

# 鹏扬泓利债券型证券投资基金

## 2024 年第 1 季度报告

2024 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 4 月 19 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 2024 年 4 月 17 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 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	2,104,050,290.30 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	1,397,418,646.02 份	706,631,644.28 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 (2024 年 1 月 1 日—2024 年 3 月 31 日)	
	鹏扬泓利债券 A	鹏扬泓利债券 C
1. 本期已实现收益	-36,241,774.97	-18,316,689.98
2. 本期利润	-689,861.87	-681,763.00
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0005	-0.0009
4. 期末基金资产净值	1,386,296,365.98	697,268,403.01
5. 期末基金份额净值	0.9920	0.9867

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	0.07%	0.25%	1.84%	0.12%	-1.77%	0.13%
过去六个月	-0.63%	0.21%	2.56%	0.11%	-3.19%	0.10%
过去一年	-1.61%	0.19%	3.62%	0.10%	-5.23%	0.09%
过去三年	1.51%	0.19%	9.10%	0.12%	-7.59%	0.07%
过去五年	14.41%	0.20%	18.26%	0.12%	-3.85%	0.08%
自基金合同 生效起至今	18.53%	0.20%	21.87%	0.12%	-3.34%	0.08%

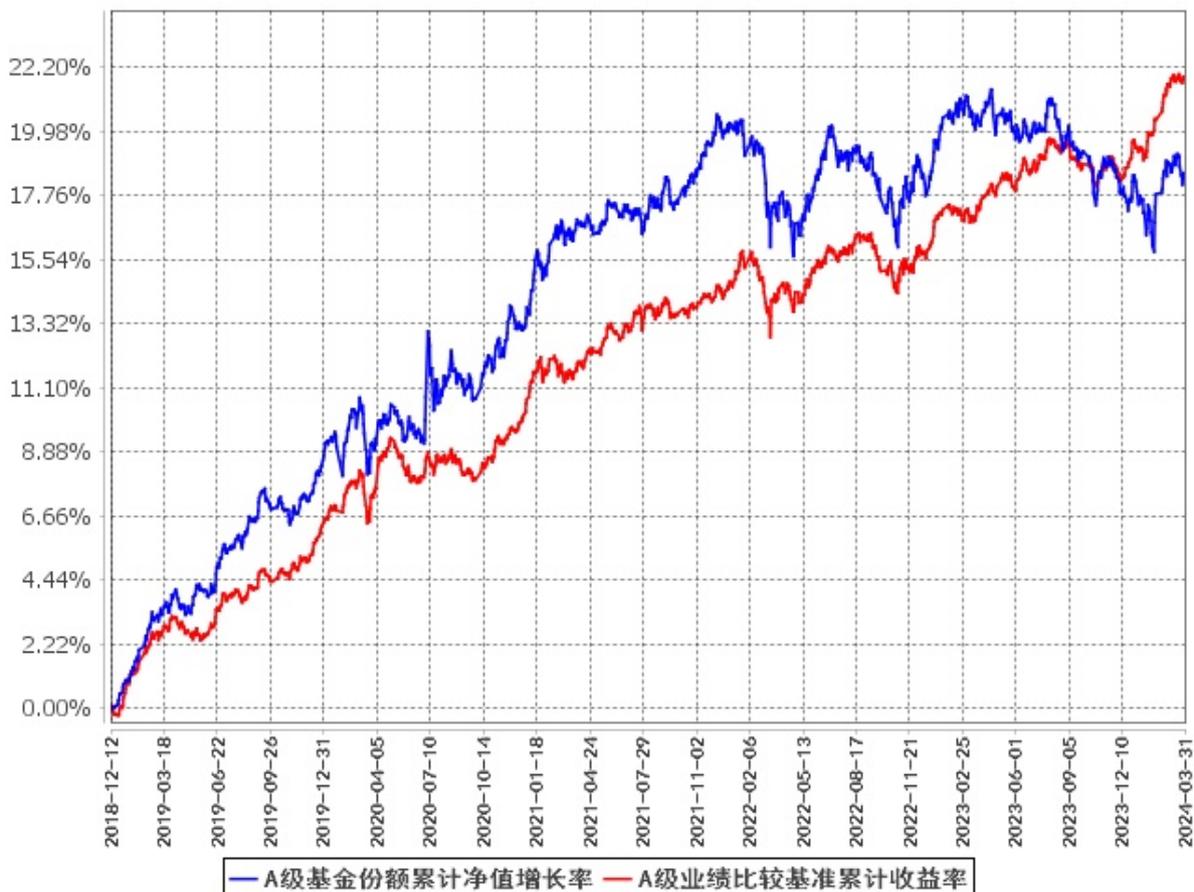
###### 鹏扬泓利债券 C

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	-0.03%	0.25%	1.84%	0.12%	-1.87%	0.13%
过去六个月	-0.83%	0.21%	2.56%	0.11%	-3.39%	0.10%

过去一年	-2.01%	0.19%	3.62%	0.10%	-5.63%	0.09%
过去三年	0.30%	0.19%	9.10%	0.12%	-8.80%	0.07%
过去五年	12.17%	0.20%	18.26%	0.12%	-6.09%	0.08%
自基金合同生效起至今	16.07%	0.20%	21.87%	0.12%	-5.80%	0.08%

### 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2024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  
(2018年12月12日至2024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	2018年12月12日	-	24	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日至今任鹏扬泓利债券型证券

				<p>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 日至今任鹏扬景沣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>
--	--	--	--	--

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

2024 年 1 季度，全球经济动能延续较强的韧性，随着发达国家央行逐渐引导降息的预期，市场对宏观风险的定价延续回落趋势。美国经济“软着陆”仍是主流叙事，通胀回落速度偏慢，但是供给端的进一步正常化降低了市场以及美联储对于二次通胀的担忧。

2024 年 1 季度，国内财政政策发力平稳，两会确定了今年以及未来几年均会发行超长期特别国债的政策，中央财政明显发力抵消了地方土地收入下滑的影响，居民与企业信心延续修复。内需方面，在春节假期带动下出行消费旺盛；基建继续发挥经济稳定器的作用，保持高增；制造业投资在产业政策以及出口带动下增速上行；房地产市场整体承压。外需方面，海外需求韧性较强，出口价格拖累有所缓解，出口动能延续回升。通货膨胀方面，1 季度国内 CPI 同比中枢小幅上行、PPI 同比保持低位。其中，服务价格在春节假期带动下明显上行；上游资源品价格在原油价格上行、国内地产投资保持低迷的影响下整体震荡；下游商品价格依然承压；总体而言目前通胀压力极小。在制造业供给能力较强、劳动力市场供求不紧张、房租平稳的情况下，核心 CPI 总体中枢依然会保持较低水平。流动性方面，在地方政府债券发行偏慢以及降准的影响下，资金面整体宽松，资金利率波动不大。信用扩张方面，在高基数以及高质量扩信用的影响下，社融同比增速有所回落。企业融资较强，中长期融资同比多增。居民短期贷款回落，中长期贷款跟随地产销售保持低位。此外，M1 增速保持低位，当前资金活化程度较低。

2024 年 1 季度，中债综合全价指数上涨 1.35%，受存款利率调降以及政策利率调降预期的影响，债券收益率总体回落，利率曲线整体下移。信用利差方面，1 季度信用利差走势分化，中高等级信

用利差波动较小，AA-利差大幅收窄。1 年内信用债利差小幅上行，1 年内 AA 及以上城投和产业利差上行 5-10BP，1 年内 AA-产业利差下行近 50BP。中高等级中长期信用利差普遍压缩 5-30BP。AA-产业利差普遍收窄 50BP。AA-城投利差收窄 50-150BP。1 季度，转债市场整体呈 V 型走势，但抗跌属性明显优于小盘股。在春节前触及低点后，跟随股市反弹约 5%。进入 3 月后窄幅震荡。截至报告期末，中证转债指数下跌 0.81%，万得可转债等权指数下跌 4.20%，同期正股指数下跌 10.12%，转债估值一度降至过去 5 年的低位水平，至报告期末估值水平仍不高。

利率策略方面，本基金年初通过增持 5 年期地方政府债和 5 年期政策性银行资本债提升组合久期，临近季末利率水平大幅下行后小幅减仓。信用策略方面，组合坚持中高等级信用债配置策略，规避资质偏弱、久期偏长的信用债券，并根据相对价值变化进行换仓操作。具体来看，主要是逐步减持了一些性价比下降、利差已压缩至低位的城投类信用债，同时积极参与一二级市场具备一定相对价值的债券投资及交易机会来增厚组合收益。可转债策略方面，本基金在 2 月初转债大幅下跌后一定程度提高仓位来博弈权益市场的反弹，取得一定正收益；同时本基金在 3 月末减仓了部分转债。结构方面，本基金持仓以偏债型转债为主，在利率趋势向下的环境中相对受益。

2024 年 1 季度，海外股市延续走强，纳斯达克指数上涨 9.11%，标普 500 指数上涨 10.16%，道琼斯工业指数上涨 5.62%，人工智能和区块链表现优异。A 股市场整体表现弱于海外市场，呈现超跌反弹的走势。从风格来看，1 季度价值风格跑赢，代表大盘价值风格的上证 50 指数上涨 3.82%，代表成长风格的创业板指数下跌 3.87%。从行业板块来看，表现较好的行业主要是家电、银行与煤炭。

股票操作方面，本基金本报告期内逐步降低组合的股票仓位，但总体保持在中性偏高的水平，操作主要以结构调整为主，主要降低了消费、军工和电子行业的仓位，提高了医药、有色和电力设备行业的仓位。具体而言，金融股方面，继续持有龙头券商股。消费股方面，减仓高端白酒标的，持有估值在低位的细分市场龙头白酒股，减仓了部分必需消费品个股，逢高大幅止盈了高股息消费个股。周期股方面，期初买入了煤炭股并逢高卖出，逢高止盈了部分家电个股与建筑装饰龙头股，继续持有低估值的地产和汽车股。高端制造方面，趁市场反弹卖出了部分新能源、军工和汽车零部件个股，增仓了部分电力设备个股。医药股方面，增仓了中药和麻醉药行业有吸引力的个股。TMT 方面，继续持有面板行业龙头股，减仓了半导体存储行业个股。公用事业方面，继续持有水电行业个股，买入了港股市场的高股息燃气股。目前组合形成了以估值相对较低且具备稳定成长性的消费、医药、公用事业为主，科技、高端制造、周期成长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泓利债券 A 的基金份额净值为 0.9920 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.07%；截至本报告期末鹏扬泓利债券 C 的基金份额净值为 0.9867 元，本报告期基金份额净值增长

率为-0.03%；同期业绩比较基准收益率为 1.84%。

#### 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	303,809,502.48	12.26
	其中：股票	303,809,502.48	12.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,076,739,219.03	83.81
	其中：债券	2,076,739,219.03	83.81
	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	40,009,863.01	1.61
	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	56,995,957.20	2.30
8	其他资产	326,718.81	0.01
9	合计	2,477,881,260.53	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 18,447,929.88 元，占期末基金资产净值的比例为 0.89%。

### 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	3,170,199.00	0.15
C	制造业	193,268,786.20	9.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,580,578.00	0.94
E	建筑业	5,240,000.00	0.25
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,066,841.90	0.29
H	住宿和餐饮业	5,644,108.00	0.27

I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,267,679.50	1.16
J	金融业	28,123,380.00	1.35
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	285,361,572.60	13.70

### 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	6,227,454.57	0.30
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	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	2,012,722.31	0.10
K 房地产	10,207,753.00	0.49
合计	18,447,929.88	0.89

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	600116	三峡水利	2,727,100	19,580,578.00	0.94
2	600030	中信证券	966,400	18,554,880.00	0.89
3	002507	涪陵榨菜	1,280,000	17,280,000.00	0.83
4	002063	远光软件	3,206,200	17,249,356.00	0.83
5	300034	钢研高纳	955,300	14,616,090.00	0.70
6	600129	太极集团	379,300	12,611,725.00	0.61
7	000333	美的集团	185,100	11,887,122.00	0.57

8	600298	安琪酵母	410,500	11,797,770.00	0.57
9	00688	中国海外发展	1,000,000	10,207,753.00	0.49
10	000895	双汇发展	372,600	9,780,750.00	0.47

#### 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	120,082,705.48	5.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	112,769,415.30	5.41
	其中：政策性金融债	112,769,415.30	5.41
4	企业债券	307,831,813.23	14.77
5	企业短期融资券	70,886,233.88	3.40
6	中期票据	360,699,290.02	17.31
7	可转债（可交换债）	340,280,827.25	16.33
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	764,188,933.87	36.68
10	其他	-	-
11	合计	2,076,739,219.03	99.67

#### 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	1,824,070	198,818,382.68	9.54
2	231312	23 广西 34	1,600,000	165,387,309.58	7.94
3	231369	23 贵州 28	1,400,000	144,298,767.13	6.93
3	2371306	23 贵州债 28	200,000	20,656,978.14	0.99
4	198898	23 湘 139	1,350,000	138,953,095.89	6.67
5	019727	23 国债 24	1,185,000	120,082,705.48	5.76

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

### 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)					-399,136.80
国债期货投资本期公允价值变动 (元)					497,021.69

### 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，中国进出口银行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	170,917.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	155,801.51
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	326,718.81

#### 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	198,818,382.68	9.54
2	113052	兴业转债	39,946,096.36	1.92
3	110079	杭银转债	17,188,615.65	0.82
4	132026	G 三峡 EB2	6,496,018.03	0.31
5	110064	建工转债	5,765,795.71	0.28
6	127042	嘉美转债	3,989,652.86	0.19
7	110081	闻泰转债	3,969,068.19	0.19
8	111010	立昂转债	3,586,841.42	0.17
9	128119	龙大转债	3,013,346.72	0.14
10	113049	长汽转债	2,967,749.28	0.14
11	110082	宏发转债	2,792,400.71	0.13
12	110073	国投转债	2,618,050.67	0.13
13	113042	上银转债	2,420,166.20	0.12
14	128134	鸿路转债	2,367,686.77	0.11
15	128142	新乳转债	2,300,381.68	0.11
16	127083	山路转债	2,142,989.56	0.10
17	127015	希望转债	2,061,902.98	0.10
18	110062	烽火转债	2,037,391.36	0.10
19	113616	韦尔转债	1,989,689.86	0.10
20	127049	希望转 2	1,904,271.45	0.09
21	128135	洽洽转债	1,901,982.42	0.09
22	113638	台 21 转债	1,872,897.38	0.09
23	127016	鲁泰转债	1,847,726.58	0.09
24	127052	西子转债	1,775,122.47	0.09
25	113046	金田转债	1,741,886.07	0.08
26	118035	国力转债	1,607,758.29	0.08
27	113602	景 20 转债	1,384,884.42	0.07
28	127017	万青转债	1,214,837.93	0.06
29	113609	永安转债	1,202,719.62	0.06
30	110047	山鹰转债	1,071,559.90	0.05
31	113643	风语转债	1,070,735.34	0.05
32	113636	甬金转债	1,021,626.70	0.05

33	113605	大参转债	970,512.75	0.05
34	123149	通裕转债	887,832.68	0.04
35	128109	楚江转债	873,389.33	0.04
36	118033	华特转债	660,103.70	0.03
37	113653	永 22 转债	650,444.19	0.03
38	127085	韵达转债	611,308.24	0.03
39	128130	景兴转债	492,537.21	0.02
40	113619	世运转债	486,179.53	0.02
41	113062	常银转债	481,446.04	0.02
42	127045	牧原转债	479,879.78	0.02
43	113059	福莱转债	474,666.78	0.02
44	127032	苏行转债	473,904.30	0.02
45	113065	齐鲁转债	470,132.87	0.02
46	127066	科利转债	466,225.64	0.02
47	123107	温氏转债	463,945.88	0.02
48	113631	皖天转债	462,665.63	0.02
49	113045	环旭转债	458,215.48	0.02
50	113530	大丰转债	434,410.79	0.02
51	113067	燃 23 转债	422,285.51	0.02
52	127059	永东转 2	421,149.73	0.02
53	127025	冀东转债	373,214.59	0.02
54	127040	国泰转债	344,974.15	0.02
55	111009	盛泰转债	344,485.90	0.02
56	113048	晶科转债	344,405.84	0.02
57	118013	道通转债	299,103.71	0.01
58	113058	友发转债	261,109.43	0.01
59	127071	天箭转债	243,908.58	0.01
60	113623	风 21 转债	243,494.73	0.01
61	110060	天路转债	222,369.23	0.01
62	110090	爱迪转债	189,872.24	0.01
63	118025	奕瑞转债	130,623.16	0.01
64	127034	绿茵转债	40,256.44	0.00
65	113650	博 22 转债	11,537.93	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	鹏扬泓利债券 A	鹏扬泓利债券 C
报告期期初基金份额总额	1,690,531,728.65	787,418,597.90
报告期期间基金总申购份额	249,352,429.45	5,425,695.00
减：报告期期间基金总赎回份额	542,465,512.08	86,212,648.62
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	1,397,418,646.02	706,631,644.28

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

本报告期内基金管理人未持有本基金。

### 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024 年 2 月 23 日-2024 年 2 月 26 日	299,161,443.47	242,007,663.61	249,728,595.43	291,440,511.65	13.85%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，有效防控产品流动性风险，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。

## 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

2024 年 4 月 19 日