

# 鹏扬富利增强债券型证券投资基金

## 2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 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 2023 年 4 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	鹏扬富利增强
基金主代码	008069
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 21 日
报告期末基金份额总额	57,038,603.42 份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下，力争为基金份额持有人创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金的投资策略包括资产配置策略、信用债投资策略、可转债/可交换债投资策略、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、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。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*60%+中证可转换债券指数收益率*30%+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	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鹏扬富利增强 A	鹏扬富利增强 C
下属分级基金的交易代码	008069	008070
报告期末下属分级基金的份额总额	25,161,284.28 份	31,877,319.14 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 (2023 年 4 月 1 日 — 2023 年 6 月 30 日)	
	鹏扬富利增强 A	鹏扬富利增强 C
1. 本期已实现收益	206,001.12	200,669.82
2. 本期利润	-66,055.78	-115,741.47
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0024	-0.0036
4. 期末基金资产净值	26,562,368.27	33,224,371.42
5. 期末基金份额净值	1.0557	1.0423

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

###### 鹏扬富利增强 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	-0.25%	0.18%	0.45%	0.19%	-0.70%	-0.01%
过去六个月	1.59%	0.20%	2.56%	0.19%	-0.97%	0.01%
过去一年	-2.83%	0.19%	0.09%	0.22%	-2.92%	-0.03%
过去三年	5.68%	0.23%	12.43%	0.28%	-6.75%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	5.57%	0.23%	11.69%	0.28%	-6.12%	-0.05%

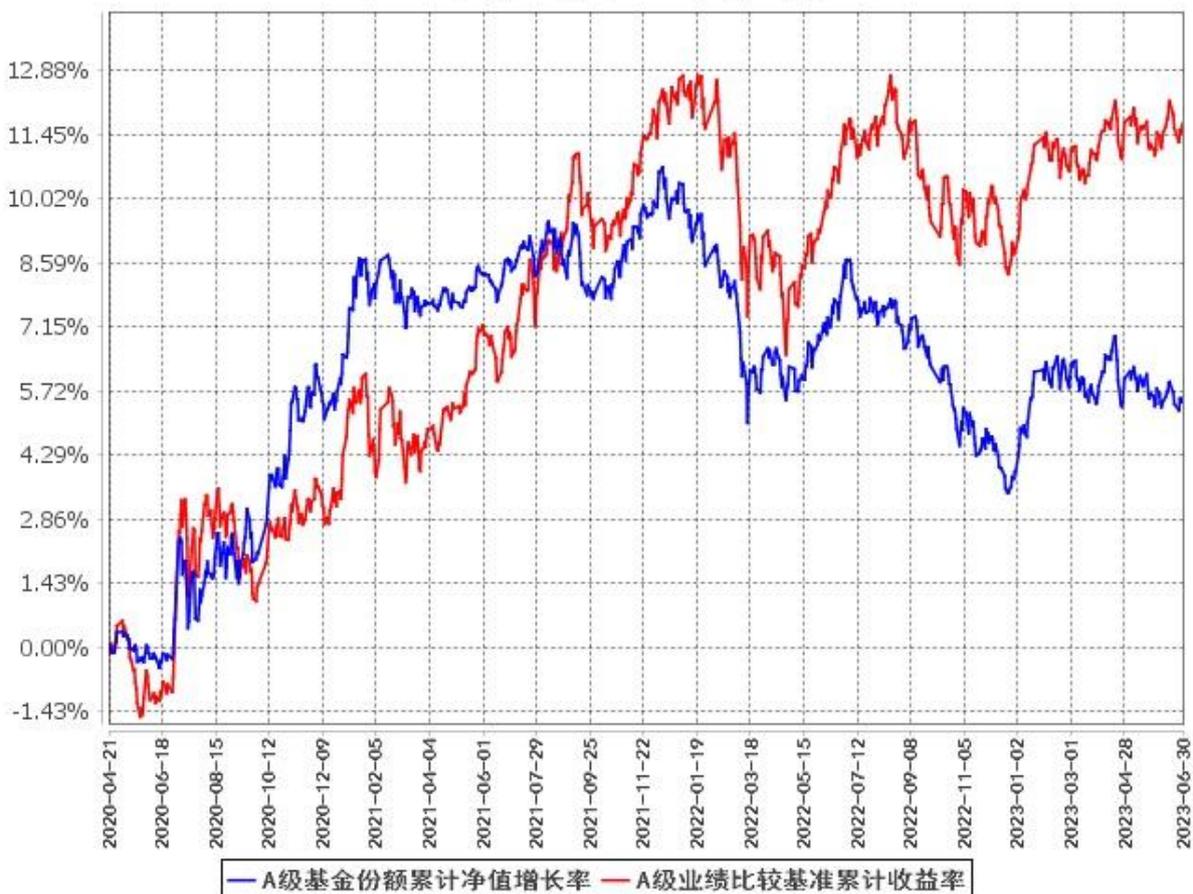
###### 鹏扬富利增强 C

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	-0.34%	0.18%	0.45%	0.19%	-0.79%	-0.01%
过去六个月	1.39%	0.20%	2.56%	0.19%	-1.17%	0.01%
过去一年	-3.21%	0.19%	0.09%	0.22%	-3.30%	-0.03%
过去三年	4.42%	0.23%	12.43%	0.28%	-8.01%	-0.05%

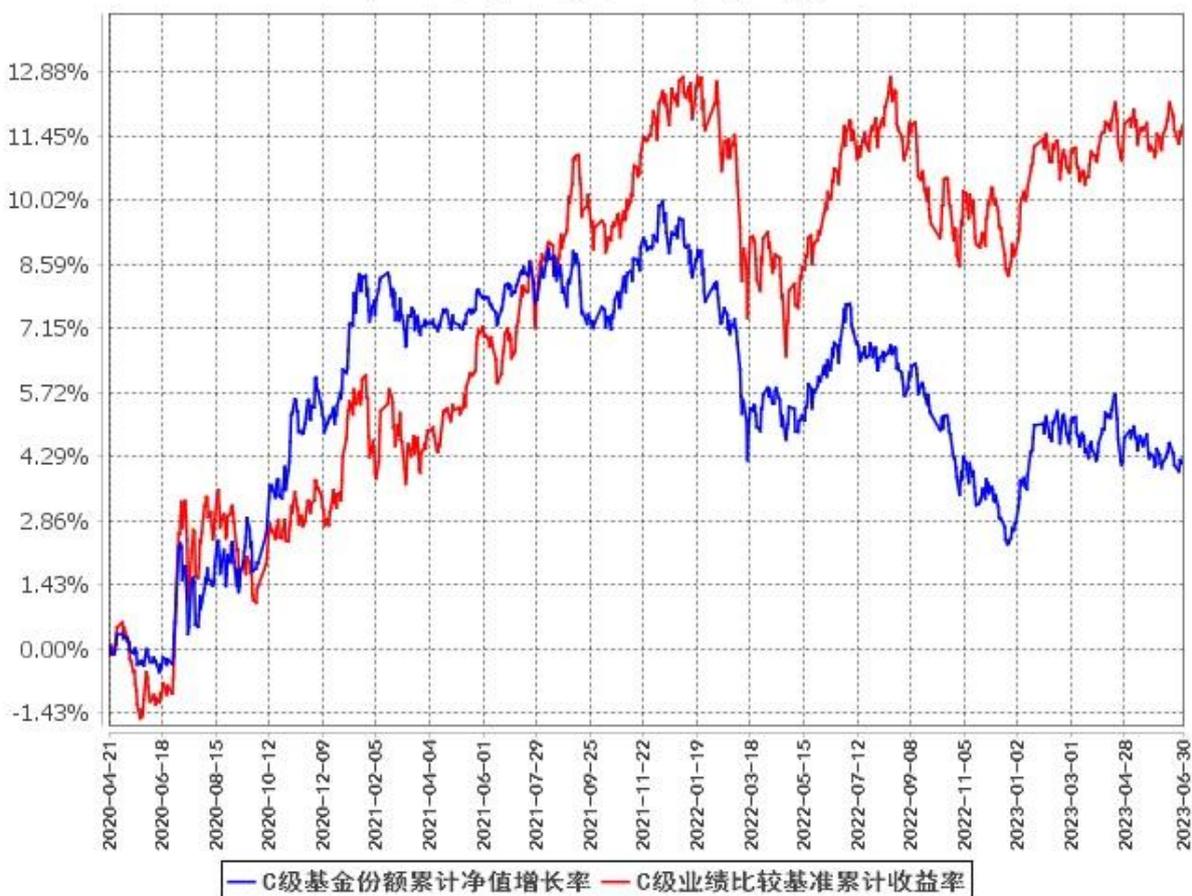
自基金合同生效起至今	4.23%	0.23%	11.69%	0.28%	-7.46%	-0.05%
------------	-------	-------	--------	-------	--------	--------

### 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  
(2020年4月21日至2023年6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  
(2020年4月21日至2023年6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		
王华	本基金基金经理, 公司总经理助理兼固定收益总监	2020年4月21日	-	13	清华大学理学学士, CFA、FRM。曾任银河期货有限公司研究员、金融市场部固定收益总经理, 银河德睿资本管理有限公司固定收益部总经理, 北京鹏扬投资管理有限公司衍生品策略部总经理。现任鹏扬基金管理有限公司总经理助理兼固定收益总监。2018年2月13日至今任鹏扬双利债券型证券投资基金基

				<p>金经理；2018 年 4 月 3 日至 2019 年 8 月 15 日任鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 5 月 10 日至 2019 年 8 月 15 日任鹏扬景欣混合型证券投资基金基金经理；2018 年 6 月 21 日至 2022 年 7 月 18 日任鹏扬淳合债券型证券投资基金基金经理；2018 年 12 月 12 日至 2021 年 3 月 18 日任鹏扬淳享债券型证券投资基金基金经理；2019 年 3 月 28 日至今任鹏扬添利增强债券型证券投资基金基金经理；2019 年 12 月 25 日至 2021 年 1 月 25 日任鹏扬淳明债券型证券投资基金基金经理；2020 年 2 月 27 日至 2022 年 1 月 5 日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；2020 年 4 月 21 日至今任鹏扬富利增强债券型证券投资基金基金经理；2020 年 8 月 26 日至 2021 年 12 月 24 日任鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2020 年 10 月 28 日至今任鹏扬稳利债券型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 7 日至今任鹏扬景安一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 8 月 6 日至今任鹏扬景润一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 9 月 9 日至今任鹏扬景浦一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2022 年 5 月 24 日至今任鹏扬丰利一年定期开放</p>
--	--	--	--	--

					债券型证券投资基金基金经理。
龚德伟	本基金基金经理, 固定收益投资研究部大类资产配置策略副总监	2021 年 8 月 12 日	-	5	北京大学金融学硕士。现任鹏扬基金管理有限公司固定收益投资研究部大类资产配置策略副总监。2021 年 8 月 12 日至今任鹏扬富利增强债券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

2023 年 2 季度，全球经济动能延续较强的韧性，增长预期持续上修，前期硅谷银行风波引发的信贷条件收紧的担忧伴随着 4、5 月份经济数据持续超预期而缓释。与此同时，美国核心通胀下行仍

然缓慢，劳动力市场依旧紧俏，市场重新修正美国政策利率预期，6 月议息会议点阵图指向年内仍有两次的加息空间。

2023 年 2 季度，国内总量政策主动收缩、产业政策保持积极，经济动能有所放缓。国内经济经过 1 季度脉冲式修复后，内需方面消费、投资均回归正常节奏，而外需压力重新显现。居民消费以及购房需求仍有修复空间，但修复的斜率与幅度受到居民资产负债表与政策的约束，企业商务活动及政府投资仍将保持高位。通货膨胀方面，2 季度国内 CPI 同比整体延续回落，服务价格在劳动供给充足的情况下保持温和，商品价格回落，PPI 环比较弱，同比大概率处于底部区间。随着居民收入改善以及资产负债表修复，核心 CPI 有望低位回升，但在外需压力仍然较大的背景下，耐用品需求走弱将对冲服务类价格上行。流动性方面，4 月资金面较为均衡，中枢在政策利率附近。进入 5 月，信贷投放以及经济内生动能偏弱，资金面较为充裕，利率中枢回落到政策利率以下。6 月中旬人民银行提前下调政策利率，MLF 持续超量续作。信用扩张方面，社融同比增速走弱，有去年同期基数效应的原因，也有 1 季度超量投放之后，信贷投放节奏强调稳定和可持续的原因。企业端整体融资依然偏强，企业债券类融资部分被贷款融资替代。居民端，短期融资企稳回升，中长期贷款在地产销售走弱以及提前还款的背景下保持弱势。政府端融资较 1 季度有所放缓，但整体仍然不弱。不过，当前资金活化程度仍较低，随着经济进一步回暖以及库存去化，后续大概率会出现改善。

2023 年 2 季度，中债综合全价指数上涨 0.94%，收益率曲线趋于陡峭。在经济内生动能偏弱、融资趋于平稳可持续以及资金面宽裕的背景下，利率中枢总体下行。信用利差方面，2 季度信用利差走势分化，2 年以上中高等级产业债利差小幅走扩，2 年内信用债受到热捧，低等级城投债利差持续压缩。2 季度，转债市场呈震荡走势，截至本报告期末，中证转债指数下跌 0.15%，同期正股下跌 2.48%，估值再度提升。

债券操作方面，本基金本报告期内根据经济环境变化与大类资产性价比对债券资产进行灵活调整，组合久期基本保持不变。信用策略方面，以套息策略为主，保持中性杠杆水平，卖出了房地产与能源行业个券，买入了性价比更高的个券，组合持仓以短久期高等级信用债为主。可转债策略方面，转债仓位降至中性水平，以双低策略为核心思路挑选基本面中期可改善的个券，逢高止盈了部分半导体行业转债，减持了券商、银行与医药行业转债，逢低增持了消费、汽车、交运、养殖行业转债，当前转债持仓以券商、公用事业、消费、半导体行业为主，个券风险收益比合适。

2023 年 2 季度，海外股市持续走强。纳斯达克指数上涨了 11.20%，标普 500 指数上涨了 6.99%，道琼斯工业指数上涨了 2.55%。在人工智能热潮的催化下，大型科技股表现良好，并且伴随着增长预期的重修，美股上涨行情逐渐扩散。2 季度，国内股市整体呈现震荡回调，但进入 6 月，政策预期逐渐升温，指数迎来反弹。从风格来看，2 季度代表大盘价值风格的上证 50 指数下跌了 6.38%，

代表成长风格的创业板指数下跌了 7.69%、科创 50 指数下跌了 7.06%。从行业板块来看，2 季度表现较好的主要是受益于人工智能的通信、传媒等板块，以及公用事业、家电板块。

股票操作方面，本基金本报告期内行业与个股选择在生意模式、资本周期、估值三个层面保持平衡，注重确定性与安全边际。2 季度股票仓位降至中高水平，灵活调整持仓结构。具体而言，消费股方面，逢高止盈了冷冻食品行业个股，继续持有短期景气度不佳但生意模式优秀、估值合理的高端白酒股。医药股方面，继续持有受益于手术需求回暖的优质标的，降低了医药其他细分领域的仓位。金融股方面，逢高止盈了受益于中特估驱动的国有大行个股，继续持有优质股份制银行个股。周期股方面，逢高止盈了部分受中特估值驱动的建筑股，继续持有估值低、竞争格局稳定、需求底部复苏的家电与重卡行业龙头股。高端制造方面，卖出了医疗器械股，逢高减持了部分消费电子与电力设备龙头股，继续持有估值与成长匹配的细分行业隐形冠军股。TMT 方面，止盈了部分涨幅较大的计算机与通信行业个股，继续持有估值合理、短期景气弱、长期受益 AI 趋势的半导体个股。公用事业方面，继续持有生意模式稳定、估值合理的燃气行业个股，增持了关注度较低的电力股。目前，组合持仓结构以食品饮料、家电、公用事业、医药、计算机行业为主。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬富利增强 A 的基金份额净值为 1.0557 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.25%；截至本报告期末鹏扬富利增强 C 的基金份额净值为 1.0423 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.34%；同期业绩比较基准收益率为 0.45%。

#### 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	8,995,771.38	12.28
	其中：股票	8,995,771.38	12.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	62,378,100.99	85.16
	其中：债券	62,378,100.99	85.16
	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	1,871,170.75	2.55
8	其他资产	4,775.73	0.01
9	合计	73,249,818.85	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	385,422.00	0.64
C	制造业	5,139,692.08	8.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	560,446.00	0.94
E	建筑业	223,286.00	0.37
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	305,531.00	0.51
H	住宿和餐饮业	53,060.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	815,679.30	1.36
J	金融业	843,651.00	1.41
K	房地产业	310,114.00	0.52
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	239,850.00	0.40
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	119,040.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	8,995,771.38	15.05

### 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	8,200	483,144.00	0.81

2	000001	平安银行	43,000	482,890.00	0.81
3	002507	涪陵榨菜	20,800	380,848.00	0.64
4	600519	贵州茅台	200	338,200.00	0.57
5	001979	招商蛇口	23,800	310,114.00	0.52
6	600079	人福医药	11,300	304,422.00	0.51
7	600116	三峡水利	27,100	246,068.00	0.41
8	600941	中国移动	2,600	242,580.00	0.41
9	300012	华测检测	12,300	239,850.00	0.40
10	603799	华友钴业	5,200	238,732.00	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	3,876,549.70	6.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,080,311.48	8.50
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	21,340,869.32	35.69
5	企业短期融资券	4,005,696.17	6.70
6	中期票据	23,768,808.10	39.76
7	可转债（可交换债）	4,305,866.22	7.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	62,378,100.99	104.33

#### 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	101900791	19 大同煤矿 MTN003	50,000	5,201,163.93	8.70
2	149209	20 金街 03	50,000	5,128,301.37	8.58
3	149453	21 天投 Y2	50,000	5,099,396.44	8.53
4	1928013	19 民生银行永续债	50,000	5,080,311.48	8.50
5	102281283	22 鄂交投 MTN001B	50,000	5,076,663.93	8.49

#### 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)					-8,413.48
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-

### 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，中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国民生银行股份有限公司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。北京首都旅游集团有限责任公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会或其派出机构的处罚。

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。

### 5.10.2 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	4,675.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	99.92
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,775.73

#### 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	113052	兴业转债	652,997.90	1.09
2	110073	国投转债	596,070.44	1.00
3	113044	大秦转债	437,806.26	0.73
4	123107	温氏转债	357,948.68	0.60
5	110079	杭银转债	334,693.13	0.56
6	127012	招路转债	240,983.15	0.40
7	127046	百润转债	239,657.67	0.40
8	113658	密卫转债	212,242.84	0.35
9	113655	欧 22 转债	208,458.82	0.35
10	110082	宏发转债	181,599.34	0.30
11	113061	拓普转债	147,176.49	0.25
12	111010	立昂转债	143,463.16	0.24
13	113623	凤 21 转债	132,390.31	0.22
14	110047	山鹰转债	122,086.60	0.20
15	113053	隆 22 转债	118,942.25	0.20
16	123122	富瀚转债	118,480.55	0.20
17	110067	华安转债	53,809.17	0.09
18	123145	药石转债	7,059.46	0.01

#### 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	鹏扬富利增强 A	鹏扬富利增强 C
报告期期初基金份额总额	28,835,491.79	32,055,164.57
报告期期间基金总申购份额	55,369.63	148,810.25

减：报告期期间基金总赎回份额	3,729,577.14	326,655.68
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	25,161,284.28	31,877,319.14

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

单位：份

	鹏扬富利增强 A	鹏扬富利增强 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	6,161,696.95	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-204,615.81	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,957,081.14	-
报告期期末持有的本基金份额占基金 总份额比例 (%)	10.44	-

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	赎回	2023 年 4 月 25 日	-204,615.81	-215,746.91	0.00%
合计			-204,615.81	-215,746.91	

## § 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日	20,000,789.04	-	-	20,000,789.04	35.07%

#### 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富利增强债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬富利增强债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬富利增强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

2023 年 7 月 19 日