

## 鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金

## 2019年第二季度报告

基金管理人:鹏扬基金管理有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2019年7月16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法律责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据基金合同规定,于2019年7月12日对本报告期间的报告事项进行了复核,并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

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。

基金净值的过往业绩并不代表未来表现。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2019年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 鹏扬淳利债券

交易代码 000671

基金合同生效日 知照,定期开放式

报告期末基金份额总额 1,889,038,367.39份

投资目标 本基金通过主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金的资产配置比例在持有现金、久期调整策略、收益曲线配置策略、债券类和股票类资产策略、国债期货策略、券商保证金策略等,通过适当的策略,在有效风险管理的基础上,获取投资回报”的有关规定。

3.3 其他指标

注:无

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理时间	离任日期	说明
陈鹤明	固定收益部总经理	2018年8月	7	本基金的基金经理,现任鹏扬基金管理有限公司固定收益部总经理,2018年8月10日起至今任鹏扬淳利债券型证券投资基金基金经理,2018年1月10日起至今任鹏淳利债券型证券投资基金基金经理,2018年4月1日起至今任鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金基金经理,2018年6月1日起至今任鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金基金经理。

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)

1.本期已实现收益 13,173,796.04

2.本期利润 13,651,753.32

3.加权平均基金份额本期利润 0.0063

4.期末基金份额净值 1,917,709,998.21

5.期末基金资产净值 1,0147

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.本期报告所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算公式中涉及的基金费用请参见本报告附注。

3.2.2 基金报告期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

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差额(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.076% 0.07% 0.016% 0.01% -0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)

1.本期已实现收益 13,173,796.04

2.本期利润 13,651,753.32

3.加权平均基金份额本期利润 0.0063

4.期末基金份额净值 1,917,709,998.21

5.期末基金资产净值 1,0147

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.本期报告所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算公式中涉及的基金费用请参见本报告附注。

3.2.3 基金报告期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

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差额(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.076% 0.07% 0.016% 0.01% -0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)

1.本期已实现收益 -9,273,070.32

2.本期利润 -11,682,175.61

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0130

4.期末基金份额净值 976,923,876.26

5.期末基金资产净值 1,0115

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.本期报告所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算公式中涉及的基金费用请参见本报告附注。

3.2.4 基金产品概况

基金简称 鹏扬淳利债券

交易代码 000671

基金合同生效日 知照,定期开放式

报告期末基金份额总额 976,438,718.23

报告期末基金资产净值 10,587,446.77份

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.本期报告所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算公式中涉及的基金费用请参见本报告附注。

3.2.5 基金净值

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)

1.本期已实现收益 1,775,407.41

2.本期利润 30,670,722.23

3.加权平均基金份额本期利润 0.0125

4.期末基金份额净值 9,715,576.02

5.期末基金资产净值 1,0768

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.本期报告所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算公式中涉及的基金费用请参见本报告附注。

3.2.6 基金的净值

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)

1.本期已实现收益 63,587,323.36

2.本期利润 39,670,722.23

3.加权平均基金份额本期利润 0.0083

4.期末基金份额净值 4,705,566.49637

5.期末基金资产净值 97,912,718.23份

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.本期报告所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算公式中涉及的基金费用请参见本报告附注。

3.2.7 基金的净值

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)

1.本期已实现收益 1,775,407.41

2.本期利润 30,670,722.23

3.加权平均基金份额本期利润 0.0125

4.期末基金份额净值 9,715,576.02

5.期末基金资产净值 1,0768

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.本期报告所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算公式中涉及的基金费用请参见本报告附注。

3.2.8 基金的净值

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)

1.本期已实现收益 63,587,323.36

2.本期利润 39,670,722.23

3.加权平均基金份额本期利润 0.0083

4.期末基金份额净值 4,705,566.49637

5.期末基金资产净值 97,912,718.23份

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.本期报告所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算公式中涉及的基金费用请参见本报告附注。

3.2.9 基金的净值

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)

1.本期已实现收益 63,587,323.36

2.本期利润 39,670,722.23

3.加权平均基金份额本期利润 0.0083

4.期末基金份额净值 4,705,566.49637

5.期末基金资产净值 97,912,718.23份

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.本期报告所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算公式中涉及的基金费用请参见本报告附注。

3.2.10 基金的净值

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)

1.本期已实现收益 63,587,323.36

2.本期利润 39,670,722.23

3.加权平均基金份额本期利润 0.0083

4.期末基金份额净值 4,705,566.49637

5.期末基金资产净值 97,912,718.23份

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.本期报告所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算公式中涉及的基金费用请参见本报告附注。

3.2.11 基金的净值

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)

1.本期已实现收益 63,587,323.36

2.本期利润 39,670,722.23

3.加权平均基金份额本期利润 0.0083

4.期末基金份额净值 4,705,566.49637

5.期末基金资产净值 97,912,718.23份

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.本期报告所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算公式中涉及的基金费用请参见本报告附注。

3.2.12 基金的净值

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)

1.本期已实现收益 63,587,323.36

2.本期利润 39,670,722.23

3.加权平均基金份额本期利润 0.0083

4.期末基金份额净值 4,705,566.49637

5.期末基金资产净值 97,912,718.23份

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.本期报告所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算公式中涉及的基金费用请参见本报告附注。

3.2.13 基金的净值

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2