

# 鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：2021 年 10 月 27 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 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏扬聚利六个月债券
基金主代码	008501
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 1 月 20 日
报告期末基金份额总额	1,550,803,590.44 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、适度的杠杆投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略以及港股通标的股票投资策略等。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*90%+沪深 300 指数收益率*5%+恒生指数收益率*5%
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。本基金可能投资于港股通标的股票，需承担汇率风险及境外市场的风险。
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	鹏扬聚利六个月债券 A	鹏扬聚利六个月债券 C
下属分级基金的交易代码	008501	008502
报告期末下属分级基金的份额总额	653,765,906.26 份	897,037,684.18 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 (2021 年 7 月 1 日 — 2021 年 9 月 30 日)	
	鹏扬聚利六个月债券 A	鹏扬聚利六个月债券 C
1. 本期已实现收益	1,918,049.88	1,339,134.07
2. 本期利润	-4,125,470.92	-6,668,060.19
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0053	-0.0061
4. 期末基金资产净值	716,616,433.93	976,630,587.95
5. 期末基金份额净值	1.0961	1.0887

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

###### 鹏扬聚利六个月债券 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	-0.62%	0.19%	0.38%	0.13%	-1.00%	0.06%
过去六个月	0.76%	0.17%	1.77%	0.11%	-1.01%	0.06%
过去一年	5.99%	0.28%	5.34%	0.12%	0.65%	0.16%
自基金合同 生效起至今	9.61%	0.27%	6.26%	0.13%	3.35%	0.14%

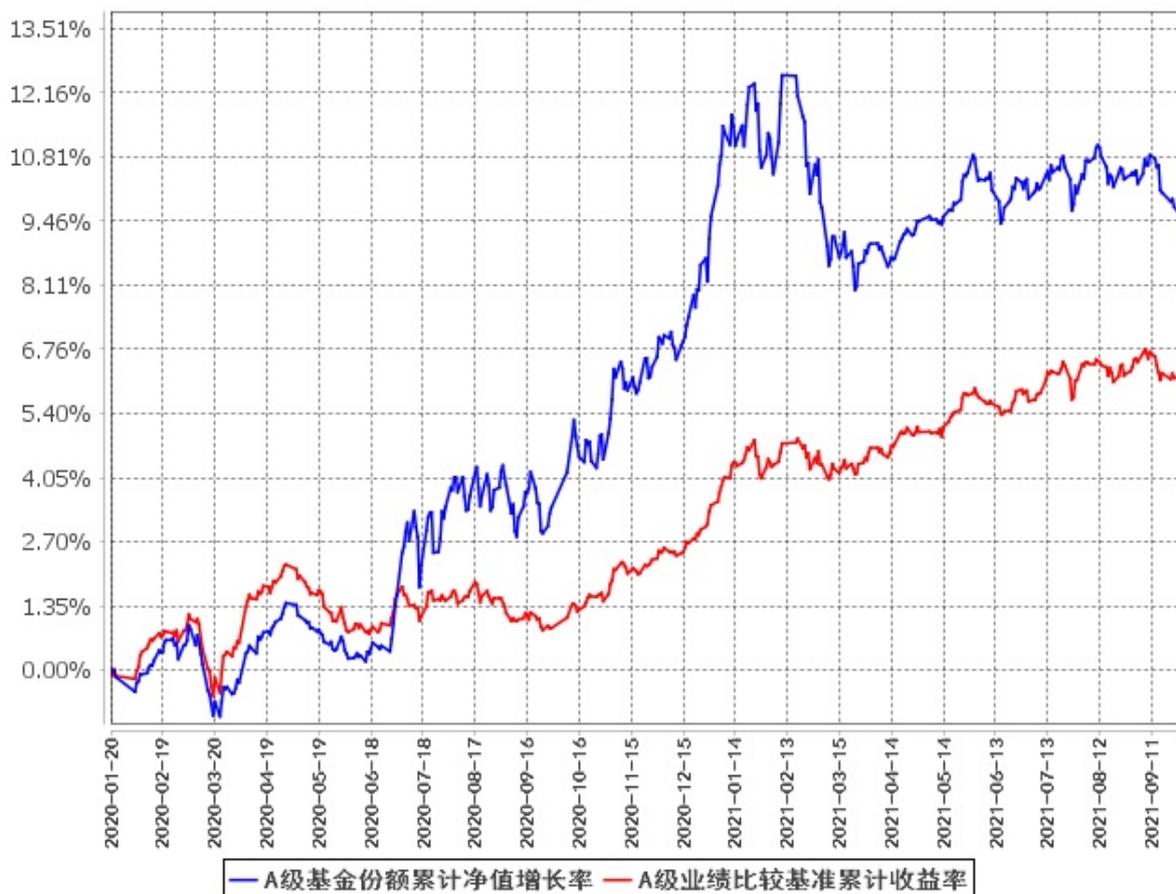
###### 鹏扬聚利六个月债券 C

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	-0.71%	0.19%	0.38%	0.13%	-1.09%	0.06%
过去六个月	0.56%	0.17%	1.77%	0.11%	-1.21%	0.06%

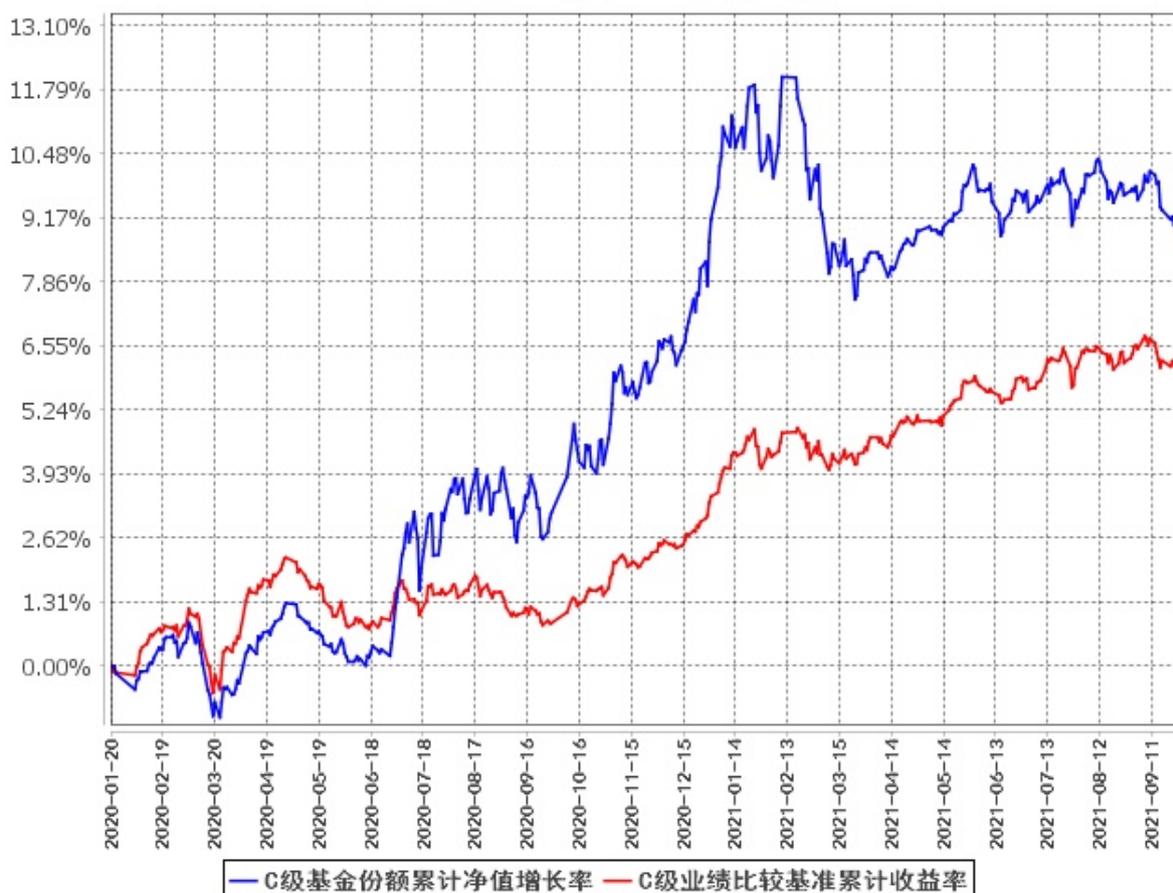
过去一年	5.57%	0.28%	5.34%	0.12%	0.23%	0.16%
自基金合同生效起至今	8.87%	0.27%	6.26%	0.13%	2.61%	0.14%

### 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1月20日至2021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  
(2020年1月20日至2021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	2021年7月1日	-	21	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资

				<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 日至今任鹏扬景津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 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 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>
李刚	本基金基金经理, 副总经理	2020 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 1 日	<p>19</p> <p>中国社科院经济学博士，曾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。2017 年 10 月 16 日至 2021 年 7 月 9 日任鹏扬基金管理有限公司副总经理。2019 年 1 月 4 日至 2020 年 3 月 20 日任鹏扬利泽债券型证券投资基金基金经理；2020 年 1 月 20 日至 2021 年 7</p>

				<p>月 1 日任鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金基金经理;2020 年 3 月 16 日至 2021 年 7 月 1 日任鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金基金经理;2020 年 4 月 21 日至 2021 年 7 月 8 日任鹏扬景恒六个月持有期混合型证券投资基金基金经理;2020 年 6 月 24 日至 2021 年 7 月 8 日任鹏扬景惠六个月持有期混合型证券投资基金基金经理;2020 年 11 月 4 日至 2021 年 7 月 8 日任鹏扬景合六个月持有期混合型证券投资基金基金经理;2021 年 1 月 12 日至 2021 年 7 月 8 日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 3 月 9 日至 2021 年 7 月 8 日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 3 月 23 日至 2021 年 7 月 8 日任鹏扬景安一年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p>
李沁	本基金基金经理, 混合投资部副总经理	2020 年 1 月 20 日	-	<p>8</p> <p>北京大学西方经济学硕士, 曾任中债资信评估有限公司信用分析师; 北京鹏扬投资管理有限公司信用分析师。现任鹏扬基金管理有限公司混合投资部副总经理。2019 年 8 月 29 日至今任鹏扬淳盈 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理; 2019 年 9 月 12 日至今任鹏扬双利债券型证券投资基金基金经理; 2020 年 1 月 20 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</p>

					<p>经理;2020 年 2 月 19 日至今任鹏扬景瑞三年定期开放混合型证券投资基金基金经理;2020 年 4 月 21 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;2020 年 6 月 24 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;2020 年 11 月 4 日至今任鹏扬景合六个月持有期混合型证券投资基金基金经理;2021 年 3 月 23 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。</p>
张望	本基金基金经理, 股票投资部研究总监	2020 年 3 月 20 日	-	11	<p>清华大学生物系理学硕士, 曾任华夏基金管理有限公司化工行业研究员、研究部周期组组长; 海宁拾贝投资管理合伙企业(有限合伙)周期组组长、基金经理。现任鹏扬基金管理有限公司股票投资部研究总监。2020 年 3 月 20 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;2020 年 7 月 2 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;2020 年 9 月 7 日至今任鹏扬景泓回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2020 年 11 月 27 日至今任鹏扬景创混合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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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 5%的情况。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年 3 季度，全球疫情再度恶化，欧美、亚太地区经济增速有所放缓，全球经济复苏动力减弱。受芯片短缺、海运费大涨等不利因素影响，全球制造业 PMI 指标连续 3 个月触顶回落。美国经济增长高位放缓，受疫情反复、财政补贴退坡和消费品大幅涨价等因素影响，美国消费者信心指数大幅回落。中国经济受局部疫情反复、房地产市场降温、汛期洪灾频发、“教育双减”和“能耗双控”等行业政策的影响，国民经济供需两侧均出现放缓，多数经济指标同比回落，经济下行压力增大。通货膨胀方面，CPI 同比保持低位，主要是猪价大幅下降和房租恢复较弱制约了核心 CPI 和服务价格上涨；PPI 同比大幅上升并保持高位，但受城镇居民可支配收入增速回落和边际消费倾向不足的影响，PPI 向 CPI 传导并不顺畅，PPI 和 CPI 背离不断加大，且背离持续高位时间拉长。流动性方面，央行通过全面降准和灵活适度的公开市场操作，总体保持中性偏宽松局面。信用扩张方面，受实体经济走弱、非标延续收缩、政府债去年基数高等因素共同拖累，社会融资总量增速继续回落，8 月增速已经低于疫情前 2019 年下半年的均衡水平，与历史最低水平持平，对总需求扩张带来不利影响。

2021 年 3 季度，债券市场先扬后抑，利率水平先降后升，中债综合全价指数上涨 0.83%。7 月初受央行超预期降准叠加市场风险偏好大幅下降等多重因素影响，10 年期国债利率水平下行约 27BP；

8-9 月利率水平保持在 2.85%左右横向波动，主要受经济基本面不断走弱和政策面转向预期以及专项债供给提速的多重因素影响。由于央行并未使用降息或降低公开市场利率等价格工具，收益率曲线整体呈现小幅牛市变平格局，更多反映经济基本面的下行趋势。信用利差方面，受经济下行压力和部分房地产公司信用风险事件冲击，信用利差整体走阔，高等级和中低等级信用债券等级利差也明显扩大。此外，受银行理财产品监管影响，银行永续债和二级资本债的利率水平和利差水平在政策出台后明显回升。

操作方面，本基金本报告期内债券适度做多。具体而言，本季度初由于降准超预期，本基金在利率方面没有进行追涨操作，逐步减持了部分产业投资类国有企业债券，9 月分批少量参与了商业银行永续债交易。转债方面，组合整体仓位较低，报告期内对部分偏债类金融转债进行了调仓。

2021 年 3 季度，全球股票市场总体冲高回落，震荡偏弱。国内股票市场 A 股受多重利空冲击出现回调。从风格来看，中小盘风格跑赢大盘风格。代表大盘价值风格的上证 50 指数下跌 8.62%，沪深 300 指数下跌 6.85%；代表中小盘成长风格的创业板指数和中小板指数分别下跌 6.69%和 4.98%。从行业板块来看，市场继续演绎比较极致的结构化行情。受益于价格大幅上涨的煤炭、钢铁、石油化工、有色金属等周期性行业和受政策支持的高景气新能源行业大幅上涨；而景气程度下降或盈利增长难以与估值水平匹配且前期基金抱团持股较多的医药生物、食品饮料、休闲服务行业出现大幅回调，银行业、家电和建材等地产产业链也受房地产行业各种利空影响明显下跌。

操作方面，本基金本报告期内提升了权益的持仓比例，截止季度末股票仓位在 15%左右。在配置上相对均衡，配置风格上大小盘风格的股票也相对平均，更多以自下而上的方法去寻找优质公司。组合在 7、8 月份主要配置了高端制造业公司，辅以消费股，主要包括光伏、新能源汽车；另外在经济下行的情况下，配置了部分工程机械公司。在 9 月份逐步减持消费股、家电企业以及周期企业，开始积极配置汽车产业链标的，包括整车和零部件。此外在物业管理、互联网等受到政策、事件影响的行业，做了底部布局。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬聚利六个月债券 A 的基金份额净值为 1.0961 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.62%；截至本报告期末鹏扬聚利六个月债券 C 的基金份额净值为 1.0887 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.71%；同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

#### 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	265,355,172.97	12.67
	其中：股票	265,355,172.97	12.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,753,318,989.20	83.72
	其中：债券	1,753,318,989.20	83.72
	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	53,105,143.15	2.54
8	其他资产	22,579,513.92	1.08
9	合计	2,094,358,819.24	100.00

注：本基金报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 15,837,353.64 元，占期末基金资产净值的比例为 0.94%。

### 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	156,696,048.16	9.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
J	金融业	85,490,955.17	5.05
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	2,169,760.00	0.13
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	5,161,056.00	0.30
S	综合	-	-
	合计	249,517,819.33	14.74

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	7,842,376.85	0.46
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	7,994,976.79	0.47
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	15,837,353.64	0.94

注：以上行业分类采用全球行业分类标准(GICS)。

### 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	601288	农业银行	7,081,400	20,819,316.00	1.23
2	000001	平安银行	927,959	16,638,304.87	0.98
3	002460	赣锋锂业	101,200	16,489,528.00	0.97
4	601939	建设银行	2,186,600	13,054,002.00	0.77
5	601658	邮储银行	2,527,300	12,838,684.00	0.76
6	600000	浦发银行	1,302,900	11,726,100.00	0.69
7	300750	宁德时代	22,200	11,671,206.00	0.69
8	002475	立讯精密	306,438	10,942,900.98	0.65
9	600031	三一重工	420,200	10,689,888.00	0.63
10	601166	兴业银行	569,101	10,414,548.30	0.62

#### 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	25,252,500.00	1.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	291,500,000.00	17.22
	其中：政策性金融债	170,171,000.00	10.05
4	企业债券	542,121,000.00	32.02
5	企业短期融资券	340,860,000.00	20.13
6	中期票据	505,772,000.00	29.87
7	可转债（可交换债）	47,813,489.20	2.82
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,753,318,989.20	103.55

#### 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	012101700	21 北京国资 SCP002	1,000,000	100,230,000.00	5.92
2	163862	21 国君 S2	1,000,000	100,080,000.00	5.91
3	102101117	21 光大控股 MTN001	800,000	81,120,000.00	4.79
4	190407	19 农发 07	800,000	80,408,000.00	4.75
5	163863	21 海通 S1	800,000	80,080,000.00	4.73

#### 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

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

## 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，中国进出口银行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。海通证券股份有限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	254,252.58
2	应收证券清算款	1,803,709.51
3	应收股利	24,320.00
4	应收利息	20,331,229.79
5	应收申购款	166,002.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,579,513.92

### 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	132015	18 中油 EB	25,154,400.00	1.49
2	110059	浦发转债	12,053,560.00	0.71
3	113011	光大转债	5,374,664.00	0.32
4	127005	长证转债	3,138,000.00	0.19

### 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	鹏扬聚利六个月债券 A	鹏扬聚利六个月债券 C
报告期期初基金份额总额	919,268,134.69	1,325,046,563.89
报告期期间基金总申购份额	24,233,716.07	5,223,661.27
减：报告期期间基金总赎回份额	289,735,944.50	433,232,540.98
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	653,765,906.26	897,037,684.18

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

	鹏扬聚利六个月债券 A	鹏扬聚利六个月债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,804,953.56	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,804,953.56	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.37	-

### 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聚利六个月持有期债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬聚利六个月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

2021 年 10 月 27 日