

鹏扬汇利债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告

2023 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：2023 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 2023 年 4 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | | |
|-------------|--|----------|
| 基金简称 | 鹏扬汇利债券 | |
| 基金主代码 | 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 | 6,081,221,645.63 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 鹏扬汇利债券 A | 鹏扬汇利债券 C |

| | | |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 下属分级基金的交易代码 | 004585 | 004586 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,687,429,175.53 份 | 393,792,470.10 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 (2023 年 1 月 1 日—2023 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 | 32,659,306.52 | 1,726,957.36 |
| 2. 本期利润 | 115,001,112.68 | 6,529,114.64 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0182 | 0.0156 |
| 4. 期末基金资产净值 | 6,167,077,782.66 | 423,543,463.67 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0843 | 1.0755 |

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额, 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 | 1.51% | 0.17% | 0.73% | 0.08% | 0.78% | 0.09% |
| 过去六个月 | 2.14% | 0.21% | 0.40% | 0.11% | 1.74% | 0.10% |
| 过去一年 | 2.19% | 0.21% | 0.36% | 0.11% | 1.83% | 0.10% |
| 过去三年 | 10.65% | 0.21% | 2.33% | 0.13% | 8.32% | 0.08% |
| 过去五年 | 25.06% | 0.20% | 8.55% | 0.13% | 16.51% | 0.07% |
| 自基金合同 生效起至今 | 28.90% | 0.19% | 10.51% | 0.12% | 18.39% | 0.07% |

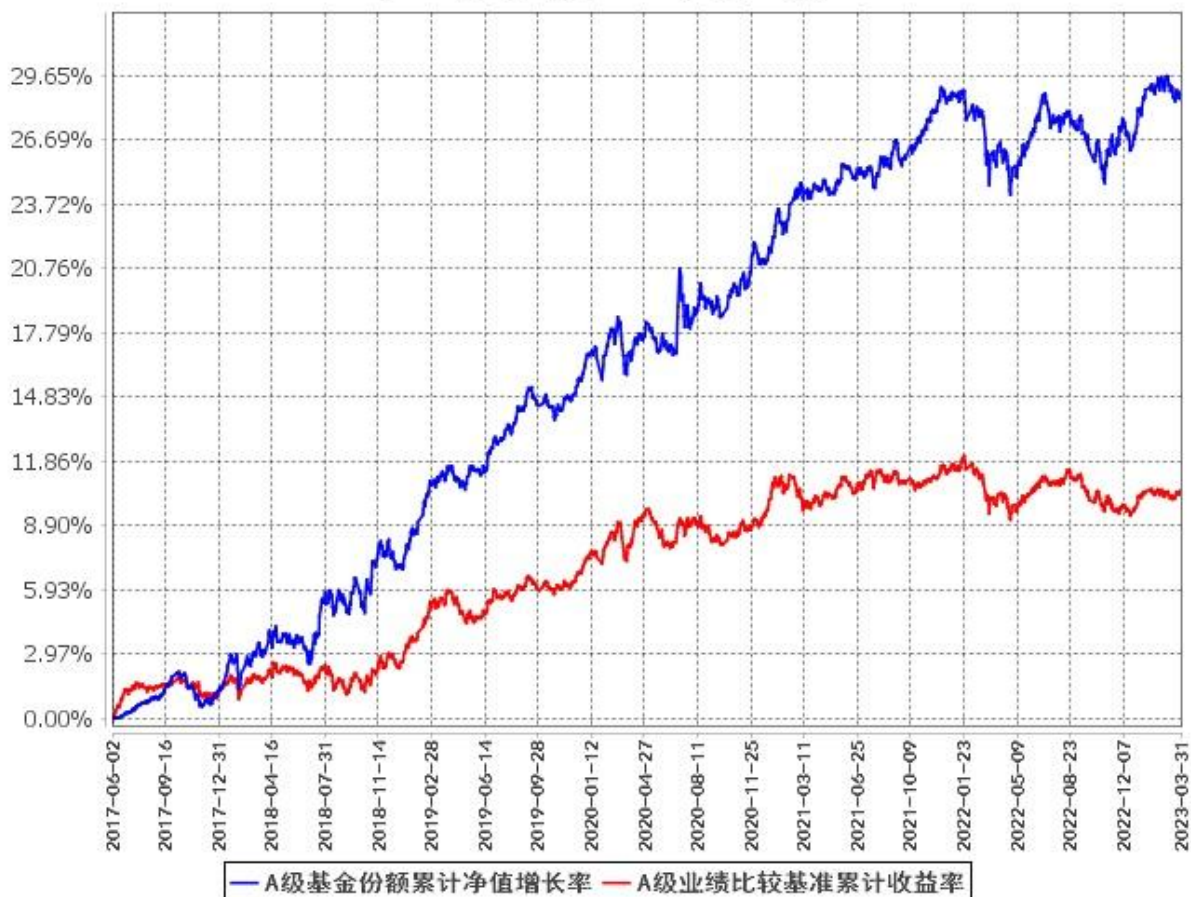
鹏扬汇利债券 C

| 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 | 1.40% | 0.17% | 0.73% | 0.08% | 0.67% | 0.09% |
| 过去六个月 | 1.93% | 0.21% | 0.40% | 0.11% | 1.53% | 0.10% |
| 过去一年 | 1.78% | 0.21% | 0.36% | 0.11% | 1.42% | 0.10% |
| 过去三年 | 9.33% | 0.21% | 2.33% | 0.13% | 7.00% | 0.08% |

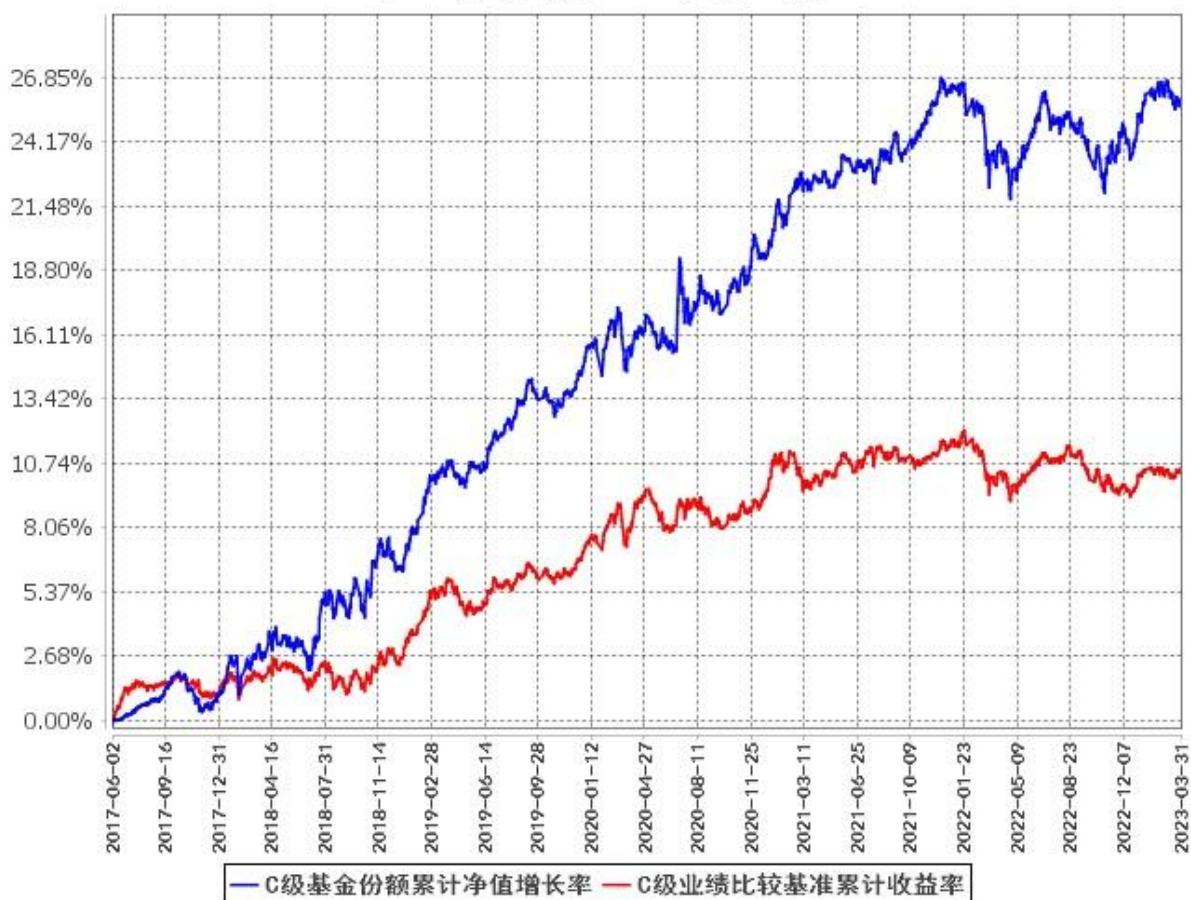
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去五年 | 22.58% | 0.20% | 8.55% | 0.13% | 14.03% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 25.95% | 0.19% | 10.51% | 0.12% | 15.44% | 0.07% |

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
(2017年6月2日至2023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
(2017年6月2日至2023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 | 2017年6月2日 | - | 23 | 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 日至今任鹏扬景沅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> |
| 焦翠 | 本基金基金经理, 现金管理部利率策略总监 | 2018 年 3 月 16 日 | - | <p>9</p> <p>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。现任鹏扬基金管理有限公司现金管理部利率策略总监。2018 年 3 月 16 日至今任鹏扬汇利债券型证券投资基金基金经理；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。</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | 理;2019年1月4日至2022年1月28日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2022年7月18日任鹏扬景创混合型证券投资基金基金经理;2021年8月18日至今任鹏扬淳熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理;2021年9月3日至2022年6月18日任鹏扬景颐混合型证券投资基金基金经理;2021年9月28日至2022年12月7日任鹏扬景阳一年持有期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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现涉及本基金的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的 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年 1 季度，全球经济动能环比好转。在前期金融条件走松的背景下，美国 1、2 月非农就业数据大超预期，制造业 PMI 见底回升，服务业 PMI 以及消费数据依然维持较强的韧性。强劲的经济基本面一扫年初的衰退叙事，叠加欧美通胀下降速度仍较为缓慢，加息风险重新浮现。进入 3 月，美国与欧洲陆续出现银行风波，在对金融稳定性的担忧下，市场重估了全球经济增长预期。当前，该事件的影响未出现进一步蔓延，但可能到来的信贷条件紧缩效应将使得美联储加息必要性显著下降，银行危机引发的对信贷紧缩幅度、商业地产脆弱性等方面的担忧仍将给市场带来持续的不确定性。

2023 年 1 季度，国内经济步入复苏周期，随着疫情防控政策放松以及房地产政策松绑，生产、消费与投资活动全面回暖。未来，预计总量政策温和、产业政策积极，经济慢复苏但持续性较强。居民消费与购房需求仍有修复空间，但修复幅度受到资产负债表与政策的约束，企业商务活动与政府投资活动将持续恢复。通货膨胀方面，1 季度国内 CPI 同比整体小幅回落，服务价格逐步回升，商品价格保持低迷，PPI 环比表现不强。随着居民生活半径打开、收入增加，核心 CPI 在服务价格的推动下有望低位回升，但在外需低迷的背景下，预计耐用品消费不足会对冲部分服务类价格上行效果。流动性方面，2 月份资金面受贷款投放强劲、超储率较低等因素影响波动较大。但是进入 3 月，人民银行意外下调存款准备金率 25bp，降准叠加 MLF 超量续作呵护了资金面预期。信用扩张方面，社融超预期走强，企业端整体融资需求强劲，企业债券融资受前期冲击后出现企稳回升的迹象。居民端短期融资需求回暖，中长期信贷仍偏弱。政府端财政依然靠前发力。不过，当前资金活化程度仍较低，后续伴随经济进一步回暖或出现改善。

2023 年 1 季度，中债综合全价指数上涨了 0.28%，收益率曲线趋于平坦。在经济复苏、融资强劲和资金面中性的背景下，利率中枢总体上移。信用利差方面，1 季度信用利差持续收窄，中短期信用债受到市场追捧，信用利差再次回到较低分位数水平。1 季度，转债市场保持平稳上行，截至 3 月底，中证转债指数收涨 3.53%，转债估值处在中等偏高的位置。

债券操作方面，本基金本报告期内组合久期先降后升，整体维持在偏低区间，以灵活调整为主。2 月下旬组合久期降至阶段性低位，期间注重对超短端具备信用安全的票息资产挖掘。3 月初在利率

回升至具备相对价值区间后，系统性增持了短端高流动性资产，再次提升组合久期。

在利率低位环境下，本基金更注重资产配置性价比和安全性。具体来看，利率策略方面，组合持续根据相对性价比对短端持仓进行轮动置换，并在市场出现机会时参与长端利率波段交易。同时，组合积极通过一级投标参与短端博弈，并在二级市场及时止盈兑现，增厚了组合收益。

信用策略方面，组合在 1 季度坚持中短久期信用债配置策略，积极通过一级市场投标等方式获取超额收益，并根据相对价值进行换仓操作。将绝对利率偏低、不具性价比的债券卖出，置换成具有相对价值、利差仍有压缩空间的债券，并在 3 月中上旬买入预计受益于资金宽松的 1 年左右商业银行资本债，同时规避资质偏弱、久期偏长的债券。

可转债策略方面，报告期内本基金转债仓位在中性至高仓位水平波动。结构方面，本基金对持仓的偏债型品种主要采取了逢高减持的策略，并将仓位替换为向下有债底保护、向上有一定弹性的一篮子平衡型品种。从行业上看，组合持仓可转债形成了以银行和非银金融方向为主，以建筑装饰、电子、交通运输、食品饮料等方向为辅的结构。

2023 年 1 季度，海外股市呈现上涨和分化的现象。纳斯达克指数上涨了 16.77%，标普 500 指数上涨了 7.03%，道琼斯工业指数上涨了 0.38%。3 月以来，硅谷银行危机爆发，金融银行业股价大幅下挫，但科技公司涨势良好。1 季度，国内股市在年初走高后整体震荡回调。1 月，市场在经济改善预期加强和流动性充裕背景下呈现开门红。2 月，市场出现较为明显的调整。3 月，在 ChatGPT 概念的影响下，TMT 交易集中度大幅提升。从风格来看，1 季度代表大盘价值风格的上证 50 指数上涨了 1.01%，代表成长风格的创业板指数上涨了 2.25%、科创 50 指数上涨了 12.67%，成长风格占优。从行业板块来看，1 季度表现较好的主要是受益于 AI 和数字经济概念的计算机、传媒、电子等板块，以及中特估值驱动的建筑装饰等板块。

股票操作方面，本基金本报告期内仓位基本稳定，操作以结构调整为主，通过优选兼顾估值保护与业绩弹性的标的，为组合获取稳健收益。具体而言，金融股方面，对持仓的国有大行和股份行股票进行了逢高减仓操作。消费股方面，对受益于出行与线下消费复苏的旅游、啤酒板块股票逢高获利了结，并逢低买入了市场关注度较低的预制菜标的。周期股方面，组合期初增持了受益于经济复苏与中特估值驱动的建筑、建材、化工板块的股票，在大幅反弹后部分获利了结，并逢低增持了性价比更高的家电和重卡行业个股。高端制造方面，组合逢高止盈了与机器人、电网建设方向相关的股票，逢低买入了估值与增长更加匹配的刀具行业个股。医药股方面，组合继续保持超配，并增持了受益于手术需求回暖的个股。TMT 方面，组合年初增持了通信运营商和计算机板块个股，在大幅上涨后部分获利了结，并在市场关注不高时左侧布局了风险收益较好的半导体股票。目前，组合形成了以低估值金融、顺周期板块、稳定成长的消费、医药板块为主，科技创新、高端制造、周期

成长板块为辅的均衡持仓结构。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬汇利债券 A 的基金份额净值为 1.0843 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.51%；截至本报告期末鹏扬汇利债券 C 的基金份额净值为 1.0755 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.40%；同期业绩比较基准收益率为 0.73%。

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 | 1,281,011,968.27 | 16.72 |
| | 其中：股票 | 1,281,011,968.27 | 16.72 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 6,253,211,622.15 | 81.62 |
| | 其中：债券 | 6,253,211,622.15 | 81.62 |
| | 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 | 126,500,158.07 | 1.65 |
| 8 | 其他资产 | 927,326.32 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 7,661,651,074.81 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 857,248,085.29 | 13.01 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 60,800,364.50 | 0.92 |

| | | | |
|---|-----------------|------------------|-------|
| E | 建筑业 | 31,320,000.00 | 0.48 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 17,792,917.10 | 0.27 |
| H | 住宿和餐饮业 | 14,050,680.00 | 0.21 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 58,165,074.00 | 0.88 |
| J | 金融业 | 201,744,866.08 | 3.06 |
| K | 房地产业 | 9,139,591.80 | 0.14 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 30,750,389.50 | 0.47 |
| 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 | 1,281,011,968.27 | 19.44 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

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 | 000001 | 平安银行 | 6,000,000 | 75,180,000.00 | 1.14 |
| 2 | 000895 | 双汇发展 | 2,500,000 | 64,850,000.00 | 0.98 |
| 3 | 002507 | 涪陵榨菜 | 2,231,300 | 56,518,829.00 | 0.86 |
| 4 | 600030 | 中信证券 | 2,400,096 | 49,153,966.08 | 0.75 |
| 5 | 603799 | 华友钴业 | 850,000 | 46,750,000.00 | 0.71 |
| 6 | 002793 | 罗欣药业 | 6,091,000 | 44,647,030.00 | 0.68 |
| 7 | 000661 | 长春高新 | 215,000 | 35,109,500.00 | 0.53 |
| 8 | 600298 | 安琪酵母 | 840,000 | 35,070,000.00 | 0.53 |
| 9 | 000333 | 美的集团 | 647,300 | 34,831,213.00 | 0.53 |
| 10 | 600079 | 人福医药 | 1,278,100 | 34,227,518.00 | 0.52 |

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 | 327,495,895.73 | 4.97 |
| 2 | 央行票据 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|------------------|-------|
| 3 | 金融债券 | 919,314,495.24 | 13.95 |
| | 其中：政策性金融债 | 128,822,185.20 | 1.95 |
| 4 | 企业债券 | 1,744,903,556.26 | 26.48 |
| 5 | 企业短期融资券 | 40,218,260.83 | 0.61 |
| 6 | 中期票据 | 2,555,773,521.40 | 38.78 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 665,505,892.69 | 10.10 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 6,253,211,622.15 | 94.88 |

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 | 110059 | 浦发转债 | 3,662,790 | 388,890,958.11 | 5.90 |
| 2 | 1928011 | 19 工商银行二级 03 | 1,400,000 | 147,936,465.75 | 2.24 |
| 3 | 1928006 | 19 工商银行二级 01 | 1,400,000 | 141,967,252.46 | 2.15 |
| 4 | 019674 | 22 国债 09 | 1,239,000 | 126,145,611.13 | 1.91 |
| 5 | 101800975 | 18 陕交建 MTN002 | 1,200,000 | 124,609,052.05 | 1.89 |

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

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司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。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局或其派出机构的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会的处罚。

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 | 442,199.62 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 485,126.70 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 927,326.32 |

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 | 388,890,958.11 | 5.90 |
| 2 | 113052 | 兴业转债 | 56,876,424.44 | 0.86 |
| 3 | 110079 | 杭银转债 | 50,492,436.27 | 0.77 |
| 4 | 110073 | 国投转债 | 48,613,295.94 | 0.74 |
| 5 | 128119 | 龙大转债 | 9,255,997.46 | 0.14 |
| 6 | 110082 | 宏发转债 | 9,004,492.16 | 0.14 |
| 7 | 110064 | 建工转债 | 8,983,504.02 | 0.14 |
| 8 | 127012 | 招路转债 | 7,935,598.20 | 0.12 |
| 9 | 127017 | 万青转债 | 4,627,220.75 | 0.07 |
| 10 | 113024 | 核建转债 | 4,498,219.58 | 0.07 |
| 11 | 127049 | 希望转 2 | 3,858,866.15 | 0.06 |
| 12 | 128037 | 岩土转债 | 3,803,102.13 | 0.06 |
| 13 | 113638 | 台 21 转债 | 3,782,372.42 | 0.06 |
| 14 | 127042 | 嘉美转债 | 3,487,980.82 | 0.05 |
| 15 | 113042 | 上银转债 | 3,465,603.79 | 0.05 |
| 16 | 113616 | 韦尔转债 | 3,306,136.32 | 0.05 |
| 17 | 127015 | 希望转债 | 3,295,055.34 | 0.05 |
| 18 | 113549 | 白电转债 | 3,275,517.33 | 0.05 |
| 19 | 128135 | 洽洽转债 | 3,261,650.49 | 0.05 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 20 | 127044 | 蒙娜转债 | 3,224,596.16 | 0.05 |
| 21 | 113653 | 永 22 转债 | 3,179,825.62 | 0.05 |
| 22 | 110047 | 山鹰转债 | 3,051,034.00 | 0.05 |
| 23 | 127016 | 鲁泰转债 | 2,978,870.46 | 0.05 |
| 24 | 113044 | 大秦转债 | 2,774,363.62 | 0.04 |
| 25 | 113033 | 利群转债 | 2,694,384.00 | 0.04 |
| 26 | 113519 | 长久转债 | 2,605,392.78 | 0.04 |
| 27 | 113046 | 金田转债 | 2,447,249.79 | 0.04 |
| 28 | 128132 | 交建转债 | 2,389,195.48 | 0.04 |
| 29 | 123104 | 卫宁转债 | 1,993,987.88 | 0.03 |
| 30 | 128130 | 景兴转债 | 1,762,628.44 | 0.03 |
| 31 | 113650 | 博 22 转债 | 749,579.77 | 0.01 |
| 32 | 127039 | 北港转债 | 643,039.62 | 0.01 |
| 33 | 127005 | 长证转债 | 482,659.52 | 0.01 |
| 34 | 132022 | 20 广版 EB | 360,820.39 | 0.01 |
| 35 | 113605 | 大参转债 | 86,391.39 | 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 | 鹏扬汇利债券 A | 鹏扬汇利债券 C |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 7,078,318,266.75 | 438,727,414.03 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 937,275,911.61 | 28,671,863.80 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,328,165,002.83 | 73,606,807.73 |
| 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 | 5,687,429,175.53 | 393,792,470.10 |

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

| | 鹏扬汇利债券 A | 鹏扬汇利债券 C |
|---------------------------|---------------|----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 31,761,489.03 | - |
| 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 | 31,761,489.03 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 0.52 | - |

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

2023 年 4 月 22 日