

# 鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告

2022 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：2022 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 2022 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 2022 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	886,187,972.87 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	361, 193, 956. 95 份	524, 994, 015. 92 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 (2022 年 1 月 1 日 — 2022 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	2, 275, 532. 43	2, 571, 744. 81
2. 本期利润	-11, 402, 448. 23	-17, 018, 055. 41
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0284	-0. 0293
4. 期末基金资产净值	389, 298, 026. 75	560, 895, 668. 55
5. 期末基金份额净值	1. 0778	1. 0684

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. 53%	0. 29%	-0. 30%	0. 20%	-2. 23%	0. 09%
过去六个月	-1. 67%	0. 24%	0. 65%	0. 15%	-2. 32%	0. 09%
过去一年	-0. 92%	0. 21%	2. 43%	0. 13%	-3. 35%	0. 08%
自基金合同 生效起至今	7. 78%	0. 27%	6. 95%	0. 13%	0. 83%	0. 14%

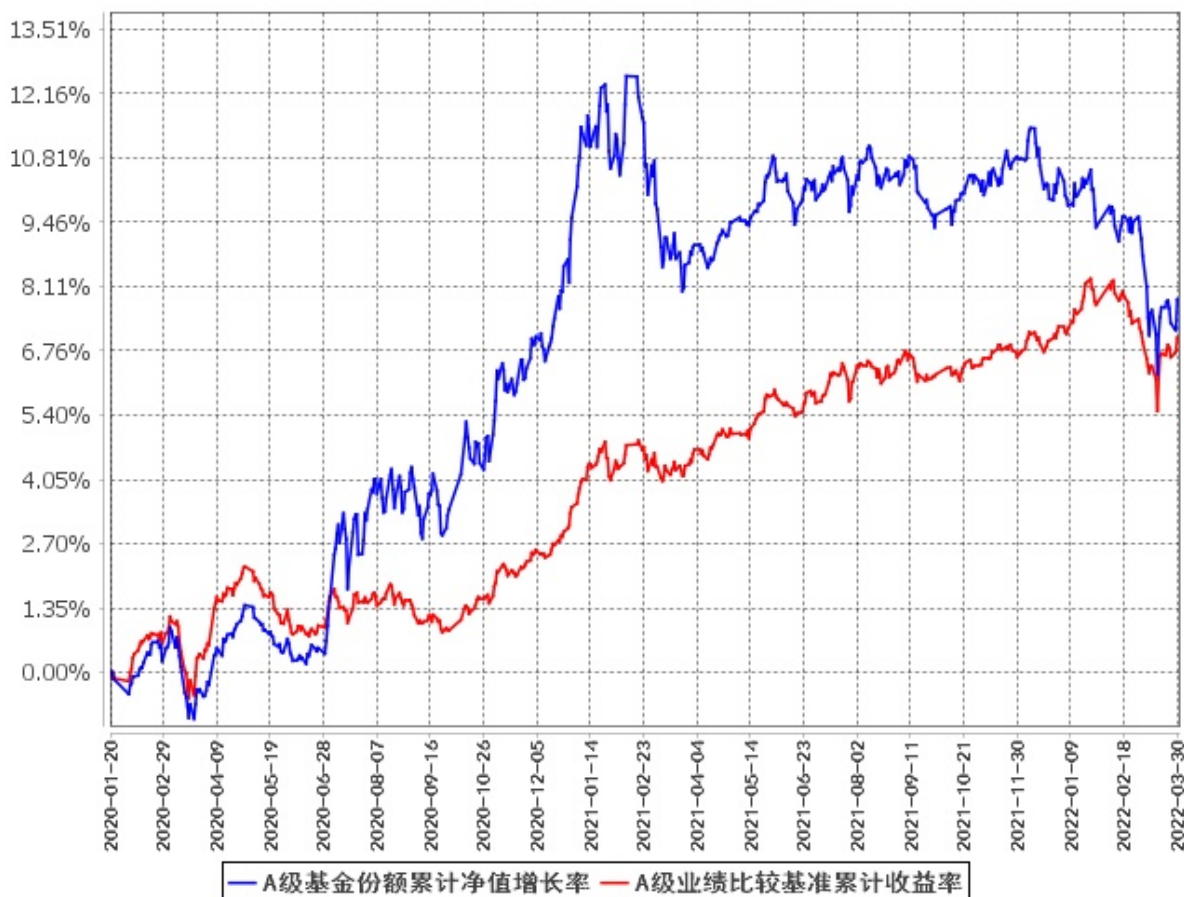
###### 鹏扬聚利六个月债券 C

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. 62%	0. 29%	-0. 30%	0. 20%	-2. 32%	0. 09%
过去六个月	-1. 86%	0. 24%	0. 65%	0. 15%	-2. 51%	0. 09%

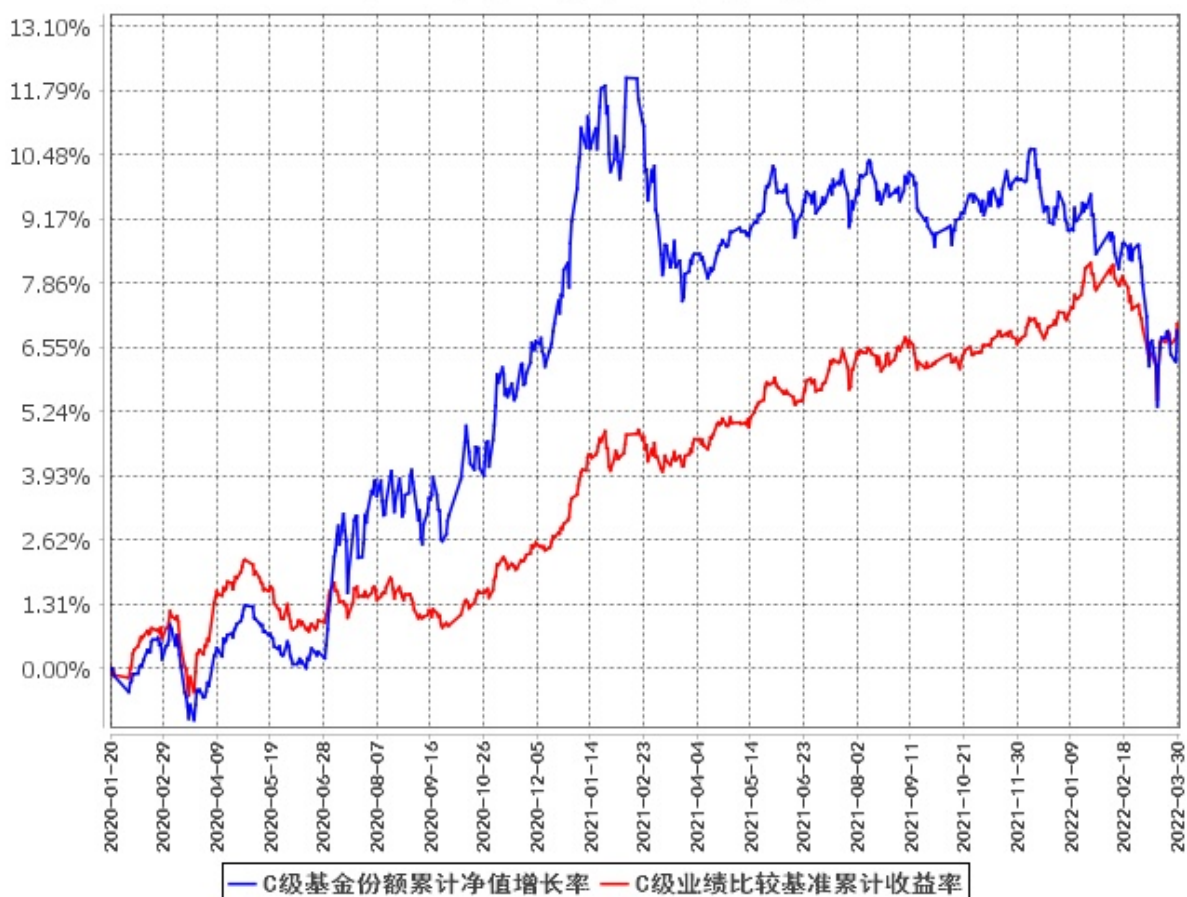
过去一年	-1.31%	0.21%	2.43%	0.13%	-3.74%	0.08%
自基金合同生效起至今	6.84%	0.27%	6.95%	0.13%	-0.11%	0.14%

### 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**  
(2020年1月20日至2022年3月31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**  
(2020年1月20日至2022年3月31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	2021年7月1日	-	22	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。现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

				<p>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 日至今任鹏扬景津六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 1 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 7 月 1 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；2021 年 7 月 1 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 7 月 1 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；2021 年 7 月 7 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；2021 年 7 月 7 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；2021 年 9 月 30 日至今任鹏扬景阳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, 混合投资部副总经理	2020 年 1 月 20 日	-	<p>8</p> <p>北京大学西方经济学硕士。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。现任鹏扬基金管理有限公司混合投资部副总经理。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 2022 年 1 月 5 日任鹏扬双利债券型证券</p>

				<p>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>12</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。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

2022 年 1 季度，受俄乌冲突、大宗商品涨价以及全球货币政策持续收紧等多重因素的影响，全球经济增长持续放缓，全球制造业动能不断走弱。地缘政治因素导致的能源脱钩风险及供应链扰动使得经济景气度承压，同时高企的通货膨胀显著压抑着消费者信心。海外通胀压力较大，主要原因是商品与服务涨价压力扩散、劳力成本上升、通胀预期升温，工资-物价螺旋上升的风险不断增加。预计中期海外经济出现滞胀格局的概率上升。随着通胀失控风险不断加大，发达国家央行货币政策收紧的步伐加快，美联储亦在 1 季度开启加息周期。

国内经济方面，在基建和制造业的拉动下，需求在本季度初得到改善。但是进入 3 月份，疫情扩散与地缘冲突导致经济再次面临“供给冲击、需求收缩、预期转弱”三重压力，3 月份制造业 PMI 跌回收缩区间。若 4 月份政治局会议上政策态度转向如预期，PMI 可能在 2 季度触底，经济同比指标可能在 3 季度触底。通货膨胀方面，1 季度 CPI 同比持续回升，但除了能源上涨压力外，其他重要商品和服务涨价压力不大，因为能繁母猪产能仍在去化，耐用消费品价格、房租、农民工工资上涨



乏力，核心 CPI 同比回升幅度较温和；1 季度 PPI 同比下行斜率放缓，主要原因是疫情、MMT 政策、地缘冲突、能源转型共同加大了全球资源品价格上涨压力，而俄乌冲突进一步暴露了全球能源供给弹性极低给经济带来的脆弱性。

流动性方面，为应对经济下行压力和部分房地产企业的流动性风险，1 季度央行接连下调了 OMO、MLF 和 LPR 利率，资金面总体保持宽松。信用扩张方面，广义社会融资总量同比增速略有回升并有企稳迹象。企业中长期贷款增速在基建的拉动下 1 月份同比转正，而后再度回落；居民中长期贷款持续低迷。短贷和票据同比高增显示内生融资需求仍较弱。

2022 年 1 季度，债券市场呈现震荡格局，中债综合全价指数上涨 0.09%。1 月受央行降息，以及高频经济金融数据较弱的影响，利率呈下行趋势；随着社融数据超预期及央行降息预期落空，利率在 2 月份持续上行；进入 3 月，在金融经济数据打架、国内疫情扩散、稳增长政策发力、地缘冲突等复杂的多重因素影响下，利率呈现震荡的走势。信用利差方面，由于供需结构及信用环境恶化，信用利差普遍抬升，3 年左右信用债估值分位回升至 30%-50% 水平；5 年期信用债估值回升至 60-80% 水平，相对价值突出。中证转债指数下跌 8.36%，隐含波动率高位回落，但是整体依然偏高。

债券操作方面，本基金本报告期内债券投资保持偏低的组合久期策略和严格防范信用风险的信用策略。利率策略方面，组合随着债券市场回升减持了利差水平偏低的商业银行永续债券，积极增持有估值优势的 15 年提前还本地方政府债，同时通过国债期货灵活套保对冲降低久期波动风险。信用策略方面，组合坚持高评级、高质量高、流动性的优质短期信用债券配置思路，积极参与系统重要性银行二级资本债的交易性投资，同时一级市场小幅增仓 3 年期信用债。杠杆策略方面，考虑到货币政策总体宽松，组合维持了中性以上的杠杆水平。可转换债券方面，考虑到组合的直接权益风险暴露较高，因此主要配置了偏防御型的大盘价值转债，而对高景气、高估值、高价格的成长转债则更愿意直接参与正股投资；同时，鉴于银行转债的债底安全边际高、银行基本面与估值水平的偏离越来越大，组合进一步增仓大盘低价银行转债；此外，考虑到成本抬升对制造业带来的压力，组合减持了建筑材料、汽车、电力设备等行业转债。

2022 年 1 季度，国内股市受国内稳增长预期不稳、海外货币政策收紧、能源价格走高、俄乌冲突后中美关系预期恶化等影响，呈现大幅下跌。从风格来看，大盘风格相对抗跌程度好于中小盘风格。代表大盘价值风格的上证 50 指数下跌 11.47%，沪深 300 指数下跌 14.53%；代表中小盘成长风格的创业板指数和中小 100 指数分别下跌 19.96% 和 18.64%。从行业板块来看，受益于稳增长及房地产政策放松预期的地产、建筑和银行板块，以及受益于上游资源品涨价的煤炭、石油板块的跑赢幅度较为明显。明显走弱的主要是军工、新能源、电子等外需型赛道板块。与此同时，海外市场与国内市场呈现明显分化，美股依然保持强势，与 2021 年年末点位相差不大，而美债今年以来上行高达

100BP，与中国债券的利差压缩到极低水平，接近倒挂。大宗商品则由于俄乌冲突等因素显著走强，原油价格上涨了 30%达到 100 元以上，动力煤、焦炭也上涨 30%左右，螺纹钢上涨 15%，农产品中豆粕上涨 20%、玉米上涨 10%，呈现明显的供给驱动的强通胀格局。

权益操作方面，本基金本报告期内权益仓位总体变化不大，季度末略有降低，以结构调整为主。金融股方面，组合继续超配估值低、盈利受益于稳增长的银行股，但对结构进行适度调整，减持了估值修复的国有大行，增持了估值低、有一定弹性的股份制银行；逢高减持了财富管理券商股。消费股方面，组合逢低增仓啤酒股、调味品等日常消费股以及受益于疫情好转预期的酒店股，并在上涨之后部分止盈。科技股方面，组合减持了军工电子龙头股、半导体材料股和受益于新能源车行业的汽车电子股。周期股方面，组合逢高减仓国防军工股、建筑+地产双重龙头股，逢低增仓受益于地产后周期的建材、家居等行业个股。高端制造方面，组合逢高减仓新能源设备股，增仓新能源行业景气度较高的锂电资源股、继电器行业龙头股、受益于新型电力系统建设的民营电力设备龙头股并在高位对其止盈。医药行业组合逢低增持可能受益于疫情的医药零售连锁企业股票。

#### 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 1.0778 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.53%；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 1.0684 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.62%；同期业绩比较基准收益率为-0.30%。

#### 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	168,643,708.23	15.33
	其中：股票	168,643,708.23	15.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	891,769,726.57	81.08

	其中：债券	891,769,726.57	81.08
	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	36,889,734.49	3.35
8	其他资产	2,534,700.74	0.23
9	合计	1,099,837,870.03	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 7,884,331.04 元，占期末基金资产净值的比例为 0.83%。

## 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	74,280,045.90	7.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,757,292.00	0.40
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,783,500.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	3,122,168.00	0.33
H	住宿和餐饮业	1,831,308.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,945,107.87	0.20
J	金融业	68,062,195.42	7.16
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	5,977,760.00	0.63
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	160,759,377.19	16.92

## 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	3,224,835.28	0.34
C 消费者常用品	1,515,777.69	0.16
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	715,878.53	0.08
I 电信服务	2,427,839.54	0.26
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	7,884,331.04	0.83

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	601166	兴业银行	800,000	16,536,000.00	1.74
2	601939	建设银行	2,500,000	15,725,000.00	1.65
3	000001	平安银行	1,007,659	15,497,795.42	1.63
4	601818	光大银行	4,000,000	13,200,000.00	1.39
5	688598	金博股份	34,239	8,251,599.00	0.87
6	603799	华友钴业	58,600	5,731,080.00	0.60
7	02238	广汽集团	608,000	3,224,835.28	0.34
7	601238	广汽集团	186,300	2,092,149.00	0.22
8	300725	药石科技	45,200	4,356,376.00	0.46
9	002466	天齐锂业	53,100	4,321,809.00	0.45
10	000776	广发证券	240,000	4,219,200.00	0.44

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	76,288,765.76	8.03
	其中：政策性金融债	56,280,316.44	5.92
4	企业债券	399,411,469.57	42.03
5	企业短期融资券	50,462,546.84	5.31

6	中期票据	307,341,147.40	32.35
7	可转债（可交换债）	48,229,238.99	5.08
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	10,036,558.01	1.06
10	其他	-	-
11	合计	891,769,726.57	93.85

### 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	127175	15 武铁 01	600,000	62,303,309.59	6.56
2	188105	21 陆集 01	500,000	51,714,126.03	5.44
3	188109	21 葛洲 02	500,000	51,624,876.71	5.43
4	190407	19 农发 07	500,000	51,227,684.93	5.39
5	102101238	21 华润控股 MTN002B	400,000	41,389,567.12	4.36

### 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
T2206	T2206	-45	-45,186,750.00	-129,900.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					-129,900.00
国债期货投资本期收益 (元)					67,985.56
国债期货投资本期公允价值变动 (元)					-30,900.00

### 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。光大证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会或其派出机构的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

### 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	1,021,355.11
2	应收证券清算款	1,491,685.36
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21,660.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,534,700.74

#### 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	27,861,925.02	2.93
2	110073	国投转债	4,054,454.88	0.43
3	127006	敖东转债	2,190,932.60	0.23
4	113043	财通转债	1,308,587.89	0.14
5	113542	好客转债	1,073,726.03	0.11
6	127012	招路转债	101,733.71	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	448,647,091.62	646,102,665.60
报告期期间基金总申购份额	446,030.60	357,056.98
减：报告期期间基金总赎回份额	87,899,165.27	121,465,706.66
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	361,193,956.95	524,994,015.92

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（%）	0.66	-

## 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

2022 年 4 月 22 日