保监会 2020 年 12 月 07 日对中国农业银行股份有限公司进行处罚(银保监罚决字(2020)66 号),银保监会 2021 年 01 月 19 日对中国农业银行股份有限公司进行处罚(银保监罚决字(2021)1 号),中国银行间市场交易商协会 2021 年第 8 次自律处分会议审议决定对中国邮政储蓄银行股份有限公司进行处罚,银保监会 2020 年 12 月 25 日对中国邮政储蓄银行股份有限公司进行处罚(银保监罚决字(2020)72 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 | 185,801.82 |
| 2 | 应收证券清算款 | 10,590,463.81 |
| 3 | 应收股利 | 1,829,185.81 |
| 4 | 应收利息 | 52,365,370.40 |
| 5 | 应收申购款 | 36,629,935.26 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 101,600,757.10 |

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 | 110059 | 浦发转债 | 179,252,500.00 | 3.28 |
| 2 | 132009 | 17 中油 EB | 70,299,222.00 | 1.28 |

| | | | | |
|----|--------|----------|---------------|------|
| 3 | 132015 | 18 中油 EB | 60,885,785.00 | 1.11 |
| 4 | 113021 | 中信转债 | 52,785,000.00 | 0.96 |
| 5 | 128081 | 海亮转债 | 26,769,039.65 | 0.49 |
| 6 | 113026 | 核能转债 | 16,877,679.90 | 0.31 |
| 7 | 110064 | 建工转债 | 12,039,891.20 | 0.22 |
| 8 | 128135 | 洽洽转债 | 3,426,000.00 | 0.06 |
| 9 | 113535 | 大业转债 | 1,113,020.00 | 0.02 |
| 10 | 132022 | 20 广版 EB | 220,594.00 | 0.00 |
| 11 | 123023 | 迪森转债 | 87,076.00 | 0.00 |
| 12 | 113530 | 大丰转债 | 85,058.40 | 0.00 |
| 13 | 110052 | 贵广转债 | 57,689.70 | 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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 | 鹏扬泓利债券 A | 鹏扬泓利债券 C |
|---------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,305,358,927.65 | 2,230,461,827.53 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,023,485,487.60 | 784,366,079.95 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 677,910,818.38 | 505,028,992.79 |
| 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 | 2,650,933,596.87 | 2,509,798,914.69 |

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

| | 鹏扬泓利债券 A | 鹏扬泓利债券 C |
|------------------|---------------|----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 15,379,897.31 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 290,460.76 | - |
| 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 | 15,670,358.07 | - |

| | | |
|---------------------------|------|---|
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 0.30 | - |
|---------------------------|------|---|

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 | 红利再投 | 2021 年 6 月 23 日 | 290,460.76 | 307,597.95 | 0.00% |
| 合计 | | | 290,460.76 | 307,597.95 | |

§ 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泓利债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬泓利债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬泓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

2021 年 7 月 21 日