

鹏扬利鑫 60 天滚动持有期债券型证券投资基金（E 份额）

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024 年 5 月 30 日

送出日期：2024 年 6 月 25 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	鹏扬利鑫 60 天滚动持有债券	基金代码	014097
下属基金简称	鹏扬利鑫 60 天滚动持有债券 E	下属基金代码	016047
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
基金合同生效日	2022-01-24	上市交易所及上市日期	不适用
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	契约型开放式	开放频率	每个开放日申购，每份基金份额设定 60 天滚动运作期
基金经理	陈钟闻	开始担任本基金基金经理的日期	2022-01-24
		证券从业日期	2012-11-01
	黄乐婷	开始担任本基金基金经理的日期	2023-03-15
		证券从业日期	2019-03-01

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

阅读本公司《鹏扬利鑫 60 天滚动持有期债券型证券投资基金招募说明书》第九部分了解详细情况。

投资目标	在严格控制投资风险的前提下，力争长期实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、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、政府支持债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、国债期货、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、资产支持证券、债券回购、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
主要投资策略	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、板块轮换策略、骑乘策略、信用债投资策略、可转债/可交换债投资策略、融资回购策略、衍生品

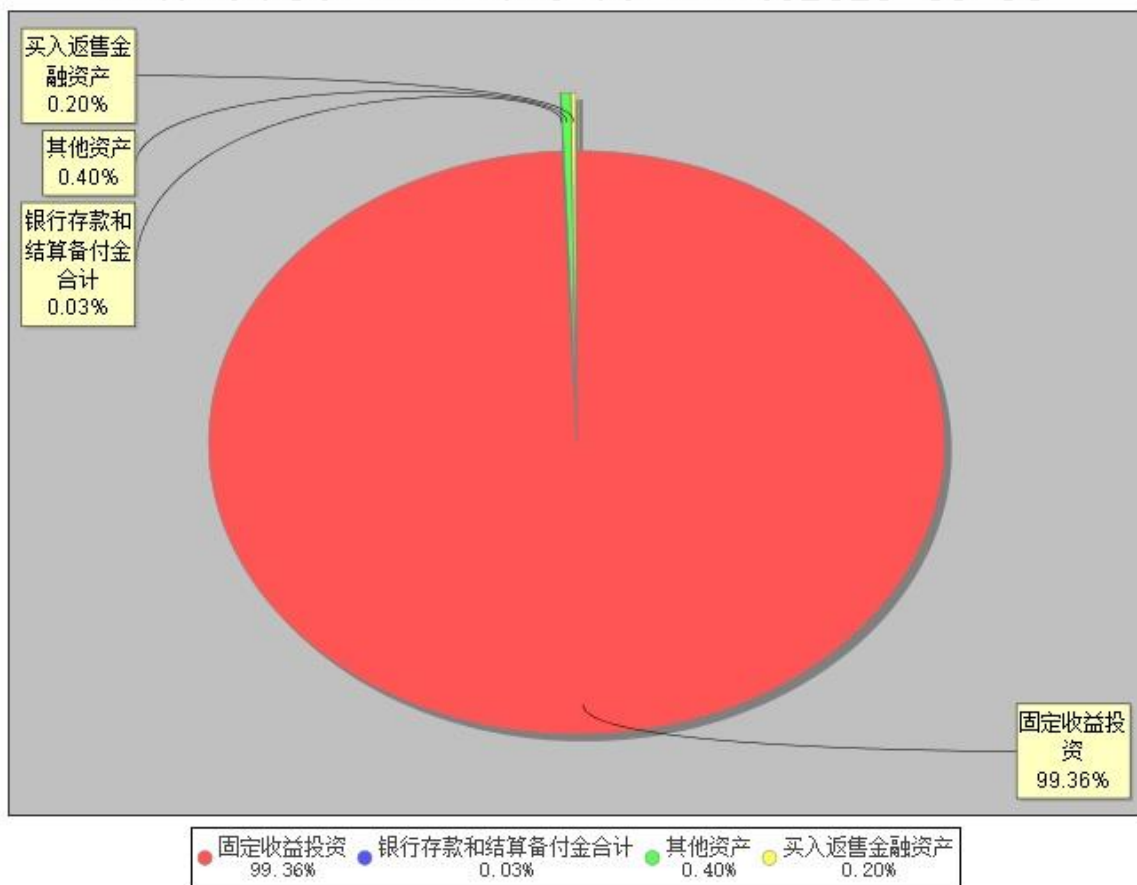
投资策略、资产支持证券投资策略、信用衍生品投资策略。

业绩比较基准 中债总财富(1-3年)指数收益率

风险收益特征 本基金属于债券型基金, 风险与收益高于货币市场基金, 低于混合型基金与股票型基金。

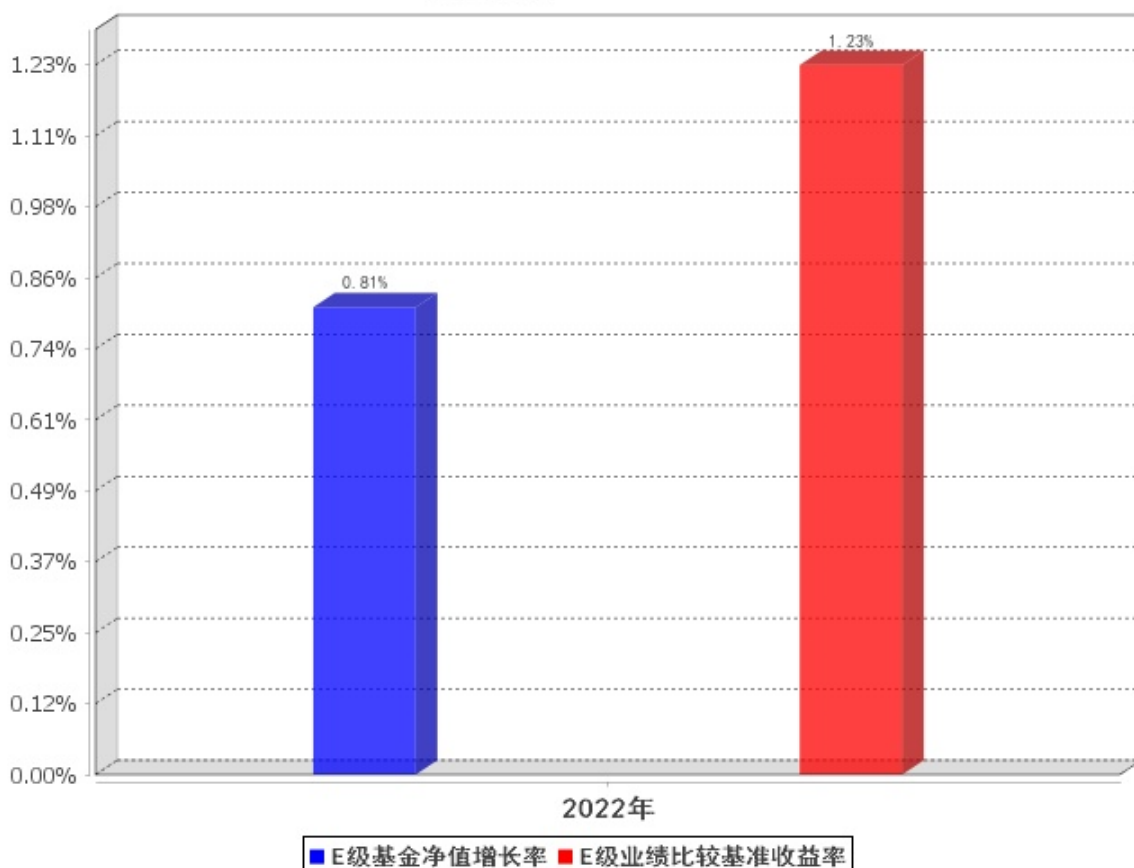
(二) 投资组合资产配置图表

报告期末资产组合情况-截止日期:2023-09-30



(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

E级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图
截止日期：2022-12-31



注：（1）本基金基金合同生效日为 2022 年 1 月 24 日。

（2）合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

（3）业绩表现截止日期 2022 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

（4）本基金自 2022 年 6 月 23 日起增设 E 类份额，本基金 E 类份额增设日至 2022 年 6 月 30 日期间无份额。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

注：本基金 E 类基金份额不收取申购费及赎回费。

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.25%	基金管理人、销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
销售服务费	0.20%	销售机构
审计费用	110,000	会计师事务所
信息披露费	120,000	规定披露报刊

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

3、基金合同生效后与本基金相关的律师费、诉讼费、仲裁费、基金份额持有人大会费用等可以在基金财产中列支的其他费用按照国家有关规定和基金合同约定在基金财产中列支。费用类别详见本基金基金合同及招募说明书或其更新。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

鹏扬利鑫 60 天滚动持有债券 E

基金运作综合费率（年化）

0.52%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金的风险主要包括：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、本基金特有的风险、基金管理人职责终止风险及其他风险等。

本基金特有的风险：本基金为债券型基金，投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，因投资固定收益类资产而面临固定收益类资产市场的系统性风险和个券风险。本基金采用滚动持有运作方式，对于每份基金份额，设定 60 天滚动运作期。每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。每个运作期到期日，基金份额持有人方可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未提出赎回申请（投资人在基金份额运作期到期日当日业务办理时间结束之后提出赎回或者转换转出申请的，视为无效申请），则自该运作期到期日次一日起基金份额进入下一个运作期。故投资者需承担在运作期间到期日前无法赎回的风险，以及错过当期运作期到期日未能赎回而进入下一运作期的风险。本基金可投资国债期货，国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。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、提前偿付风险、操作风险和法律风险等风险，由此可能增加本基金净值的波动性。本基金为对冲信用风险可投资于信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。流动性风险是指信用衍生品在交易转让过程中，因无法找到交易对手或交易对手较少，导致难以将其以合理价格变现的风险；偿付风险是在信用衍生品的存续期内，由于不可控制的市场及环境变化，创设机构可能出现经营情况不佳或创设机构的现金流与预期出现一定的偏差，从而影响信用衍生品结算的风险；价格波动风险是由于创设机构或所受保护债券主体的经营情况或利率环境出现变化，导致信用评级机构调整对创设机构或所保护债券的信用级别，引起信用衍生品交易价格波动的风险。

（二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册或核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资者作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要发生重大信息变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

与本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的

一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，具体内容详见《基金合同》。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 www.pyamc.com 或拨打客服电话 400-968-6688

- 1、基金合同、托管协议、招募说明书
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料

六、 其他情况说明

无