

鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金  
(原鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金  
转型)

2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 24 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月22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。

自2024年7月31日起原鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金转型为鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金。鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金报告期自2024年7月31日起至2024年9月30日止。原鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金报告期自2024年7月1日起至2024年7月30日止。如无特殊说明，本报告中“本基金”指鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金及原鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金（转型后）

#### 2.1.1 基金基本情况

基金简称	鹏扬丰利一年持有债券
基金主代码	013579
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年7月31日
报告期末基金份额总额	39,564,924.47份
投资目标	本基金在控制风险和保持资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略包括：固定收益品种投资策略（包括债券品种轮换策略、时机选择策略、利率预期策略、信用债/资产支持证券投资策略、可转债/可交换债投资策略）、衍生品投资策略（包括国债期货投资策略、信用衍生品投资策略）。
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金，风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金。
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司

基金托管人	平安银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	鹏扬丰利一年持有债券 A	鹏扬丰利一年持有债券 C	鹏扬丰利一年持有债券 D
下属分级基金的交易代码	013579	013580	020642
报告期末下属分级基金的份额总额	16,483,539.69 份	23,081,294.32 份	90.46 份

注：自 2024 年 7 月 31 日起，原鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金转型为鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金。

## 2.2 鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金（转型前）

### 2.2.1 基金基本情况

基金简称	鹏扬丰利一年定开债券		
基金主代码	013579		
基金运作方式	契约型定期开放式		
基金合同生效日	2022 年 5 月 24 日		
报告期末基金份额总额	49,820,794.50 份		
投资目标	本基金在控制风险和保持资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。		
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、板块轮换策略、骑乘策略、信用债投资策略、可转债/可交换债投资策略、国债期货投资策略、适度的融资回购策略、资产支持证券投资策略、信用衍生品投资策略等。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		
风险收益特征	本基金属于债券型基金，风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金。		
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司		
基金托管人	平安银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	鹏扬丰利一年定开债券 A	鹏扬丰利一年定开债券 C	鹏扬丰利一年定开债券 D
下属分级基金的交易代码	013579	013580	020642
报告期末下属分级基金的份额总额	17,310,871.21 份	32,509,832.83 份	90.46 份

注：（1）本基金自 2024 年 1 月 24 日起增设 D 类份额，鹏扬丰利一年定开债券 D 增设日至 2024 年 6 月 23 日期间无份额。

（2）自 2024 年 7 月 31 日起，原鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金转型为鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

##### 3.1.1 鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024年7月31日—2024年9月30日）		
	鹏扬丰利一年持有债券 A	鹏扬丰利一年持有债券 C	鹏扬丰利一年持有债券 D
1. 本期已实现收益	200,271.59	335,832.48	1.13
2. 本期利润	96,333.59	132,012.53	0.55
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0056	0.0043	0.0061
4. 期末基金资产净值	18,346,367.02	25,451,282.54	100.65
5. 期末基金份额净值	1.1130	1.1027	1.1126

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。

##### 3.1.2 鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024年7月1日—2024年7月30日）		
	鹏扬丰利一年定开债券 A	鹏扬丰利一年定开债券 C	鹏扬丰利一年定开债券 D
1. 本期已实现收益	34,144.43	53,224.52	0.19
2. 本期利润	8,184.68	564.19	0.01
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0004	0.0000	0.0001
4. 期末基金资产净值	19,161,272.02	35,673,099.55	100.10
5. 期末基金份额净值	1.1069	1.0973	1.1066

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 鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金（转型后）

（报告期：2024年7月31日-2024年9月30日）

##### 3.2.1.1 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

鹏扬丰利一年持有债券 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
自基金转型 起至今	0.55%	0.11%	0.18%	0.12%	0.37%	-0.01%

鹏扬丰利一年持有债券 C

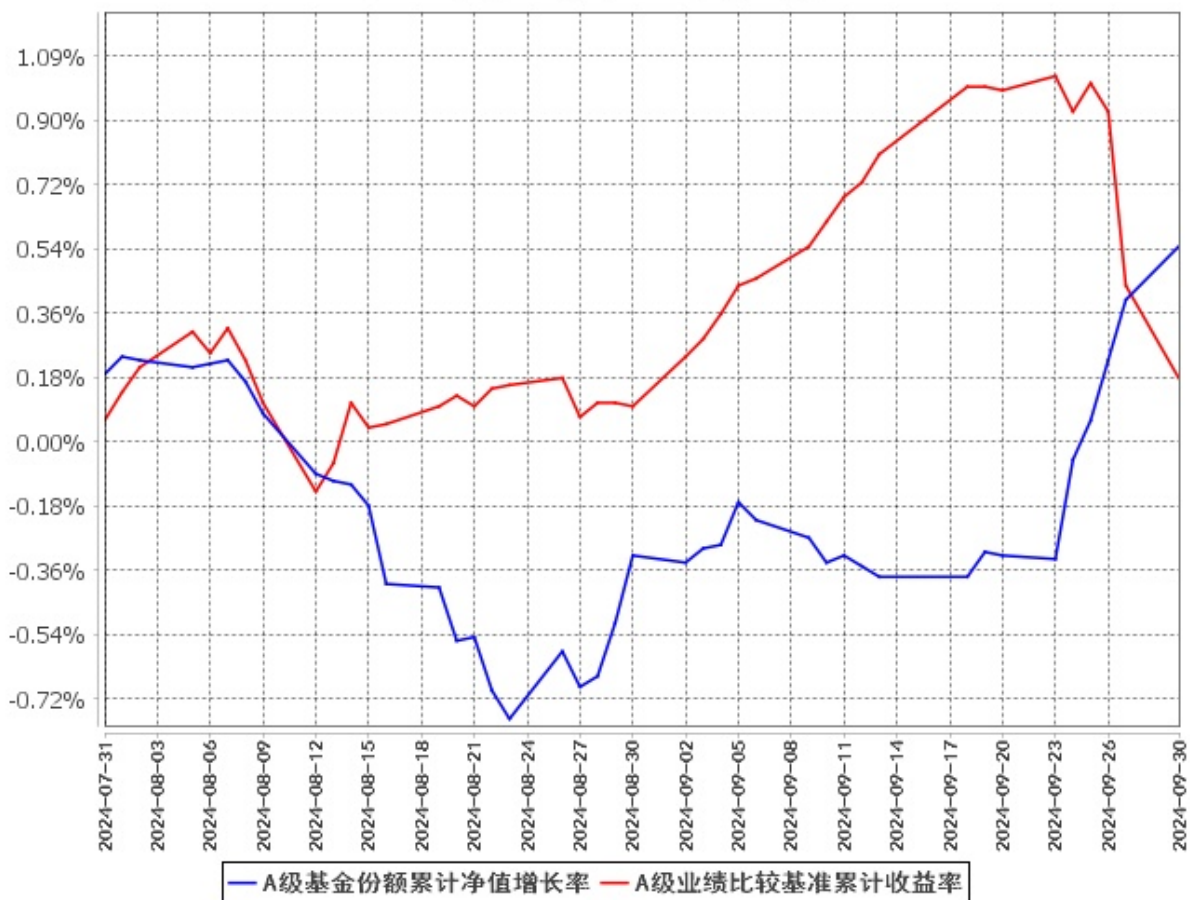
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
自基金转型 起至今	0.49%	0.11%	0.18%	0.12%	0.31%	-0.01%

鹏扬丰利一年持有债券 D

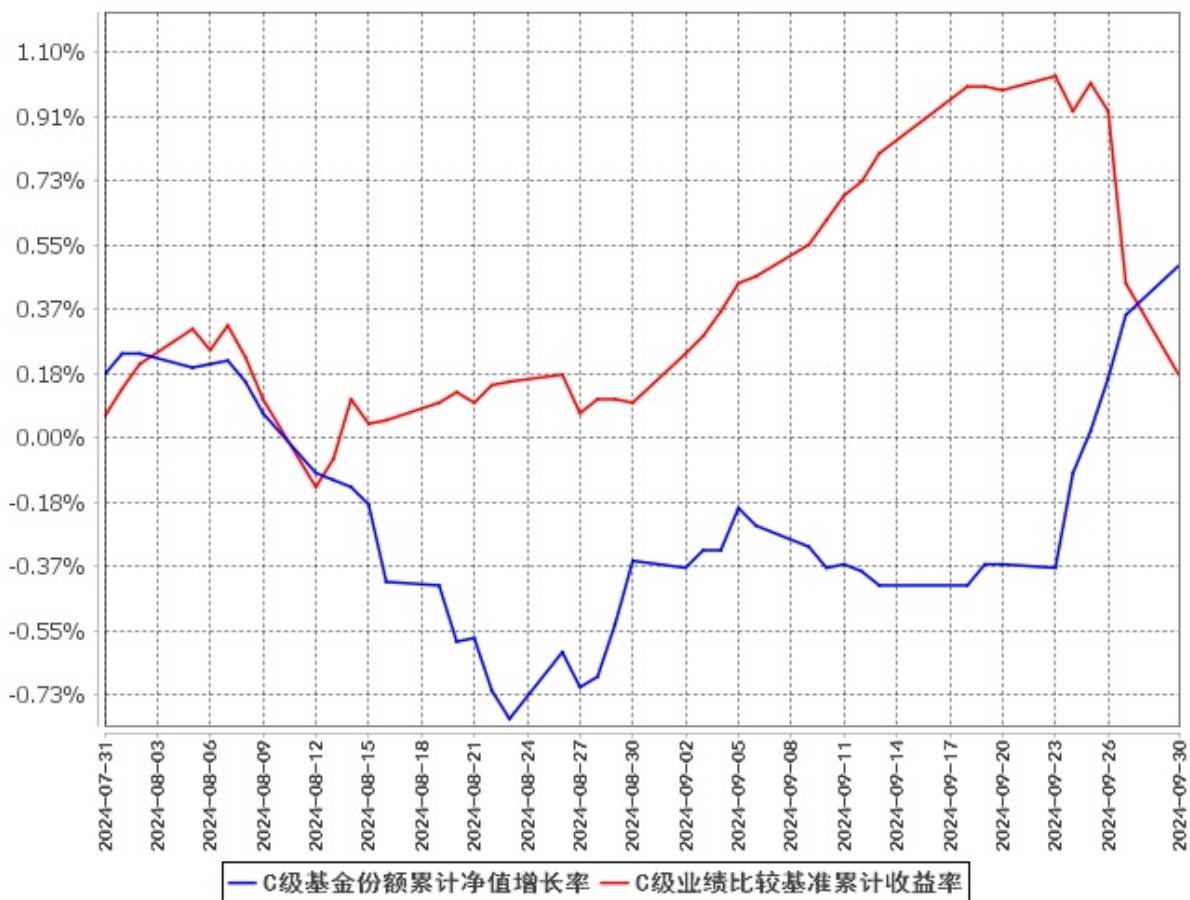
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
自基金转型 起至今	0.54%	0.11%	0.18%	0.12%	0.36%	-0.01%

##### 3.2.1.2 自基金转型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

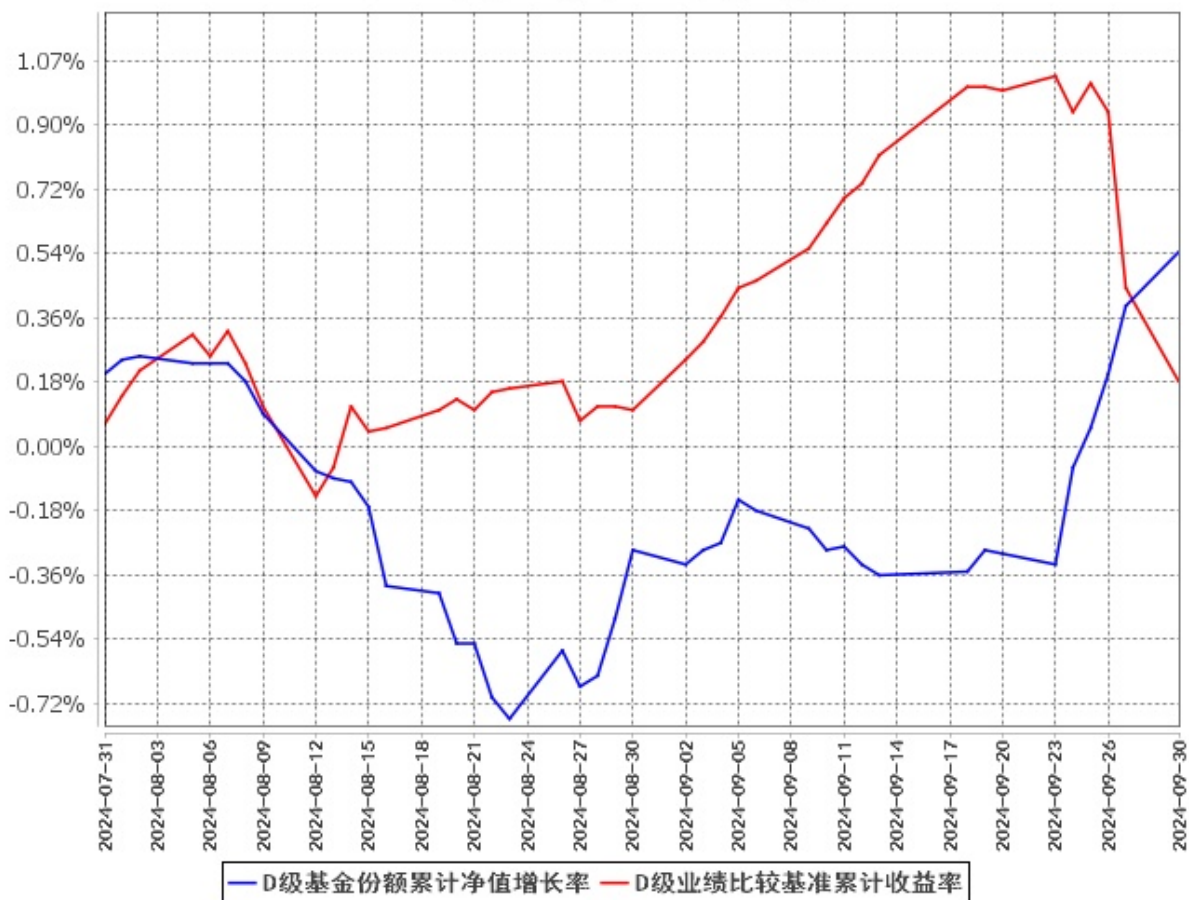
**A级自基金转型以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动比较图（转型后）  
（2024年7月31日至2024年9月30日）**



**C级自基金转型以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动比较图（转型后）  
（2024年7月31日至2024年9月30日）**



**D级自基金转型以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动比较图（转型后）  
（2024年7月31日至2024年9月30日）**



注：（1）自 2024 年 7 月 31 日起，原鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金转型为鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金。本基金转型后截至本报告期末基金合同生效未满一年。

（2）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。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

### 3.2.2 鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金（转型前）

（报告期：2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 30 日）

#### 3.2.2.1 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

鹏扬丰利一年定开债券 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 (2024年4月30日-2024年7月30日)	0.99%	0.07%	2.19%	0.05%	-1.20%	0.02%
过去六个月 (2024年1月31日-2024年7月30日)	2.99%	0.06%	3.57%	0.07%	-0.58%	-0.01%



过去一年 (2023年7月31日-2024年7月30日)	5.97%	0.06%	6.25%	0.06%	-0.28%	0.00%
自基金合同生效起至2024年7月30日	10.69%	0.06%	11.18%	0.05%	-0.49%	0.01%

鹏扬丰利一年定开债券 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 (2024年4月30日-2024年7月30日)	0.88%	0.07%	2.19%	0.05%	-1.31%	0.02%
过去六个月 (2024年1月31日-2024年7月30日)	2.78%	0.06%	3.57%	0.07%	-0.79%	-0.01%
过去一年 (2023年7月31日-2024年7月30日)	5.55%	0.06%	6.25%	0.06%	-0.70%	0.00%
自基金合同生效起至2024年7月30日	9.73%	0.06%	11.18%	0.05%	-1.45%	0.01%

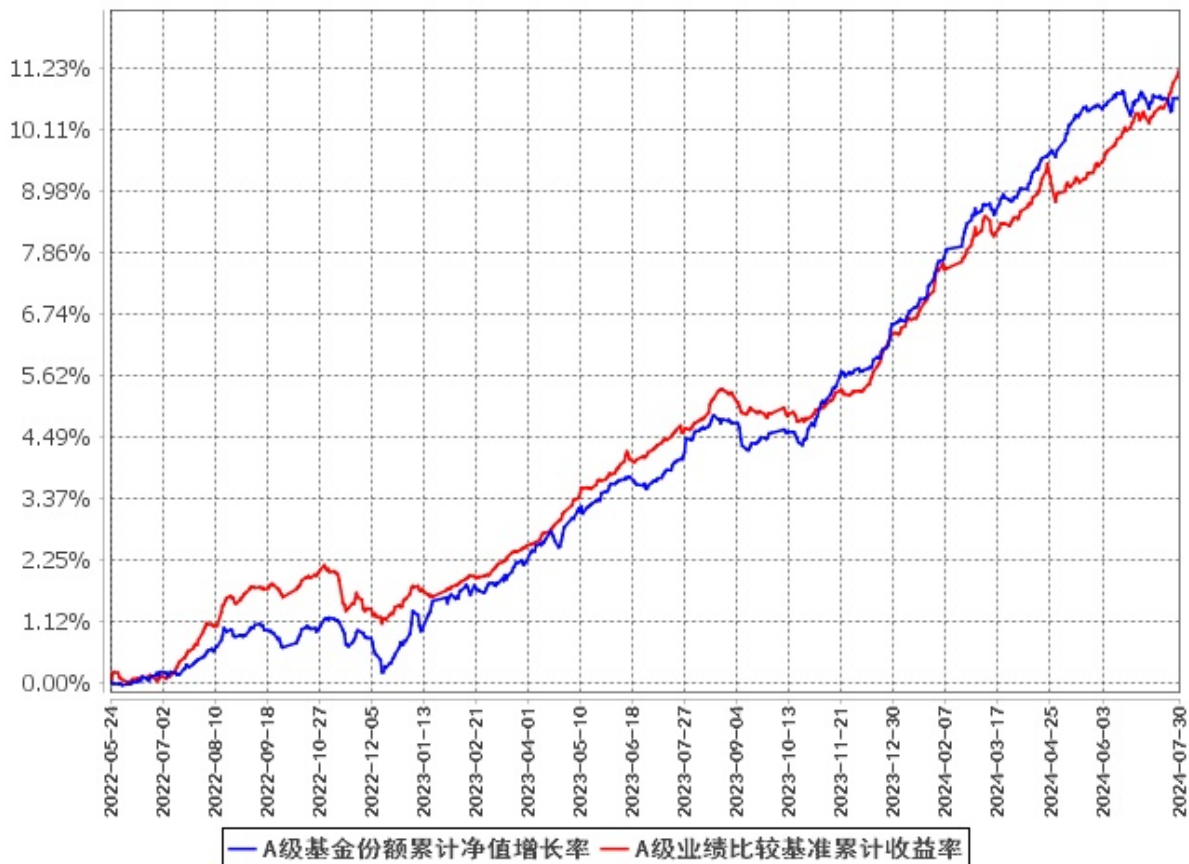
鹏扬丰利一年定开债券 D

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
自基金合同生效起至2024年7月30日	0.10%	0.08%	0.98%	0.06%	-0.88%	0.02%

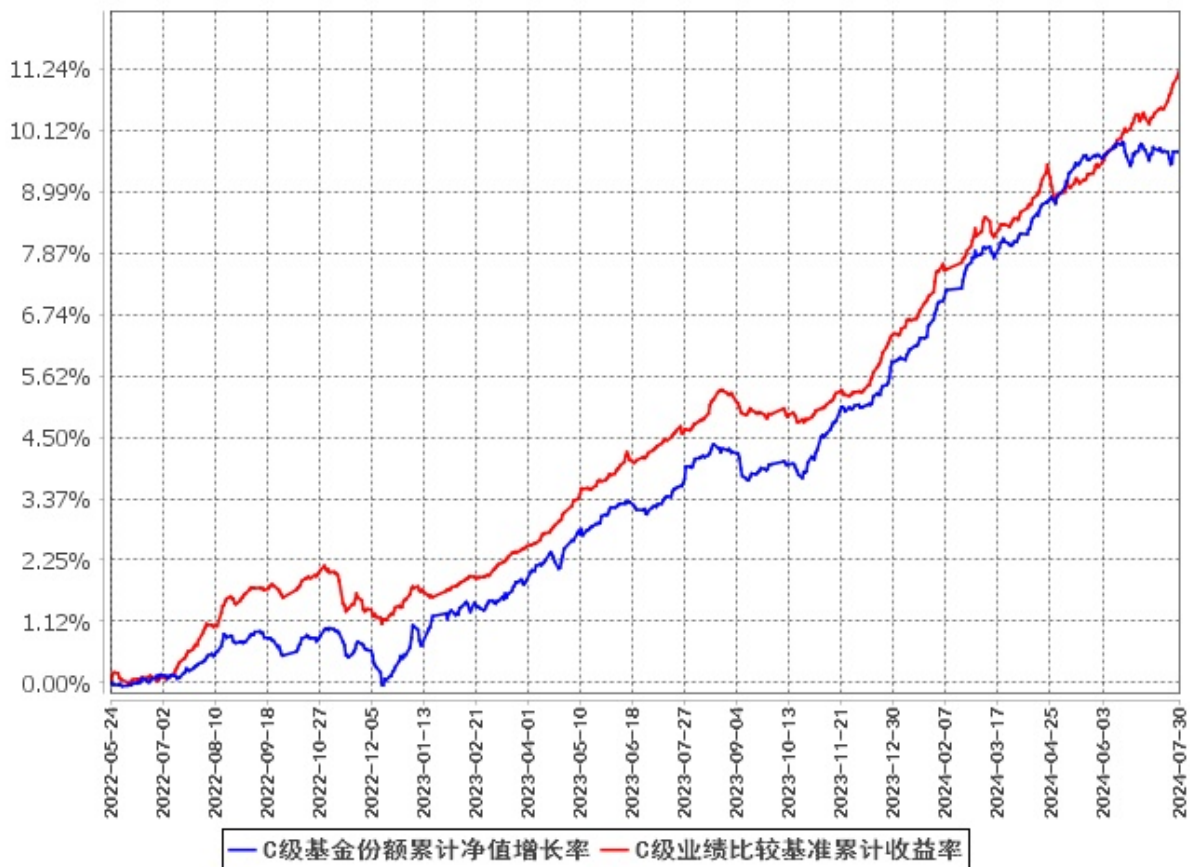
注：本基金自2024年1月24日起增设D类份额，鹏扬丰利一年定开债券D增设日至2024年6月23日期间无份额。

### 3.2.2.2 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

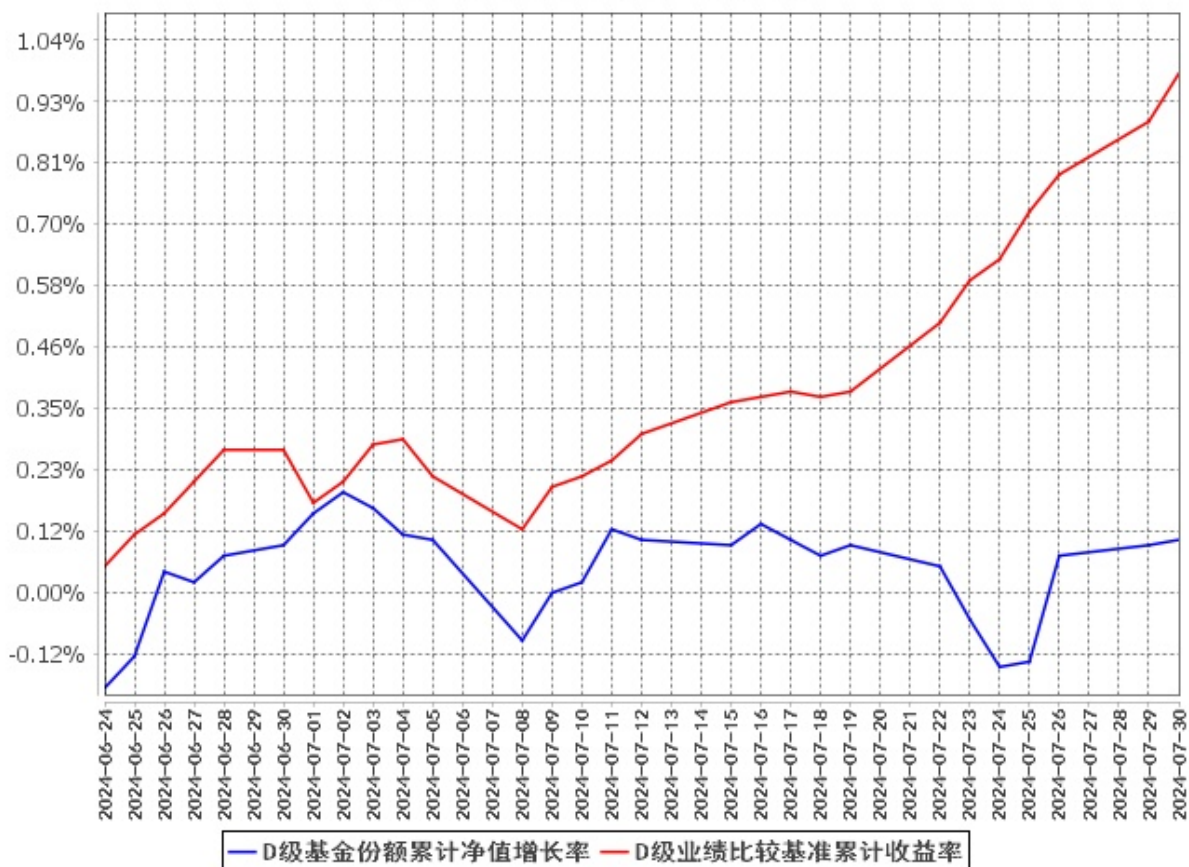
A级自基金合同生效以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动比较图（转型  
前）  
(2022年5月24日至2024年7月30日)



**C级自基金合同生效以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动比较图（转型前）**  
**（2022年5月24日至2024年7月30日）**



**D级自基金合同生效以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动比较图（转型前）**  
**（2024年6月24日至2024年7月30日）**



注：本基金自 2024 年 1 月 24 日起增设 D 类份额，鹏扬丰利一年定开债券 D 增设日至 2024 年 6 月 23 日期间无份额。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

#### 4.1.1 鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金（转型后）

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		
王经瑞	本基金基金经理, 混合投资部执行总经理	2024年7月31日	-	16	东北大学金融学硕士。曾任中天证券有限责任公司研究部研究员，银建期货有限责任公司固定收益部投资经理，银河德睿投资管理有限公司固定收益部投资经理，北京鹏扬投资管理有限公司固定收益部

					<p>投资经理。现任鹏扬基金管理有限公司混合投资部执行总经理。2023年10月31日至今任鹏扬双利债券型证券投资基金基金经理；2024年1月16日至2024年7月30日任鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2024年4月12日至今任鹏扬永利90天持有期债券型证券投资基金基金经理；2024年7月31日至今任鹏扬丰利一年持有期债券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。

#### 4.1.2 鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金（转型前）

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		
王经瑞	本基金基金经理, 混合投资部执行总经理	2024年1月16日	2024年7月30日	16	<p>东北大学金融学硕士。曾任中天证券有限责任公司研究部研究员，银建期货有限责任公司固定收益部投资经理，银河德睿投资管理有限公司固定收益部投资经理，北京鹏扬投资管理有限公司固定收益部投资经理。现任鹏扬基金管理有限公司混合投资部执行总经理。2023年10月31日至今任鹏扬双利债券型证券投资基金基金经理；2024年1月16日至2024年7月30日任鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2024年4月12日至今任鹏扬永利90天持有期债券</p>

					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

2024年3季度，全球经济动能总体放缓。美国就业市场持续降温、欧洲制造业PMI重新回落，主要发达国家央行进入降息周期。由于美国失业率抬升，市场对于美国衰退的担忧加大，但美联储及时释放了积极宽松的信号，并且于9月议息会议降息50个基点。在稳定就业成为美联储首要目标后，市场对衰退的担忧明显减弱，金融条件放松带来一些经济数据改善，美国经济软着陆再次成为主流叙事。

2024年3季度，国内经济动能延续放缓。内需方面，房地产销售与投资保持低迷，企业资本开支减弱，股票市场持续低迷和房价大幅下行导致居民部门储蓄意愿进一步上升，消费动能明显走弱。

外需方面，受益于美国经济韧性、新兴市场经济好以及价格优势，出口保持较高水平。政策方面，房地产政策的重心是放开限购与贷款收储，货币政策温和加力，财政支出明显不及预期，财政政策强度持续走弱。在市场对政策形成一致悲观预期时，9月底政治局会议在经济政策方面明显转向积极。通货膨胀方面，上游资源品价格明显回落，中游制造和下游消费品价格延续低迷，GDP平减指数持续负增长，通货紧缩风险上升。核心原因是内需疲弱以及宏观政策总体偏紧。流动性方面，美联储降息后人民币贬值压力缓解，国内降准和降息同时落地。信用扩张方面，由于信贷挤水分以及信贷需求持续走弱，信贷增速延续下滑。信贷结构上，私人部门融资持续偏弱，政府部门融资回升。展望未来，货币、财政与房地产政策从保守转为积极，但政策范式改变仍需时间酝酿，预计经济动能将出现反弹。

2024年3季度，中债综合全价指数上涨0.26%。受资金面整体宽松以及宏观基本面持续走弱的影响，债券收益率曲线整体下移，季末受股票市场大幅反弹和政策转向影响，利率水平有所回升。信用利差方面，3季度信用利差普遍走阔，低等级品种走阔幅度明显。可转债方面，3季度绝大部分时间受到多种因素影响持续下跌。一方面是股市持续下跌影响，上证跌破2700点；另一方面，受岭南转债违约影响，市场对资质偏弱主体标的重新定价，超过70%的转债标的一度跌破债底；第三，流动性冲击。9月下旬多项重磅政策出台，转债市场大幅反弹，转债估值回升至中性偏高的水平。展望未来，债券市场调整后将迎来投资机会。

操作方面，本基金本报告期内对债券市场维持中性久期与操作思路。3季度偏弱的基本面和宽松的资金面对债券市场仍构成支撑，但央行对长端债券利率的调控态度与卖券操作又对收益率的下行带来了阻力，组合综合考虑上述因素，在中性久期范围内灵活操作。纯债方面，7月逐步提升久期，8月久期先降后升，9月初将组合久期降至2年左右。可转债方面，我们低估了转债市场的残酷性，转债下跌对组合净值带来了较大的下行压力。但在行情最悲观的时候，反而具备非常好的投资机会。组合通过三个策略来挖掘机会：第一，选择基本面较好、高YTM、期限较短、没有信用违约风险的标的。第二，参与减资回售标的。第三，选择基本面较好的“三低”标的，即低绝对价格、低转股溢价率和低纯债溢价率。9月24日国新办新闻发布会及9月26日政治局会议后，转债快速反弹，组合进行了适当止盈。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬丰利一年持有债券A（转型后）的基金份额净值为1.1130元，本报告期（2024年7月31日至2024年9月30日）基金份额净值增长率为0.55%；截至本报告期末鹏扬丰利一年持有债券C（转型后）的基金份额净值为1.1027元，本报告期（2024年7月31日至2024年9月30日）基金份额净值增长率为0.49%；截至本报告期末鹏扬丰利一年持有债券D（转型后）的基金份

额净值为 1.1126 元，本报告期(2024 年 7 月 31 日至 2024 年 9 月 30 日)基金份额净值增长率为 0.54%；同期业绩比较基准收益率为 0.18%。

截至 2024 年 7 月 30 日，鹏扬丰利一年定开债券 A（转型前）的基金份额净值为 1.1069 元，2024 年 7 月 1 日至 2024 年 7 月 30 日基金份额净值增长率为 0.04%；截至 2024 年 7 月 30 日，鹏扬丰利一年定开债券 C（转型前）的基金份额净值为 1.0973 元，2024 年 7 月 1 日至 2024 年 7 月 30 日基金份额净值增长率为 0.00%；截至 2024 年 7 月 30 日，鹏扬丰利一年定开债券 D（转型前）的基金份额净值为 1.1066 元，2024 年 7 月 1 日至 2024 年 7 月 30 日基金份额净值增长率为 0.01%；同期业绩比较基准收益率为 0.71%。

#### 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 鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金（转型后）

（报告期：2024 年 7 月 31 日-2024 年 9 月 30 日）

##### 5.1.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,986,720.43	81.09
	其中：债券	49,986,720.43	81.09
	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	-760.75	0.00
	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	7,995,238.91	12.97
8	其他资产	3,665,102.20	5.95
9	合计	61,646,300.79	100.00



## 5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.1.2.2 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。

## 5.1.3 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

### 5.1.3.1 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.1.4 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	8,170,082.36	18.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	23,631,393.76	53.96
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	4,105,879.45	9.37
7	可转债（可交换债）	5,657,379.07	12.92
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	8,421,985.79	19.23
10	其他	-	-
11	合计	49,986,720.43	114.13

## 5.1.5 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	2371238	23 辽宁债 40	40,000	4,235,063.39	9.67
2	809130	24 天津 03	40,000	4,186,922.40	9.56
3	111086	19 华发债	40,000	4,134,954.96	9.44
4	019740	24 国债 09	41,000	4,132,087.84	9.43
5	102381556	23 滨州财金 MTN001	40,000	4,105,879.45	9.37

## 5.1.6 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。

### 5.1.7 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。

### 5.1.8 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。

### 5.1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.1.9.1 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。

#### 5.1.9.2 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）					-29,306.40
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

#### 5.1.9.3 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。

### 5.1.10 投资组合报告附注

#### 5.1.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，凯盛科技集团有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局的处罚。申万宏源证券有限公司在报告编制日前一年内曾受到全国中小企业股份转让系统、中国证监会、中国证监会地方监管机构的处罚。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。

### 5.1.10.2 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

本基金本报告期内未持有股票。

### 5.1.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,034.69
2	应收证券清算款	3,571,195.47
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	71,195.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	20,676.10
8	其他	-
9	合计	3,665,102.20

### 5.1.10.4 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	128081	海亮转债	849,311.85	1.94
2	113641	华友转债	561,249.92	1.28
3	113052	兴业转债	498,039.88	1.14
4	127045	牧原转债	427,982.65	0.98
5	123158	宙邦转债	348,364.86	0.80
6	113051	节能转债	314,963.33	0.72
7	127020	中金转债	272,037.70	0.62
8	110089	兴发转债	270,644.13	0.62
9	123145	药石转债	243,298.90	0.56
10	118024	冠宇转债	237,176.81	0.54
11	113661	福22转债	235,082.78	0.54
12	123119	康泰转2	229,078.95	0.52
13	127040	国泰转债	227,005.48	0.52
14	113059	福莱转债	224,943.00	0.51
15	110084	贵燃转债	196,450.84	0.45
16	113061	拓普转债	185,491.51	0.42
17	113068	金铜转债	145,930.93	0.33

18	113053	隆 22 转债	132,381.17	0.30
19	123117	健帆转债	57,944.38	0.13

### 5.1.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.1.10.6 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。

## 5.2 鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金（转型前）

（报告期：2024年7月1日-2024年7月30日）

### 5.2.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	67,860,307.10	95.00
	其中：债券	67,860,307.10	95.00
	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	3,032,307.22	4.25
8	其他资产	537,434.63	0.75
9	合计	71,430,048.95	100.00

### 5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.2.2.2 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。

### 5.2.3 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

#### 5.2.3.1 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.2.4 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	9,260,194.42	16.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	20,824,138.84	37.98
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,758,793.03	37.86
7	可转债（可交换债）	8,617,059.50	15.71
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	8,400,121.31	15.32
10	其他	-	-
11	合计	67,860,307.10	123.75

#### 5.2.5 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	102382644	23 晋能煤业 MTN007	50,000	5,290,131.15	9.65
2	102382921	23 晋能电力 MTN015	50,000	5,251,612.02	9.58
3	152735	21 济建设	50,000	5,199,122.74	9.48
4	111086	19 华发债	50,000	5,161,593.97	9.41
5	240004	24 付息国债 04	50,000	5,139,179.95	9.37

#### 5.2.6 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。

#### 5.2.7 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。

#### 5.2.8 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。

### 5.2.9 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。

### 5.2.10 投资组合报告附注

#### 5.2.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 5.2.10.2 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

本基金本报告期内未持有股票。

#### 5.2.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,932.86
2	应收证券清算款	499,891.79
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	34,609.98
8	其他	-
9	合计	537,434.63

#### 5.2.10.4 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	127049	希望转2	1,030,980.33	1.88
2	110067	华安转债	547,217.81	1.00
3	113060	浙22转债	484,687.23	0.88
4	113052	兴业转债	428,733.70	0.78
5	113605	大参转债	382,093.47	0.70
6	113056	重银转债	381,855.51	0.70
7	123108	乐普转2	367,294.45	0.67
8	113054	绿动转债	364,024.98	0.66
9	128081	海亮转债	335,059.07	0.61
10	123158	宙邦转债	331,130.25	0.60
11	113046	金田转债	293,552.05	0.54
12	113641	华友转债	274,655.39	0.50

13	110087	天业转债	260,256.43	0.47
14	110089	兴发转债	259,791.48	0.47
15	127020	中金转债	252,940.35	0.46
16	127038	国微转债	232,101.14	0.42
17	118024	冠宇转债	230,860.23	0.42
18	127056	中特转债	229,916.11	0.42
19	113059	福莱转债	228,959.70	0.42
20	113661	福22转债	226,985.09	0.41
21	123145	药石转债	221,707.12	0.40
22	127083	山路转债	218,763.50	0.40
23	128142	新乳转债	218,711.43	0.40
24	127030	盛虹转债	210,126.40	0.38
25	113061	拓普转债	173,283.58	0.32
26	127045	牧原转债	136,082.33	0.25
27	113053	隆22转债	130,653.85	0.24
28	113049	长汽转债	107,629.42	0.20
29	123117	健帆转债	54,722.47	0.10
30	113051	节能转债	2,284.63	0.00

#### 5.2.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.2.10.6 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

#### 6.1 鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金（转型后）

单位：份

项目	鹏扬丰利一年持有债券 A	鹏扬丰利一年持有债券 C	鹏扬丰利一年持有债券 D
基金合同生效日基金份额总额	17,310,871.21	32,509,832.83	90.46
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	1,119,235.20	301,036.07	-
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	1,946,566.72	9,729,574.58	-

基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	16,483,539.69	23,081,294.32	90.46

注：（1）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。

（2）本基金合同于2024年7月31日生效。

## 6.2 鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金（转型前）

单位：份

项目	鹏扬丰利一年定开债券 A	鹏扬丰利一年定开债券 C	鹏扬丰利一年定开债券 D
报告期期初基金份额总额	19,754,597.73	37,140,153.92	90.46
报告期期间基金总申购份额	-	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	2,443,726.52	4,630,321.09	-
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	17,310,871.21	32,509,832.83	90.46

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

#### 7.1.1 鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金（转型后）

本报告期内基金管理人未持有本基金。

#### 7.1.2 鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金（转型前）

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

#### 7.2.1 鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金（转型后）

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。

#### 7.2.2 鹏扬丰利一年定期开放债券型证券投资基金（转型前）

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丰利一年持有期债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬丰利一年持有期债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬丰利一年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

2024年10月24日