

鹏扬汇利债券型证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 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	1,646,253,196.12 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	1,453,755,041.60 份	192,498,154.52 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 7 月 1 日—2024 年 9 月 30 日)	
	鹏扬汇利债券 A	鹏扬汇利债券 C
1. 本期已实现收益	-9,708,298.30	-1,496,102.03
2. 本期利润	58,844,912.39	7,441,307.39
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0393	0.0374
4. 期末基金资产净值	1,611,325,144.60	210,366,529.31
5. 期末基金份额净值	1.1084	1.0928

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	3.76%	0.34%	1.81%	0.13%	1.95%	0.21%
过去六个月	3.97%	0.28%	2.58%	0.11%	1.39%	0.17%
过去一年	3.08%	0.26%	4.20%	0.10%	-1.12%	0.16%
过去三年	4.67%	0.22%	3.77%	0.11%	0.90%	0.11%
过去五年	15.15%	0.21%	8.71%	0.12%	6.44%	0.09%
自基金合同 生效起至今	31.76%	0.20%	15.10%	0.12%	16.66%	0.08%

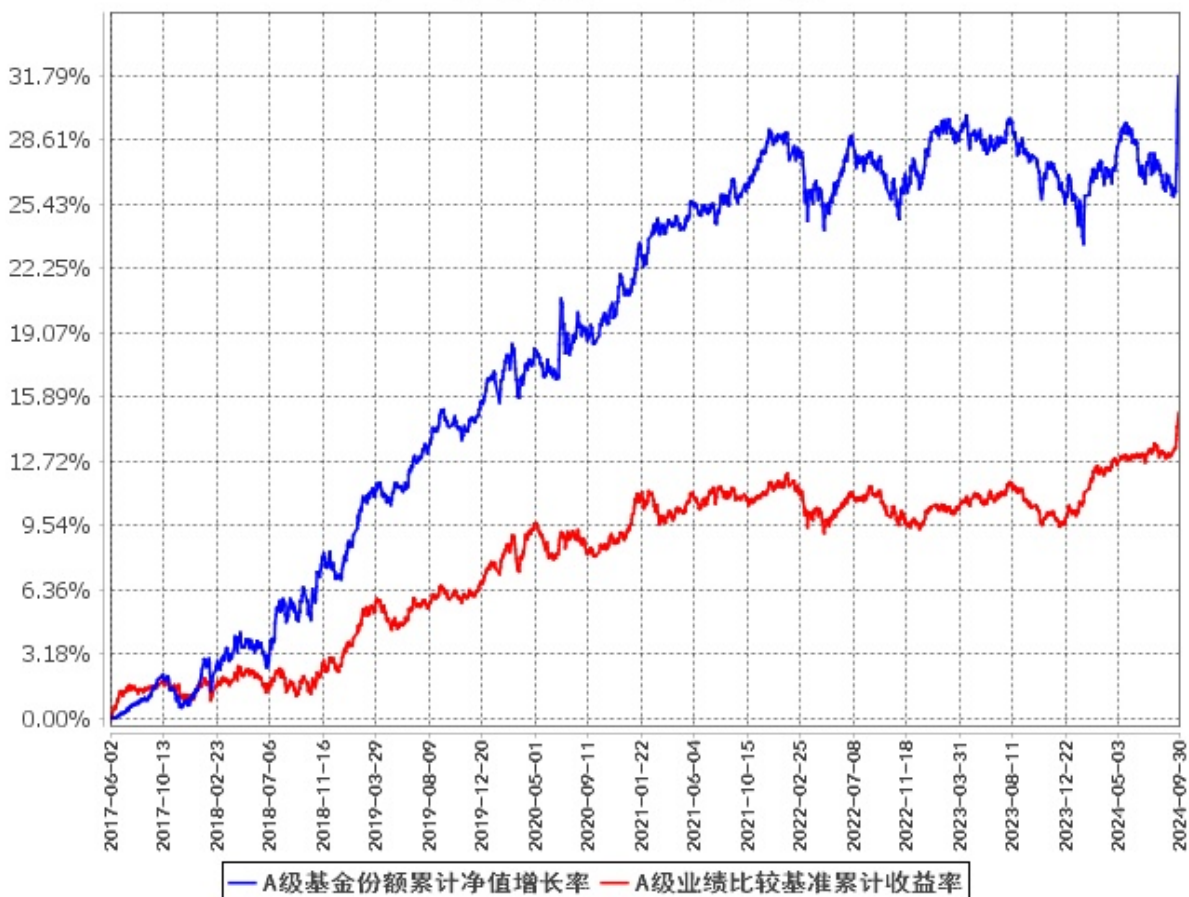
鹏扬汇利债券 C

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	3.66%	0.34%	1.81%	0.13%	1.85%	0.21%
过去六个月	3.76%	0.28%	2.58%	0.11%	1.18%	0.17%
过去一年	2.67%	0.26%	4.20%	0.10%	-1.53%	0.16%
过去三年	3.41%	0.22%	3.77%	0.11%	-0.36%	0.11%

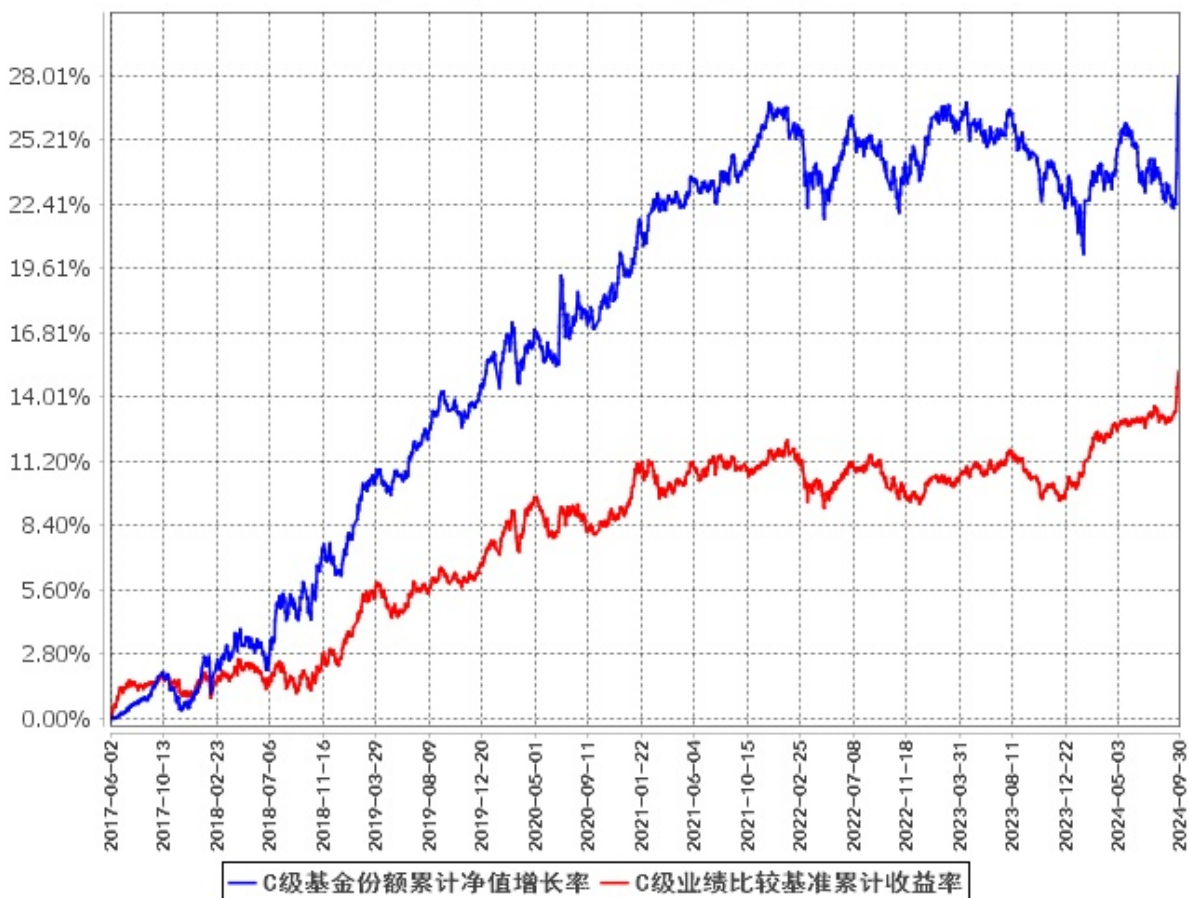
过去五年	12.86%	0.21%	8.71%	0.12%	4.15%	0.09%
自基金合同生效起至今	27.98%	0.20%	15.10%	0.12%	12.88%	0.08%

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
(2017年6月2日至2024年9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
(2017年6月2日至2024年9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	2017年6月2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日至今任鹏扬汇利债券型证券投

				<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>11</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</p>

				<p>券型证券投资基金基金经理；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 2023 年 7 月 28 日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 2024 年 4 月 18 日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；2023 年 4 月 13 日至今任鹏扬裕利三年封闭式债券型证券投资基金基金经理；2023 年 6 月 28 日至今任鹏扬淳悦一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2023 年 8 月 17 日至今任鹏扬中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理；2023 年 11 月 8 日至今任鹏扬淳泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2024 年 1 月 9 日至今任鹏扬淳旭债券型证券投资基金基金经理；2024 年 4 月 9 日至今任鹏扬中债 0-3 年政策性金融债指数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 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。转债方面，市场先跌后涨。8 月底信用风险的担忧再度加深，跌破债底的转债比例创历史新高。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。

债券操作方面，本基金本报告期内利率策略方面，7 月上旬债市调整阶段增配 5-10 年期国债；8 月中下旬和 9 月初组合大幅减仓流动性趋弱、性价比不高的地方政府债，置换成流动性和性价比较好的国债和政金债；9 月底债市大幅回调阶段，在收益率高点增配长期国债，增厚组合收益。3 季度中长期利率波动风险上升，组合结合现券操作，对利差水平明显偏低的超长端进行空头套保操作，并在季末超长端国债大幅下跌后平仓空头套保部位。信用策略方面，组合坚持中高等级信用债配置策略，并根据相对价值变化进行换仓操作，报告期内信用债整体久期在偏低水平附近灵活调整。组合在跨季后按照合理定价参与一二级市场短端信用债的投资机会，并逐步卖出了部分性价比下降、利差已压缩至低位的信用债。9 月，考虑到债券风险收益比不合适，组合将部分持仓切换至很短期限且具备较好流动性的信用债，月内组合信用债久期以降低为主。同时，继续规避资质偏弱、久期偏长的债券，保持组合的流动性。可转债策略方面，7 月份转债市场估值偏高，组合降低转债弹性进行防守；8 月份转债明显下跌，组合选择资质优秀的转债进行加仓操作；9 月份组合采用偏高的转债仓位来迎接权益市场的复苏。

2024 年 3 季度，海外股市波动加大，但总体延续强势，纳斯达克指数上涨 2.57%，标普 500 指数上涨 5.53%。A 股市场多数指数在季度末出现大幅上涨，3 季度整体表现好于海外市场。从风格来看，成长风格跑赢，代表大盘价值风格的上证 50 指数上涨 15.05%，代表成长风格的创业板指数上涨 29.21%。从行业板块来看，表现较好的行业主要是非银金融、房地产、商贸零售板块。展望未来，权益资产短期波动与分化将加大但中期投资价值提升。

股票操作方面，本基金股票仓位在季度末市场上涨后降至中性水平，主要降低了食品饮料、非

银金融和计算机行业的仓位，提高了机械和家电行业的仓位。具体而言，金融股方面，组合卖出了短期涨幅较大的龙头券商股。消费股方面，逢低加仓了估值合理的高端白酒股，逢高减仓了部分食品行业个股。周期股方面，逢低加仓了在细分领域有竞争力的机械设备股票，反弹卖出了地产股。高端制造方面，在低位买入了锂电池龙头股并部分止盈，卖出了军工个股。医药股方面，继续持有麻醉药和中药领域有吸引力的个股。TMT 方面，大幅降低了电子、计算机和通信行业的仓位。公用事业方面，继续持有水电行业个股。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汇利债券 A 的基金份额净值为 1.1084 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.76%；截至本报告期末鹏扬汇利债券 C 的基金份额净值为 1.0928 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.66%；同期业绩比较基准收益率为 1.81%。

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	186,453,387.29	8.09
	其中：股票	186,453,387.29	8.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,978,360,728.92	85.84
	其中：债券	1,978,360,728.92	85.84
	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	107,565,126.58	4.67
8	其他资产	32,243,870.95	1.40
9	合计	2,304,623,113.74	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	161,702,725.29	8.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,999,004.00	0.38
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	17,750,244.00	0.97
J	金融业	-	-
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	1,414.00	0.00
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	186,453,387.29	10.24

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	000333	美的集团	175,000	13,310,500.00	0.73
2	002507	涪陵榨菜	686,200	10,732,168.00	0.59
3	300014	亿纬锂能	213,000	10,390,140.00	0.57
4	603799	华友钴业	337,700	9,965,527.00	0.55
5	603100	川仪股份	475,890	9,888,994.20	0.54
6	300286	安科瑞	469,577	9,753,114.29	0.54
7	002063	远光软件	1,625,000	9,457,500.00	0.52

8	300748	金力永磁	628,800	9,079,872.00	0.50
9	600079	人福医药	427,200	9,009,648.00	0.49
10	603439	贵州三力	488,700	7,330,500.00	0.40

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	446,362,407.11	24.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	230,872,144.37	12.67
	其中：政策性金融债	199,654,392.30	10.96
4	企业债券	202,957,553.83	11.14
5	企业短期融资券	314,794,959.04	17.28
6	中期票据	503,476,083.94	27.64
7	可转债（可交换债）	250,449,130.22	13.75
8	同业存单	29,448,450.41	1.62
9	其他	-	-
10	合计	1,978,360,728.92	108.60

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	019739	24 国债 08	3,160,000	321,495,802.73	17.65
1	240008	24 付息国债 08	170,000	17,322,860.27	0.95
2	110059	浦发转债	1,255,410	139,112,773.18	7.64
3	163161	20 财金 01	1,000,000	102,225,331.51	5.61
4	09240202	24 国开清发 02	880,000	89,137,369.86	4.89
5	012482550	24 华能 SCP010	800,000	80,147,980.27	4.40

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)					-2,486,298.19
国债期货投资本期公允价值变动 (元)					2,983,500.00

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，国家开发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	85,376.06

2	应收证券清算款	32,086,593.80
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	71,901.09
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	32,243,870.95

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	139,112,773.18	7.64
2	132026	G 三峡 EB2	9,652,833.19	0.53
3	127015	希望转债	5,244,497.30	0.29
4	110073	国投转债	4,600,608.79	0.25
5	113049	长汽转债	4,466,074.14	0.25
6	110062	烽火转债	4,289,701.17	0.24
7	127083	山路转债	3,556,831.54	0.20
8	128134	鸿路转债	3,279,012.55	0.18
9	128135	洽洽转债	3,072,325.68	0.17
10	128142	新乳转债	2,720,997.30	0.15
11	127085	韵达转债	2,194,730.24	0.12
12	128083	新北转债	2,030,097.99	0.11
13	128109	楚江转债	2,005,692.95	0.11
14	127082	亚科转债	1,844,687.41	0.10
15	123158	宙邦转债	1,843,528.12	0.10
16	128081	海亮转债	1,836,259.22	0.10
17	127100	神码转债	1,832,638.24	0.10
18	127070	大中转债	1,832,157.95	0.10
19	118035	国力转债	1,821,672.01	0.10
20	127031	洋丰转债	1,820,505.03	0.10
21	127016	鲁泰转债	1,812,729.70	0.10
22	127040	国泰转债	1,808,098.64	0.10
23	127026	超声转债	1,798,901.03	0.10
24	128128	齐翔转 2	1,790,873.31	0.10
25	127045	牧原转债	1,753,572.15	0.10
26	113549	白电转债	1,743,522.64	0.10
27	123091	长海转债	1,740,286.13	0.10
28	110089	兴发转债	1,737,002.91	0.10
29	111002	特纸转债	1,666,709.01	0.09
30	113061	拓普转债	1,652,338.88	0.09

31	113616	韦尔转债	1,627,951.15	0.09
32	113064	东材转债	1,603,623.93	0.09
33	113054	绿动转债	1,598,237.35	0.09
34	113047	旗滨转债	1,594,907.64	0.09
35	113632	鹤 21 转债	1,587,419.80	0.09
36	113659	莱克转债	1,558,280.55	0.09
37	113666	爱玛转债	1,524,496.59	0.08
38	110084	贵燃转债	1,521,916.18	0.08
39	128141	旺能转债	1,515,082.20	0.08
40	110076	华海转债	1,502,881.00	0.08
41	113638	台 21 转债	1,476,906.15	0.08
42	113673	岱美转债	1,453,544.04	0.08
43	113627	太平转债	1,438,540.08	0.08
44	128136	立讯转债	1,437,584.25	0.08
45	113623	凤 21 转债	1,436,897.80	0.08
46	110094	众和转债	1,431,622.67	0.08
47	118025	奕瑞转债	1,424,905.12	0.08
48	118013	道通转债	1,365,490.93	0.07
49	113045	环旭转债	1,355,984.15	0.07
50	110093	神马转债	1,335,821.67	0.07
51	118024	冠宇转债	1,321,571.24	0.07
52	113068	金铜转债	1,136,099.33	0.06
53	113671	武进转债	1,126,178.02	0.06
54	123089	九州转 2	511,529.98	0.03

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	1,527,192,476.22	207,865,191.58
报告期期间基金总申购份额	968,609.07	1,455,073.32
减：报告期期间基金总赎回份 额	74,406,043.69	16,822,110.38
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	1,453,755,041.60	192,498,154.52
-------------	------------------	----------------

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

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

2024 年 10 月 24 日