信息披露 Disclosure

债券代码

111916065

180209 111810554

111804046

告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况

债券名称

8中国银行 CD046

"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

5券数量(张)

15,000,000

13.000.000

10,000,000

6.000.000

6,000,000

排余成本(元

1,491,905

,292,90

986,854,817.

596.717.497.5

1.05

0.91

0.70

0.42

0.42

(上接A11版)

3.个券选择策略 在个券选择原面、本基金将首先从安全性角度出发,优先选择央票、短期国债等高信用等级 的债券品种以规避信用违切风险。对于信用评极等级较高、符合法规规定的级别)的企业债、短 期融资券等信用类债券。本基金也可以进行配置。除考虑安全性因素外,在具体的券种选择上,基

期職簽券等信用疾恆券,全應班 医可多克日 178-288。 金管里人将薩威化 下原则: (1)根親明细资产的剩余期限、资信等级、流动性指标(流通总量、日均交易量),决定是否

金管型人将遵随以下原则:
(1)根据明组资产购剩余期限、资信等级、流动性指标(流通总量、日均交易量),决定是否纳人组合:
(2)根据个别债券的收益率(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理)与剩余期限的配比、对照基金的收益要求决定是否纳人组合:
(3)根据外别债券的资金产程指标。按方包置、流通量、上市时间),决定投资总量。
(4)若出现因市场房因所导致的收益率高于公允水平、则该券种价格出现低估、本基金格对此类低估品种比行组点交迁。
4、流动性管理项略
本基金作为现金管理工具,必须具备较高的流动性。基金管理人在密切关注基金的中胸账回情况。事节性按金流动情况和日历效应等因素基础上、对投资组合的现金比例进行优化管理、基金管理人标准商精动进代优外原则下、综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,通过现金管存。持有高流动性身种。正向回购,降低组合欠期等方式提高基金资产整体的流动性、规范日常的基金资产变现需求。
5、套利策略
由于市场环境差异、交易市场分割、市场参与者差异,以及资金优求失衡导致的中超明利率

5. 餐利減路 由于市场环境差异。交易市场分割、市场参与者差异、以及资金供求失衡导宽的中规则利率 得常差异、使用债券现券市场上存在着套利机会。本基金通过分析货市市场变动趋势、各市场和 高地之间的风险放益异,规型无险险套利利。在自然同行间和区房所市场出现的市场签到机会 会。在充分论证套利可行性的基础上的购购限套利率、基金管理、基本保证基金的安全性和流动 生的膨胀下、通生参与市场的整理和,推取机型最大风险套利机会、进行的市场、跨石种操作、以即 品价量下、通生参与市场的整理和 的超额收益。)投资决策依据和决策程序

(日) I发思历公共的第一人 人,决策依据 以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据,并以维护基金份额持有人利

2、决策程序 (1)公司设立投资决策委员会,根据宏观经济和固定收益市场的具体情况决定基金固定收 战略配置比例; 基金经理在投资决策委员会确定的战略资产配置比例下,根据市场情况对具体投资结

现在各基金值库券基础上的遗本基金的投资组合; (5)集中交易坚存有交互影视则执行,并将有关信息反馈基金经理; (6)集中分别坚存在交互影视则执行,并将有关信息反馈基金经理; (6)基金债效评估的及风险管理岗定期进行基金债效评估,并向投资决策委员会提交综合 评估意见和改进方案; (5)风险管理类分评以别,纷离,控制基金运作各个环节的风险全面负责,尤其重点关注 基金投资组合的风险状态;基金债效评估动及风险管理岗型点控制基金投资组合的市场风险和

地性风险。 (无)业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为,同期七天通知存款利率(税后) 通知存就是一种不约定存期,支取时需量前通知银行,约定支取日期和金额方可支取的存 具有存即灵活。存取方便均转能,同时可获得高于活阴存款并息的收益。本基金为货币市场基 具有存取风险。高速进的转程。根据基金的投资性别,投资目标及流动性转能,选取同期七天 17存款利率(税后)作为本基金的处绩比较基准 2020年5月40年、民后1开7万条基金的业绩比较基准。 如果今后法律法规发生变化、成者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本 辖金时、经基金管理人和基金托管人协商一数后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比 交援排车货码分。

(6大)风险收益特征 (六)风险收益特征 本基金为货币市场基金,本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基 (七)基金管理人代表基金行使权利的处理原则及方法1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利,保护基金份额持有人的利

2、有利于基金财产的安全与增值; 3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利

1. 本基金的投资组合邻超關以下限期;
(1) 同一机构设于价值榜。+企渝企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券与基金资产净值的比例台计不得超过10%。
(2) 本基金资产外值的比例台计不得超过10%。
(3) 本基金资产外值进度金资产的同时混金分资产的10%。
(3) 本基金前10金份鄉持有人的持有价额合计不超过基金总分额的20%时,本基金投资租合的平均剩余期限存值个交易日外有超过10万、平均剩余余线期不得超过20万、41当本基金前10金份鄉持有人的持有份鄉台計超过基金总份鄉约50%时,本基金投资租合的水均剩余的10金份鄉持有超过60万。由魏中央政府不超过10万、20份鄉持有人的持有份鄉台計超过基金总份鄉约50%时,本基金投资租合的水均剩余的股份有限超过60万。
(4)当本基金前10金份鄉持有人的持有份鄉台計超过基金总份鄉约50%时,本基金投资租合的水均剩余的股份。
(5) 1000年间,2000年

ファ; 5)当本基金前10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时,本基金投资约 剩余期限不得超过90天,平均剩余存续期不得超过180天;投资组合中现金、国债、中央政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计

「得低于20%; (6)本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%; (7)投资于固定期限银行存款的比例,不得超过基金资产净值的30%,但如果基金投资有存款期限。但协议中约定记是前支取的银行存款,不受该比例限制; (8)投资于具有基金社管资格的同一确址银行的存款,同业存单,合计不得超过基金资产净值20%,投资于不具有基金社管资格的同一确业银行的存款、同业存单,合计不得超过基金资产净值的6%;

值的5%; (9) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;基金持有的 捐间一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规值的10%; 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各 产支持证券会计规模的0%; 类资产支持证券合计规模的10%; (10)除发生但额键同、连续2个交易日累计键回20%以上或者连续5个交易日累计键回30% 以上的情形外、债券正回期的资金金额占基金资产净值的比例不得超过20%; (11)现金、国债,中央银开架,或程性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%; (11)型本基金前10名份额持有人的持有价额会计不超过基金总份额约20%时,现金、国债机、 中央银干燥机、或煤性金融债券以及6个交易日内到前的基金能量工具占基金资产价值的比例合

(12)当本基金前10名份維持有人仍持有份報合十不超过基金总份網的20%的,黑金、国债、中央银行理服、规律性金融债券以及50个交易日內到铜的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得较于10%。
(13)到明日在10个交易日以上的逆回购、银行定用存款等流池性受限资产净值的比例合计不得较于10%。
(14)在全国银行间间地球的价值券回购最长铜限为1年、债券回购到则后不得展明;
(14)在全国银行间间地球形成价值券回购最长铜限为1年、债券回购到则后不得展明;
(16)本基金管规于主体信用评级低于AAA的机构设专行协会融工具占基金资产净值的比例合计不得超过20%。
(16)本基金程况于主体信用评级低于AAA的机构设专行协会融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。金融工具包括债券、非金融企业的务量统工具、银行存款、间处存率,机实机构作为系统收益人的分时不得多。
(17)本基金经费于主体信用评级低于AAA的机构支行协会融工员占基金资产净值的比例合计不得超过2%。金融工具包括债券。非金融企业的务量统工具、银行存款、间处存率,机实机构作为系统收益人的分别分时间,10%10年本,10%

比例限期的,基金管理从从在10个交易上内调整完毕,以达到上还参加。但中国证面会规定的转条排海除冷、连往走现引有规定的人从规定。 本基金投资的资产支持业券须具有评较资则的资值评级机构进行持续信用评级,且其信用 评级是不低于国内信用评级机构评定的AAA级的信于AAA级的信用级别。 本基金持有的资产支持业券信用等级飞降、不即符合投资标准的,基金管理人应在评级报告 发化之日逾3个用外到其下以全部要出, 经成本已逾3个用外到其下以全部要出。

IE以興幣投资限制规定。 基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有 灾定。期间、基金的投资短围、设货策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的 4与检查自本基金合同生效之日起开始。 2.本基金不得投资于C全融工具: (1)股票; (1)股票; (2)可转换债券,可交换债券; (3)以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券,已进入最后一个利率调整期的除外; (4)信用等级在 AA+级以下的债券与非金融企业债务融资工具;

(5)中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。 二、禁止行为

) 份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动 承销证券; 违反规定向他人贷款或者提供担保;

3.从事承租无限责任的投资; 4.买卖性他基金份额。但是国务账只有规定的除外; 5.向基金管理人,基金托管人上捞; 6.从事内幕交易,操纵此券交易格格及其他不正当的证券交易活动; 7.依照法律法规有关规定;由中国证监会规定禁止的基础活动; 2.用基金财产实基金管理人,基金托管人及其股股股东,实际控制人或者与其有其他重大 关系的公司及行的证券或承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当遵明基 销粮持有人利益优先的原则。防护利益体空,然行国家管证券基督管理机构的规定,并履行信

四人好。 三、投资组合平均剩余期限的计算 、计算公式

项目

1, 计算公式 本基金按下列公式计算平均剩余期限: (Σ投资于金融工具产生的资产×剩余期限 - Σ投资于金融工具产生的负债×剩余期限 + (医内内) (投资于金融工具产生的资产-投资于金融工具产生的负债+ 债券正 同时)

)】 本基金按下列公式计算平均剩余存线期限。 (\$ 投资于金融工具产生的资产、剩余存线期限 = \$ 投资于金融工具产生的负债×剩余存 照+债券上回股ッ剩余存线期限) (投资于金融工具产生的资产 -投资于金融工具产生的负

续期限.债券让回购了和零年5%和零售。
(人名类资产和负债额会期限和剩余存续期限的确定
(人)银行证明存放,消算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存线期限为0天;证券清算款
(为)销企制期限和剩余存线期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算。
(2)回购仓超五回购和迎回购)的剩余期限和剩余存线期限以计算日至回购协议到期日的资源剩余天数计算。3期式回购产生的持回股债券的剩余期限和剩余存线期限以持续基础债券的剩余期限,待返售债券的剩余期限和剩余存线期限以计算日至回购协议到期日的资源剩余天

数计算;
(3)银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存线期限以计算日至协议到期口的安标剩余大(3)银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存线期限以计算日至协议到期日的实际剩余大数计算。有存款期限、根据协议可提前支取且设有利息损失的银行存款、剩余期限和剩余存线期限以计算日至协议回期田的实际剩余大数计算;银行通知存款的调余期限和剩余存线期限以存款的以中均定的通期期间,因 ; 组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数,

(5) 組合中國 以下情況除外。 允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余

,基金的融资、融券 ,基金的融资、融券

金額(元)

其中:债券 9,907,284,780 其中:买断式回购的买入返售融资产 3 银行存款和结算备付金合计 75,010,748,143 占基金资产净值的比例(9 占基金资产净值的比 金额(元)

| 其中:头斯式即侧融资 |本报告期内债券间则融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额 | 值比例的简单平均值。

经组合平均剩余期限基本情况

120天情况说明 注期限未超过120天 混分布比例 平均剩余期限

其中:剩余存续期超过397 的浮动利率债 其中:剩余存续期超过397 的浮动利率债 其中:剩余存续期超过397 的浮动利率债 其中:剩余存续期超过397 的浮动利率债 其中:剩余存续期超过397分的浮动和家镇

序号	债券品种	猶余成本(元)	占基金资产净值比例 (%) 0.69	
1	国家债券	969,111,882.06		
2	央行票据	-	-	
3	金融债券	6,782,466,986.07	4.80	
	其中:政策性金融债	6,782,466,986.07	4.80	
4	企业债券	-	- 2.66 0.08 33.01	
5	企业短期融资券	3,767,453,217.82		
6	中期票据	111,643,590.42		
7	同业存单	46,675,559,328.80		
8	其他	-	-	
9	合计	58,306,235,005.17	41.23	
10	剩余存续期超过397天的浮动 利率债券	258,786,666.43	0.18	

1,000,000.00 100,242,718.

债券名称 数量(份) 公允价值(元)

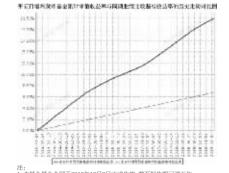
1.9.1 本基金采用摊余成本法计价,周计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买人时的溢价与新价。在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用原定份额净值、基金账面份额净值奖条保持1.00元。

照除無法下2416年4月19日銀田原採組採担保子(2016)1号处到水泥,由于汽业股行取均 有限公司(以下简称"公司"):(一) 重大关联交易未按规定审查审批且未构监管部门报告 (二)非真实转让信贷资深;(三)无授信额度或裁投信额度办理同处业务;(四)内ድ管理型。 违反审概经营规则,多家分支机构买人返售业务项下基础资产不合规;(五)同业投资接受险性 违反审赔经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规,(五)同业投资接受隐性 的第三方金融机构信用租保;(六),债券卖出回购业务违规出表;(七)个人理财资金违规投资; (八)提供日期佣签的材料;(九)部分非现场监管统计数据与事实不符;(十)个别董事未经任 职资格核相即履职;(十一)变相批遭转让个人贷款;(十二)向四证不全的房地产项目提供融 资、根据相关规定对公司司款的870万元,本基金管理人对该公司进行了深人的了解和分析,认为 该事项有利于公司规范开展业务,对公司的偿债能力哲不会造成重大不利影响。我们对该证券的 投资严格执行内部投资决策远程,符合法律法规和公司制度的规定。 本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报 告编制日前一年内受到公开谴责,处罚的证券。 13.3 其他资产构成

1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	499,456,921.01
3	应收利息	937,462,849.49
4	应收申购款	6,428,094.50
5	其他应收款	-
6	待摊费用	_
7	其他	_
8	合计	1,443,347,865.00

基金净值 基金净值 业绩比较 基准收益 [D - 3] (2 - 4)

	收益率①	率标准 差②	率(3)	率标准差		
2013.12.3-2013.12.31	0.4061%	0.0027 %	0.1088%	0.0000%	0.2973%	0.0027%
2014.1.1-2014.6.30	2.4604%	0.0021 %	0.6788%	0.0000%	1.7816%	0.0021%
2014.7.1-2014.12.31	2.3876%	0.0074 %	0.6900%	0.0000%	1.6976%	0.0074%
2015.1.1-2015.6.30	2.1589%	0.0040 %	0.6788%	0.0000%	1.4801%	0.0040%
2015.7.1-2015.12.31	1.6144%	0.0019 %	0.6900%	0.0000%	0.9244%	0.0019%
2016.1.1-2016.6.30	1.3161%	0.0014 %	0.6825%	0.0000%	0.6336%	0.0014%
2016.7.1-2016.12.31	1.2323%	0.0007 %	0.6900%	0.0000%	0.5423%	0.0007%
2017.1.1-2017.6.30	1.7375%	0.0011 %	0.6788%	0.0000%	1.0587%	0.0011%
2017.7.1-2017.12.31	2.0203%	0.0004 %	0.6900%	0.0000%	1.3303%	0.0004%
2018.1.1-2018.6.30	2.0008%	0.0004 %	0.6788%	0.0000%	1.3220%	0.0004%
2018.7.1-2018.12.31	1.6421%	0.0012 %	0.6900%	0.0000%	0.9521%	0.0012%
2019.1.1-2019.3.31	0.6935%	0.0005	0.3375%	0.0000%	0.3560%	0.0005%
自基金合同生效起至今	21.5175%	0.0036	7.2938%	0.0000%	14.2237%	0.0036%



注: 1.本基金基金合同于2013年12月3日正式生效,截至报告期已满五年; 2.按照本基金的基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的 20.人心码性人社会心同的创定。截容报告期末太基金已无规建仓,建仓结束时各项资产配置 九、基金的费用与税收

1、基金管理人的管理费; 2、基金托管人的托管费; 3、基金销售服务费; 4、基金财产拨划支付的银行费用; 、基金合同生效后的基金信息披露费用;

6.基金份额持有人大会费用; 7.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费; 8.基金的证券交易费用; 9.基金的开户费用,账户维护费用;

)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规

z时从其规定。)基金费用计提方法、计提标准和支付方式 .基金管理人的基金管理费校基金资产净值的0.33%年费率计据。 生金管理人的基金管理费校基金资产净值的0.33%年费率计据。 生通常特况下,基金管理费校前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。计算方法如下: 1=E×0.33% - 当年天数

1 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日基金资产净值

为前一日的基金资产净值

3、相自服务元 本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。销售服务费的计算方法

日 - 5 年 - 5 ■ 宣言政策、選出了目录、基础目前成分数位目、由于18万人时。即19万人时。 一数的财务数据自动在月初无个北有口内、按照指定的账户路径开资金支付、考谢法定节假 日、休息日等、支付日期顺延。费用自动和划后、管理人应进行核对、如发现数据不符、及时联系托 管人协商解决。 若遇法定节假日、休息日或不可抗力数使无法按时支付的,顺延至最近可支付日

。 4. 木膏篦(一) 卖第4至第10项费田由其会管理人和其会托管人根据有关决规及相应协议的 规定,列入当期基金费用。 (四)不列入基金费用的项目 本章第(一)款约定以外的其他费用,基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列人基金

费用。
(三)基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整
基金管理人和基金托管费和销售服务费,无须召开基金价额持有人大会。基金管理人必须最近干新的费率实施日前按照《信息按路办法》的规定在指定媒化上均是公告。

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务

基金和基础的期待每人依据国家法律法规的规定,被订对%又旁。 十、其他应按路事项 (一)本基金管理人、基金托管人目前无跟大诉讼事项。 (二)是近半年本基金管理人、基金托管人及高级管理人员没有受到任何处罚。 (三)2018年12月3日至2019年6月2日发布的公告; 1、2018年12月6日、关于旗下部分基金参与平安镇行费率调整的公告; 2、2018年12月25日,平安日增利货币市场基金2019年元且假期前暂停中购、转换转人及定期

定额投資业务的公告: 3.2019年1月3日,平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告; 4.2019年1月3日,关于新增腾安基金销售(深圳)有限公司为平安日增利货币市场基金销售 告; 19年1月12日,平安日增利货币市场基金招募说明书更新(2018年第2期)以及擴要;

5,2019年1月12日,半安日增利货币市场基金销券说明书更新(2018年第2期)以及續要; 6,2019年1月17日,关于不法分子冒用"花生宝"名义开展非法金融业务的严正声明; 7,2019年1月18日,平安日增利货币市场基金2019年第4季度报告。 8,2019年1月29日,平安基金管理有限公司关于哲停大泰金石基金销售有限公司代销旗下部

テ的公告; n 2019年2月12日 巫安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告 10,2019年2月12日,干文施亚普查申德公司天丁县申邮产台协变支约公司; 11,2019年2月26日,关于康广基金投资基金管则人关联公司代理销售证券的公告; 12,2019年2月27日,平安基金管则有限公司旗下开放工基金转换业务规则说明的公告; 12,2019年3月日,关于普修为州财路基金销售有限公司代销财产股分基金业务的公告; 14,2019年3月16日,关于旗下部分基金新增上海凯石财富基金销售有限公司付销售机构的

公告; 15、2019年3月22日,平安日增利货币市场基金基金经理变更公告; 16,2019年3月26日,平安日增利货币市场基金2018年年度报告以及摘要; 17,2019年3月29日,关于暂停北京钱景基金销售有限公司、浙江金观诚基金销售有限公司代

销旗下部分基金业务的公告; 18、2019年4月2日,平安日增利货币市场基金基金经理变更公告;

19.2019年4月2日,天子斯下部分基金新增显定理定果公管:
19.2019年4月2日,关于斯下部分基金新增国施证券有限责任公司为销售机构及开通定投、 业务并参与其费率优惠的公告;
20.2019年4月18日,平安日增和货币市场基金2019年第1季度报告;
21.2019年4月26日,平安日增和货币市场基金劳动节假期前暂停中购,转换转人及定期定额 业务的公告; 21,2019年9月20日,平天日旬中7度、100 投資业券的公分 22,2019年5月10日,关于旗下部分基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构及

22.2019年5月10日,大丁県「PUZTBEE#FIELLS/PL-POP/CBEE#FIELD THE PABLE PL-POP/CBEE#FIELD THE PABLE PL-POP/CBEE*FIELD THE PA

十一、对招募说明书更新部分的说明 本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》等其他相关法律法规的要求及基金 合同的规定,对2019年1月12日公布的《平安日增利货币市场基金招募说明书更新(2018年第2期)》进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,

1、联启级前资料,更新了"三、基金管理人"。 3、根据最新资料,更新了"三、基金管理人"。 4、根据最新资料,更新了"四、基金托管人"。 5、根据最新资料,更新了"八、基金份额的申赎 6、根据最新资料,更新了"九、基金的报资"。 、根据最新资料,更新了"八、基金份额的申购与赎回" 、根据最新资料,更新了"九、基金的投资"。 根据最新资料,更新了"十、基金的业绩"。 根据最新资料,更新了"二十二,其他应披露的事项" 9、根据最新情况,更新了"二十三、对招募说明书更新部分的说明 10、根据最新情况,更新了"二十五、备查文件"。

根据最新资料,更新了"重要提示"部分

主要更新的内容如下

平安日增利货币市场基金 基金经理变更公告

基金简称 · 开募集证券投资基金信息披露 告依据 基金经理变更类 新任基金经理姓 管理本基金

国基金业协会完成相关手续,并报中国证监会深圳监管局备案

平安合锦定期开放债券型发起 式证券投资基金分红公告

《证券投资基金信息披露管理办法》及本是

截止收益分配基准日 的相关指标 43.031.168.16 0.120

(1-142) 注:基金收益分配局基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值 理位基金份额选分配金额原不能低于面值。本基金本次分红符合基金合同相关规定 2、与分红相关的其他信息 权益登记日在注册登记机构平安基金管理有 同登记在册的本基金的全体基金份额持有人 红对象 [利再投资相关事项的说明 根期耐放電、国家积务总局的财影字[2002]128 《关于开放式证券投资基金有关税收局题的 知》,投资者包括个人和机构投资者从基金收益 配中取得的收入,售不征收个人所得税和企业所

元323。 权益登记日 (2019年9月23日) 注册登记机构可以受理分红方式变更申请 . 但该申请仅对以

(5)咨询办法: ①登陆水公司网站:www.fund.pingan.com ②被打水公司客户服务热验,400–800–4800 ③平安基金管理有限公司直销网点及本基金各代销机构的相关网点 (详见本基金招赛说明

不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。本公司提醒投资者 投资者投资于基金前应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风

鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

基金管理人: 聰扬基金管理有限公司

告。 4、投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。投资人需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括:市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险等等。此外、本基金以入民市100元为初始面值进行募集,在市场波动等因素的影响下,存在基金份额净值跌破人民

动性风险。操作和技术风险。合规性风险等等。此外,本基金以人民币1.00元为的的面值进行募集,在市场波动等因素的影响下,存在基金份额净值跌破人民币1.00元的初始面值的风险。

5.本基金为债券超基金、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。
6.本基金可投资资产支持证券、资产支持证券可能面临的信用风险、利率风险、流动性风险、提前使付风险等风险。操作风险和法律风险,由此可能增加本基金净值的波动性。
7.基金合同性效后,连续六十个工作目出现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情形的,基金管理人应当终止《基金合同》,并按照《基金合同》的约定程序进行背景、无需召开基金份额持有人、数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的,基金管理人应当终止《基金合同》,并按照《基金合同》的约定程序进行音频、无需召开基金份额持有人、数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的,基金管理人应当终止《基金合同》,明为反《基金合同》的约定程序进行背景、无需召开基金份额持有人大会。因此基金份额片有人称可能面临《基金合同》自自动终止的风险。。
8.基金不同于银行储蓄与债券、投资人有可能获得较高的收益。也有可能损失金金管现人是全个人等,不被不要求,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。
10.基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则,在投资人作出投资决策。由公营状况与基金净值变化引致的投资风险。由投资人自行负责。11、本招募说明书所载内容截止日为2019年8月9日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2019年6月30日(财务数据未经审计)。
- 基金管理人

办公地址:北京市区 邮政编码:100045

邮政编号10004 法定代表人·杨爱斌 成立日期;2016年7月6日 批准设立机关及批准设立文号;中国证监会证监许可[2016]1453号 组织形式,有限责任公司

组织形式:有限责任公司 注册资本:1.18亿元人民币 存续期限:持续经营 联系人:张妍 联系电话:010-68105888

(二)主要人员情况 1、基金管理人董事会成员

(二)主要人员情况
1. 基金管理人董事会成员
范勇宏先生:董事长、经济学博士。现任香山财富研究院联席理事长、宏实
资本管理有限公司执行董事兼总经理。管压后在中国越设银行、华夏证券股份
有限公司、华夏基金管理有限公司、中国人寿资产管理有限公司等单位工作。从
事金融工作近30年,具有比较丰富的金融产业经济学硕士。现任蒯扬基金管理
有限公司总经理。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险(集团)股份有
有限公司总经理。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险(集团)股份有
有限公司总经理。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险(集团)股份有
病别分资管理有限公司董事长兼总经理。
姜山先生:董事,美国司耶安纳大学商学院工商管理硕士。现任上海华石投
资有限公司执行董事兼总经理,北京鹏扬企业管理有限公司执行董事兼总经
理。历任安达信华强会计师事务所审计师美国家和 Lee公司内部审计师,瑞银
投资银行重事,高庭亚州和民公司执行董事,美国国州东公司投资银行部董事总经理,
李刚先生:董事,中国社科院经济学博士。现任制扬基金管理有限公司副总
经理。历任中国农业银行资产负债管理部交易员、资金营运部高级交易员、金融
市场部处长、副总经理。

"以管理有限公司财务总监。历任安永会计师事务所实国级分易员、金融
市场部处长、副总经理。大明全时会计师事务所上海分所高级经理、统工的公司财务总监。

"政党管理有限公司财务总监。历任安永会计师事务所实国组织分所高级审计师,高级企业。有限公司财务总监。历任安永会计师事务所实国组织分所高级有,1年,有限公司财务总监。原任安全公司财务总监。原任守张金融金、新明省公司财务总监。

王鹤非女士,独立董事,美国斯坦福大学商学院金融系哲学博士。现任中国人民大学汉青研究院金融系副教授,副原本庄。历任美国伊利诺伊大学芝加哥分校商学院金融系助理教授,美联储芝加哥银行访问经济学家,清华大学经济管理学院金融系访问学者,中国投资有限责任公司风险管理部访问经济学家。董克用先生,独立董事,中国人民大学经济学申士,现任中国人民大学公共管理学院教授,兼任中国行政体制改革研究会副会长、建信养老金管理有限责任公司独立董事及深圳品生医学研究所有限公司董事,历任中国人民大学劳动人事学院副院长。院长、中国人民大学公共管理学院院长。

2.基金管理人监事会成员
王徽先生:监事,江苏大学经济学学士。现任中钰资本管理(北京)股份有限公司合伙人,首席风控官。历任中国华昌电子集团会计、爱韩华电子(无锡)电子有限公司财务经理、江苏苏亚会计师事务所南方分所审计经理、北京中星、被电子有限公司财务经理、江苏苏亚会计师事务所南方分所审计经理、北京中星、被电子和公司财务经理、江苏苏亚会计师事务所南方分所审计经理、北京中国华福电子集团会计、爱韩华电子(无锡)电子有限公司财务经理、江苏苏亚会计师事务所南方分所审计经理、北京中星、

所即向级定理。 曹铮女士:监事(职工监事),北京大学经济学学士。现任鹏扬基金管理有

曾存义于:血事(联仁血事), 心尔人子经疗子子工。现亡时的独生由自建有限公司人力资源及行政管理部总监。仍任国家市网公司公司监察局负负, 北京科能整合创意咨询有限公司人事助理, 索尼爱立信(中国)有限公司人事专员, 微软亚洲研究院人事经理, 北京興勝投疫管理公司人力资源及行政管理部总监。

3、同双巨理八四、 杨爱就先生。总经期,复旦大学国际金融专业经济学硕士。历任上海浦东发 展银行信贷员、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 基金管理有限公司董事长兼总 经理。

经理。 李刚先生:副总经理,中国社科院经济学博士。历任中国农业银行资产负债 管理部交易员、资金营运部高级交易员、金融市场部处长、副总经理。 陈钟闻先生:固定收益部执行总经理、现金策略总监、毕业于北京理工大 学、江商管理硕士。曾任北京鹏扬投管理有限公司交易主管、投资经理。 6上述人员之间均不存在近亲属关系。 6,上述人员之间均不存在近亲属关系。 二、基金托管人 名称:上海浦东发展银行股份有限公司

名称:上海佣东及12号 注册地址:上海市中山东一路12号 办公地址:上海市中山东一路12号 法定代表人:高国富 成立时间: 1992年10月19日 三、相关服务机构

)基金份额销售机构 (一)基金份领用自2003 1.直销机构 (1)關粉基金管理有限公司直销柜台 办公地址:北京市西城区复兴门外大街A2号中化大厦16层 法定代表人,杨爱斌 全国统一客户服务电话:4009686688

(2)鹏扬基金管理有限公司直销电子交易平台客服电话:4009686688

1943: www.byanictom 2. 其他前首北急前售有限公司 注册地址: 上海市紅口区欧阳路196号26号楼2楼41号 办公地址: 上海市浦客南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室 联系、: 徐超逸 电話-021-02613988-6671 传算-021-68596919 客戸服务电话-400-700-9665 例址: www.ehowbuy.com

M证:www.ehowbuy.com (2)上海天天基金销售有限公司 注册地址:上海市徐元区龙田路190号2号楼2层 办公地址:上海市徐元区宛平南路88号金座东方财富大厦 法定代表人:其实 联系人·何楚

办公地址:上海浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室 法定代表人:王翔

客服电话:400-820-5369

联系电话:0571-88911818-8659 客服电话:4008-773-772

客服电击:4008-773-772 例財:www.5ftind.com (5)北京汇成基金销售有限公司 注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108号 办公地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座1108号 法定代表人;王伟刚 联系人:王骁骁 电话:010-56251471 客服电话:400-619-9059 网址:www.hcjijin.com 6)腾安基金销售(深圳)有限公司 されば文金並明書(採列)有限公司 注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(人驻深圳市前

注册地址: (200mm) 海商务秘书有限公司) 办公地址: 深圳市南山区科技中一路腾讯大厦 等多部书育限公司) 办公地址: 深圳市南山区科技中一路腾讯大厦 法定代表人,刘明军 联系人: 選毀锋 联系电话: 0755–86013388–77386 客服电话: 95017 例址: www.tenganxinxi.com (7)上海陆金所基金销售有限公司 注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 法定代表人: 鮑东华 联系人:程晨 統八:住辰 话: 021-20665952 真: 021-22066653 字服电话:4008219031

が公地址:南京市政後区中山北路2号線 法定代表人: 吴言林 联系人: 林伊灵 电话:025-6604 6166(分机号转810) 客服电话:025-66046166

(二)登记机构 名称:鹏扬基金管理有限公司 3你: 鹏切基並旨理有限公司 b公地址 : 北京市西城区复兴门外大街A2号中化大厦16层

网址:www.huilinbd.com

办公地址:北京市西城区复兴门外大街A2号中化大 法定代表人,杨爱斌 全国统一客户服务电话: 4009686688 联系人,韩敦 传真: 010-68105832 (三)出具法律意见书的律师事务所 名称:上海迪力律师事务所 注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼 办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼 负责人:俞卫锋

负责人。南卫锋 电话:021-31358666 传真:021-31358600 联系人,黎明 陈额华 经办律师:陈额华 (四)会计师事务所 各称:安米·坦纳会计师事务所(特殊普通合伙) 住所:北京市东城区东长安街·号东方广场安永大楼17层01-12室 办公地址:北京市东城区东长安街·号东方广场安永大楼17层01-12室 执行事务合伙人:毛鞍宁 贬奉由语:(010)58153000 联系电话:(010)58153000 传真电话:(010)85188298 经办注册会计师:王珊珊,贺耀

联系人、贺耀 四、基金的名称 鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金 五、基金运作方式和类型 (一)运作方式

(一) 运作方式 契约型、定期开放式 本基金以定期开放方式运作, 即以封闭期和开放期相结合的方式运作。本 基金的首个封闭期为自基金合同生效日(含该日) 起至基金合同主处日(含该 日) 起至首个开放期结束之日次日所对应的三个月月度对日的前一日, 以此类 相, 如该对应日期为非工作目,则顺延至下一个工作日, 若该几月月度中不存在 对应日期的,则顺延至该日历月最后一日的下一个工作日。本基金在封闭期内 不办理申购与赎回等业务(红利再投资除外),也不上市交易。 本基金自每个封闭期结束后第一个工作日(含该日)起进入开放期,期间 可以办理申购与赎回等业务。本基金每个打成期不少于两个工作日并且不稳过。 十个工作日, 如封闭阴结束后或在开放期内发生不可扰力或其他情形致使基金 无法按时开放申购与赎回等业务的,或依据基金合同需暂停申购或赎回等业务 的,开放期时间睡证,直旁端是开放期的时间更求。并放期的里途时间睡证,直旁端

的,开放期时间顺延,直到满足开放期的时间要求,开放期的具体时间由基金管理人在每个开放期前依照 《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公

是人住存了开放利削保限《信息按摩办法》的有关规定往往在原外工厂以次告。
(一)基金的类型 使养型证券投资基金 六、基金的投资目标 本基金通过利极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。七、基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债,免行实照。金融债,地方政府债,政府支持机构债。企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、资产支持证券、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货产市场工具、债券与购以法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关和定)

法律法规或中国计量经元计基址区对1928年1928年8人 关规定)。 本基金投资债券的比例不低于基金资产的80%(开放明开始前十个工作 日至开放明结束后十个工作日内不受此比例限制)。开放期内,保持不低于基金 资产单值5%的现金或者到期日任一年以内的政府债券;在封闭期内,本基金 不受上述5%的限制。其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收 在产件里。2003年100年10日 2003年10日 2003年10日 2003年10日 2003年11日 20

(一)封闭期投资策略 本基金的投资资略包括买入持有策略、久期调整策略、收益率曲线配置策 略、债券类属和板块较换废略、骑乘策略、价值驱动的个券选择策略、通度的融 资杠杆策略、资产支持证券投资策略等,在有效管理风险的基础上,达成投资目 1、买人持有策略 以简单、低交易成本为原则,挑选符合投资需求的标的债券,持有到期后再 547年 *** 1478-4584

转而投资新的标的储券。 2.久期课整键略 根据对市场利率水平的预期,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地 转假对市场利率水平的预期,在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券 价格下降的风险。 3、收益率曲线配置 在久期确定的基础上,根据对收益曲线形状变化的预测,确定采用子弹型 策略、哑铃型策略和梯形策略、在长期、中期和短期债券间进行配置,以从长、 中、短期债券的相对价格变化中获利。 4. 板块轮换策略 根据国债、金融债、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析,增持 相对低估的板块、减持相对高估的板块,借以取得较高收益。 5. 骑乘策略 强计处压性分类性的

5. 躺來環略 通过分析收益率曲线各期限段的利差情况,买人收益率曲线最陡峭处所对 期限债券,随着所持有债券的剩余期限下降,债券的到期收益率将下降,从 而获得资本利得。
6、个券选择策略
用自下而上的方法选择价值相对低估的债券。通过考察收益率曲线的相对
位置和形状,对比不同信用等级。在不同市场交易债券的到期收益率等方法、结
合票息、竞议、可否回购。能入期权等其他决定债券价值的因素,从而发现市场
中个券的价值相对低估状况。
7、融资杠杆策略
通过分析回购品种之间的利差及其变动,结合对年末效应和长假效应的灵
活使用,进行中长期回购品种的比例配置,同时在严格控制风险的基础上利用
跨市场套利和跨期限套利的机会。
8、资产支持证券投资策略
重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补

(據收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。 (二)开放明投资策略 开放明内,为了保证组合具有较高的流动性,方便投资人安排投资,本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下,主要投资于具有较高流动性的投资品种,通过合理配置组合期限结构等方式,积极防范流动性风险,在满足组合流动性需求的同时,尽量减小基金净值的被动。 未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。 九.业缴比较基框 中债总财富论值指数收益率。 十.风险收益特征

返售金融资产 报告期末按行业分类的股票投资组合

(二) 报告期本按行业分类的股票投資租告 1.报告期末按行业分类的渝内股票投资组合 注:本基金本报告期期末未持有股票。 2.报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 注:本基金本报告期期末未持有港股通标的股票。 (三)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

日家侍弟 融债券 中:政策性金融债

明细 注:本基金本报告期期末未持有贵金属投资。 (八)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

(34) (34) 注:本基金本报告期期未未持有权证。 (九)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 1.本期国债期货投资政策 注:本报告期内,本基金未参与国债期货投资。 2.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 注:本基金本报告期末未持有国债期货。 3.本期国债期货投资评价 注:本报告期内,本基金未参与国债期货投资。 (十)投资组合报告附注 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

注:本基金本报告期内未持有股票。 、其他资产构成

与TEANAX 待摊费用 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 注:本基金本报告期末未持有可转换债券。5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明注:本基金本报告期期末未持有股票。 3.其他需要揭示的事项 (1) 的战差已已以后(专权益整记日)申请申购,转旋转人的基金份额不享有本次分红权益,权益登记日申请赎回,转旋转出的基金份额享有本次分红权益。 (2)对于未选择具体分红方式的投资者,本基金票认的分红方式为现金分红。本次分红确认的方式按照投资者在权益能已出之前最后一次选择的分红方式分离。 7.7.A.M.SATHIKER(1911年7月)。 (3) 持有人可發桑太空间的网站或被打水公司客限电话查询注册登记系统记录的分红光。 4.投资者部部设置或修改本次分红方式,请务必于权益登记日之前一日的交易时间结束前(周 1916年月20日150的)到销售相限构成或通过销售机构提出的线值往辈现场交易方式修及分式 式、投资者在权益登记日前一个工作日超过交易时间提交的修改分红方式的申请对本次收益 的收益分配有效,而对本次收益分配无效。 (4)投资者还可以到本基金的代销机构查询本基金本次分红的有关情况。

的招募说明书, ロコロップ 1700年177。 本基金合同生效日为2018年8月9日,基金合同生效以来(截至2019年6月 30日)的投资业绩及同期基准的比较如下表所示:

明基准的比较如 值 基金净值收益 ⑤ 率标准差② 阶段 0.09% 一三、基金费用与税收

2、基金托管人的托管费: 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用; 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;

9、按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费 用。 (二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1.基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计

本基金的托管费按前一日基金资产净IBID'0.10%时产品中,从。 计算方法如下: 日= E × 0.10% - 当年天数 日为每日版计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一 致的财务数据,按照与基金管理人协商一致的方式在次月初5个工作日内,按照 指定的帐户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法 定节假日、公休日等,支付日期顺延。 上述"一、基金费用的种类"中第3 - 9项费用,根据有关法规及相应协议规 定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。 (三)不列人基金费用的项目 下列费用不列人基金费用:

(三) / 1/99] / 全並並付用的項目 下列费用不列人基金並用: 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出

1、基並百唑人科經經刊口公園公園 或基金财产的损失; 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用; 3、《基金合同》生效前的相关费用; 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列人基金费用的

。 (四)基金税收 (四)基金税收本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金阶户投资的相关税收,由基金的领持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。(五)与基金销售有关的费用。1 申购费率(1)本基金基金份额在申购出收取申购费用,申购费率最高不超过0.40%,且随申购金额的增加而递减,如下表所示:

中购金额(1) 中购金额(1) 中购费率 (1) 中购费率

特定申购费率: 申购金額(M 申购费率

M≥800万 注:上还特定申购费率适用于通过本公司直销和台集中申购本基金基金份额的养老金客户,包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等。具体包括:全国社会保障基金;可以投资基金的地方社会保障基金;企业年金申一计划以及集合计划;企业年金里争会委托的特定客户资产管理计划;企业年金养老金产品。如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,本公司在法律法规允许的前提下可将身纳人养老金产超。 (2)基金份额的申购费用不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记季各项费用,投资人一天内有多笔申购基金份额的,须按每次申购所应对的费率档次分别计费。

Y≥30天
注:本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于7天的投资人收取的赎回费全额计人基金财产,对持续持有期不少于7天的投资人收取的赎回费的25%计入基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的于续费。基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整费率或收费方式

I关内容; 2.在"第三部分 基金管理人"部分,更新了基金管理人的相关信息; 3.在"第四部分 基金托管人"部分,更新了基金托管人的相关信息; 4、在"第五部分 相关服务机构"部分,更新了部分信息; 5.在"第九部分 基金的投资"部分,增加了基金的投资组合报告部分内

注:由于四百五人印除四,中四次2000年 十二、基金的业绩 基金管理人承诺以格尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金 财产,但不保证基金一定盈利,也不向投资者保证最低收益。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

基金名称 基金托管人名科 \ 告依据 收益分配基准

本次分红免收分红手续费和红利再投资费用。选择 红利再投资方式的投资者其红利再投资的基金份 额免收由购费用。 界相关事项的说明 :选择现金红利方式的投资者的红利款将于2019年9月24日自基金托管账户划出

本公司承诺以诚实信用、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,也

2019年第2号)

T、ANAUNCETHILL 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 金、股票型基金,属于中低风险/收益的产品。 型基金,展界型基金,属于中版风险/收益的/产品。 十一基金的投资组合报告 基金管理人的董事会及董事保证本报告所裁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。 基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019 年7月12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,误导性性远或者重大遗漏。 以下内容摘自本基金2019年第2季度报告,所列财务数据未经审计。

)报告期末基金资产组合情况 金額(元

资明细 注:本基金本报告期期末未持有股票。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大

说明 况明 注:本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案 调查的情况,在报告编制日前一年内未受到公开谴责,处罚。 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

费率或收费方式如发生变更,基金管理人最迟应在新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

6、新增了"第十部分 基金的业绩"相关内容; 7、新增了"第二十二部分,其他应按索事项"这一部分,列示了本基金招募说明书更新期间,本基金及基金管理人的有关公告。

算方法如下:

H = E×0.30% - 当年天教
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计量,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一
致的财务数据,按照与基金管理人协商一致的方式在次月初5个工作日内,按照
指定的账户略径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划按指令。若遇法
定节假日、公休假等,支付日期顺延。
2.基金托管入的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的
计算方法如下

2、赎回费率 本基金基金份额的赎回费率见下表。

鹏扬基金管理有限公司 2019年9月19日