

鹏扬富利增强债券型证券投资基金

2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 1 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 2024 年 1 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 10 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 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	51,519,135.27 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	17,007,745.77 份	34,511,389.50 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10月1日—2023年12月31日)	
	鹏扬富利增强 A	鹏扬富利增强 C
1. 本期已实现收益	-148,388.61	-236,773.40
2. 本期利润	-98,089.84	-138,861.64
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0047	-0.0042
4. 期末基金资产净值	17,806,260.75	35,600,006.19
5. 期末基金份额净值	1.0470	1.0315

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	-0.33%	0.16%	-0.85%	0.20%	0.52%	-0.04%
过去六个月	-0.82%	0.15%	-0.98%	0.18%	0.16%	-0.03%
过去一年	0.75%	0.17%	1.56%	0.19%	-0.81%	-0.02%
过去三年	-1.72%	0.20%	6.05%	0.26%	-7.77%	-0.06%
自基金合同生效起至今	4.70%	0.22%	10.60%	0.27%	-5.90%	-0.05%

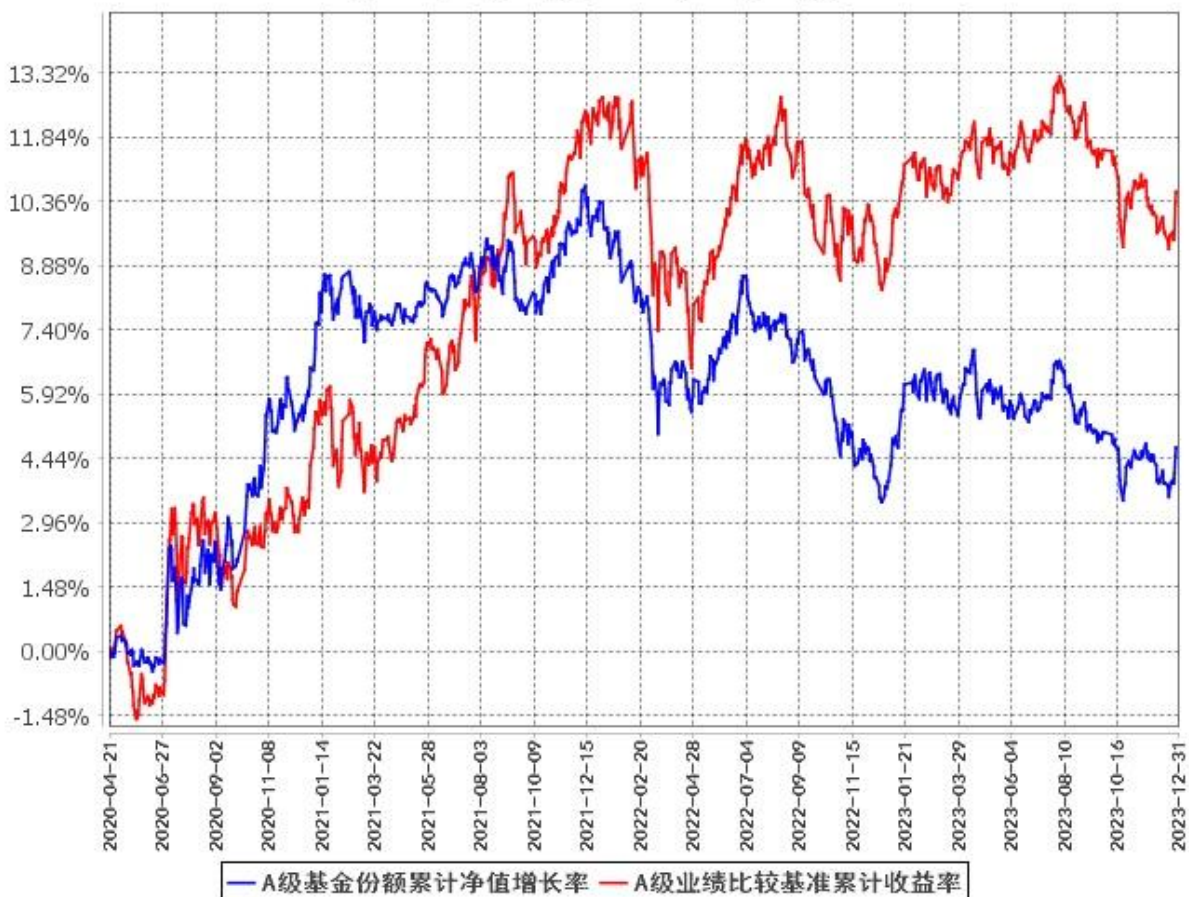
鹏扬富利增强 C

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	-0.44%	0.16%	-0.85%	0.20%	0.41%	-0.04%
过去六个月	-1.04%	0.15%	-0.98%	0.18%	-0.06%	-0.03%
过去一年	0.34%	0.17%	1.56%	0.19%	-1.22%	-0.02%

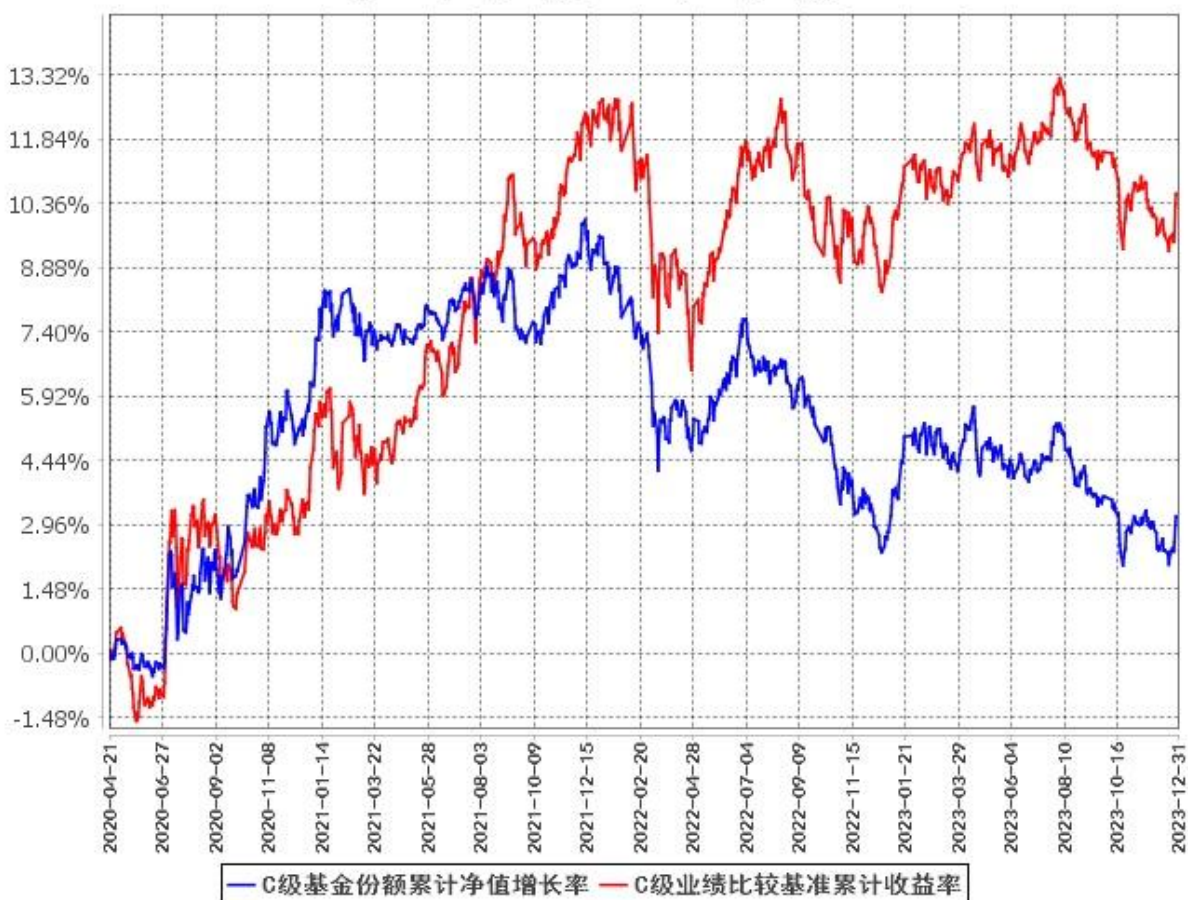
过去三年	-2.90%	0.20%	6.05%	0.26%	-8.95%	-0.06%
自基金合同生效起至今	3.15%	0.22%	10.60%	0.27%	-7.45%	-0.05%

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12月31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12月31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, 总经理助理	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。2018年2月13日至今任鹏扬双利债券型证券投资

				<p>资基金基金经理；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, 混合投资部大类资产配置策略总监	2021 年 8 月 12 日	-	6	北京大学金融学硕士。现任鹏扬基金管理有限公司混合投资部大类资产配置策略总监。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遵规守信情况的说明

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 4 季度，全球经济动能延续较强的韧性。随着海外通胀数据的逐步缓和，全球对宏观风险的定价延续回落趋势。美国经济“软着陆”的预期进一步强化，中长端美债利率冲高后回落，带

来整体金融市场条件的持续放松。与此同时，美国的就业市场和通胀数据进一步正常化，促使美联储货币政策态度边际转为鸽派，市场对于 2024 年预防式降息的预期逐步提高。

2023 年 4 季度，国内财政政策加力，围绕着“一揽子化债”以及“房地产市场供求关系发生重大变化”出台了系列政策，总体而言居民与企业信心温和修复。内需方面，消费在 3 季度冲高之后，跟随自身季节性出现小幅回落；基建继续发挥经济稳定器的作用；制造业投资在重大项目推动下保持韧性；房地产市场向新发展模式稳步迈进。外需方面，海外需求阶段性触底、价格拖累缓解叠加去年低基数，出口同比增速回升。通货膨胀方面，4 季度国内 CPI 同比整体回落、PPI 同比降幅震荡收窄，服务价格在出行旺季结束后明显走弱，上游资源品价格在原油价格回落、国内政策加码的预期影响下整体震荡，下游商品价格稳中有降，总体而言目前通胀压力极小。在供给能力较强的情况下，核心 CPI 短期难出现明显反弹。随着居民就业稳定、消费能力增加，核心 CPI 有望低位震荡上行，结构上商品与服务通胀后续会更均衡，但总体中枢依然会保持较低水平。流动性方面，10 月、11 月在稳外汇和政府债券发行的影响下，资金面偏紧，资金利率波动加大，进入 12 月汇率压力缓解叠加财政资金投放，资金面边际放松。信用扩张方面，政府融资支撑社融同比增速企稳回升。企业端，整体融资不弱，在政策推动下，中长期贷款持续投放。居民端，与消费相关的短期贷款平稳，中长期贷款跟随地产销售保持低位。当前资金活化程度较低，随着库存去化以及宏观政策调控效果逐步显现，后续可能会出现改善。

2023 年 4 季度，中债综合全价指数上涨 0.82%，债券收益率总体从震荡转向回落。10-11 月份，受稳汇率诉求的影响，资金面偏紧，利率曲线震荡。12 月份，受降息预期、资金面转松的影响，利率曲线整体下移。信用利差方面，4 季度信用利差走势分化。1 年内信用债利差小幅上行，1 年内 AA 及以上城投和产业利差上行 6-8BP，1 年内 AA-城投利差继续下行近 50BP。中高等级中长期信用利差普遍收窄 0-30BP，AA-城投利差收窄 10-114BP。4 季度，转债市场震荡下跌，10 月底出现短暂的超跌反弹，11 月中旬以后跟随股市继续走弱。截至本季度末，中证转债指数下跌 3.22%，同期正股下跌 0.07%，尽管债券市场上涨支撑了转债底价，但转债估值有所压缩。

债券操作方面，本基金本报告期内根据增长模式、经济周期与大类资产比较对债券资产进行灵活调整，4 季度大幅提升组合久期，把握了利率向基本面回归的确定机会。信用策略方面，以套息策略为主，保持中性杠杆水平，减仓了房地产行业个券，增仓了城投债，买入了部分煤炭债，组合持仓以短久期高等级信用债为主。可转债策略方面，转债仓位提升至较高水平，主要是在 12 月份买入了较多偏债型银行转债并获得了较好收益，同时对部分平衡型转债个券进行了置换，减仓了券商、化工行业个券，增仓了航空和机械行业个券，逢高止盈了煤炭和生猪行业个券。当前持仓以银行、公用事业、机械行业为主，个券风险收益比合适。

2023 年 4 季度，海外股市明显走强，纳斯达克指数上涨 13.56%，标普 500 指数上涨 11.24%，道琼斯工业指数上涨 12.48%。10 月美债利率一度上冲至 5.00%，随后快速回落，带动美股市场强劲反弹。A 股市场整体表现弱于海外市场。从风格来看，4 季度整体较为均衡，代表大盘价值风格的上证 50 指数下跌 7.22%，代表成长风格的创业板指数下跌 5.62%。从行业板块来看，表现较好的主要是煤炭、公用事业以及电子板块。

股票操作方面，本基金本报告期内行业与个股选择在商业模式、资本周期、估值三个层面保持平衡，注重确定性与安全边际。4 季度股票仓位保持中高水平，灵活调整持仓结构。具体而言，消费股方面，增仓了短期景气度不佳但商业模式优秀、估值合理的高端白酒股，减仓了部分必需消费品股票，继续持有低估值乳制品龙头。医药股方面，买入了中药行业有吸引力的个股，继续持有生意易懂、需求波动相对小、估值在低位的优质标的。金融股方面，组合用券商龙头股置换了银行股。周期股方面，组合趁能源股和铜矿股回调提高了仓位，逢低买入了建材行业股票，继续持有估值低、竞争格局稳定、出海优势大的家电与重卡行业龙头，逢高止盈了部分黄金行业个股。高端制造方面，继续持有客户黏性强、股息率高的防爆行业龙头，减仓了继电器行业个股。TMT 方面，继续持有电力信创和面板行业股票，减仓了部分安防行业个股。公用事业方面，继续持有商业模式稳定、估值合理的水电、火电和燃气行业个股。目前，组合持仓结构以食品饮料、上游资源、公用事业、医药行业为主。

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 1.0470 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.33%；截至本报告期末鹏扬富利增强 C 的基金份额净值为 1.0315 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.44%；同期业绩比较基准收益率为 -0.85%。

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	9,233,628.01	13.10
	其中：股票	9,233,628.01	13.10
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	58,957,563.52	83.67
	其中：债券	58,957,563.52	83.67
	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	1,811,838.81	2.57
8	其他资产	463,883.24	0.66
9	合计	70,466,913.58	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	813,509.00	1.52
C	制造业	5,702,425.64	10.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	652,790.80	1.22
E	建筑业	165,464.00	0.31
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	163,900.00	0.31
H	住宿和餐饮业	140,580.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	655,386.57	1.23
J	金融业	712,758.00	1.33
K	房地产业	226,814.00	0.42
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,233,628.01	17.29

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	600030	中信证券	20,000	407,400.00	0.76
2	000333	美的集团	6,600	360,558.00	0.68
3	600519	贵州茅台	200	345,200.00	0.65
4	600938	中国海油	16,100	337,617.00	0.63
5	000338	潍柴动力	22,300	304,395.00	0.57
6	002063	远光软件	44,280	273,650.40	0.51
7	600989	宝丰能源	18,200	268,814.00	0.50
8	600941	中国移动	2,700	268,596.00	0.50
9	603855	华荣股份	13,400	267,464.00	0.50
10	600887	伊利股份	9,700	259,475.00	0.49

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	3,574,461.81	6.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	19,755,136.52	36.99
5	企业短期融资券	3,012,154.43	5.64
6	中期票据	22,737,353.45	42.57
7	可转债（可交换债）	9,878,457.31	18.50
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	58,957,563.52	110.39

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	102280833	22 黄冈城投 MTN002	50,000	5,133,048.09	9.61
2	102282249	22 重庆物流 MTN002A	50,000	5,132,125.68	9.61
3	148387	23 鞍钢 KY04	50,000	5,112,802.74	9.57
4	184156	21 桂交 03	50,000	5,032,805.48	9.42
5	137996	22 青信 04	42,000	4,225,441.64	7.91

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
T2403	T2403	2	2,057,000.00	18,114.29	-
TF2403	TF2403	4	4,101,800.00	25,000.00	-
公允价值变动总额合计(元)					43,114.29
国债期货投资本期收益(元)					33,320.44
国债期货投资本期公允价值变动(元)					42,114.29

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，青岛国信发展(集团)有限责任公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局青岛市分局的处罚。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	96,481.58
2	应收证券清算款	367,401.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	463,883.24

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	113042	上银转债	1,864,180.85	3.49
2	110059	浦发转债	1,598,838.47	2.99
3	113056	重银转债	1,441,392.72	2.70
4	113052	兴业转债	1,336,052.67	2.50
5	113044	大秦转债	630,514.09	1.18
6	127012	招路转债	429,342.82	0.80
7	110079	杭银转债	315,029.19	0.59
8	110073	国投转债	306,606.44	0.57
9	127064	杭氧转债	248,718.32	0.47
10	110082	宏发转债	235,299.00	0.44
11	113061	拓普转债	140,293.81	0.26
12	113623	凤 21 转债	136,430.65	0.26
13	111010	立昂转债	122,569.99	0.23
14	110047	山鹰转债	118,551.16	0.22
15	110075	南航转债	111,606.29	0.21
16	118033	华特转债	106,869.47	0.20
17	113655	欧 22 转债	106,336.12	0.20
18	110091	合力转债	106,217.13	0.20
19	128142	新乳转债	102,653.67	0.19
20	113664	大元转债	79,307.61	0.15
21	127032	苏行转债	60,428.49	0.11

22	110088	淮 22 转债	53,133.97	0.10
23	123145	药石转债	6,584.98	0.01
24	123107	温氏转债	6,328.97	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	24,098,865.26	31,801,092.58
报告期期间基金总申购份额	30,665.48	2,916,290.10
减：报告期期间基金总赎回份额	7,121,784.97	205,993.18
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	17,007,745.77	34,511,389.50

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	5,957,081.14	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-5,908,419.50	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	48,661.64	-
报告期期末持有的本基金份额 占基金总份额比例 (%)	0.09	-

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	转换出	2023 年 11 月 24 日	-3,000,000.00	-3,138,000.00	0.00%
2	转换出	2023 年 11 月 27 日	-2,908,419.50	-3,037,844.17	0.00%
合计			-5,908,419.50	-6,175,844.17	

§ 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 10 月 1 日 -2023 年 12 月 31 日	20,000,789.04	-	-	20,000,789.04	38.82%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

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

2024 年 1 月 19 日