

鹏扬现金通利货币市场基金 2019 年第 4 季度报告

2019 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 1 月 20 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 1 月 15 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 2019 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏扬通利货币	
交易代码	004983	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2017 年 8 月 10 日	
报告期末基金份额总额	3,076,290,835.22 份	
投资目标	本基金在力求保持基金资产安全性与高流动性的基础上，追求稳定的当期收益。	
投资策略	本基金投资策略包括流动性管理策略、平均剩余期限和组合期限结构策略、资产配置策略、个券选择策略、适度的融资杠杆策略、资产支持证券投资策略等。在结合现金需求安排和货币市场利率预测，在保证基金资产安全性和流动性的基础上，获取稳定的收益。	
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，在所有证券投资基金中，是风险相对较低的基金产品。在一般情况下，其风险与预期收益均低于债券型基金、混合型基金与股票型基金。	
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鹏扬通利货币 A	鹏扬通利货币 B
下属分级基金的交易代码	004983	004984
报告期末下属分级基金的份额总额	71,746,946.55 份	3,004,543,888.67 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（2019年10月1日—2019年12月31日）	
	鹏扬通利货币 A	鹏扬通利货币 B
1. 本期已实现收益	427,240.00	14,838,206.26
2. 本期利润	427,240.00	14,838,206.26
3. 期末基金资产净值	71,746,946.55	3,004,543,888.67

注：1、本期已实现收益指基金本期利息入、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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金收益分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏扬通利货币 A

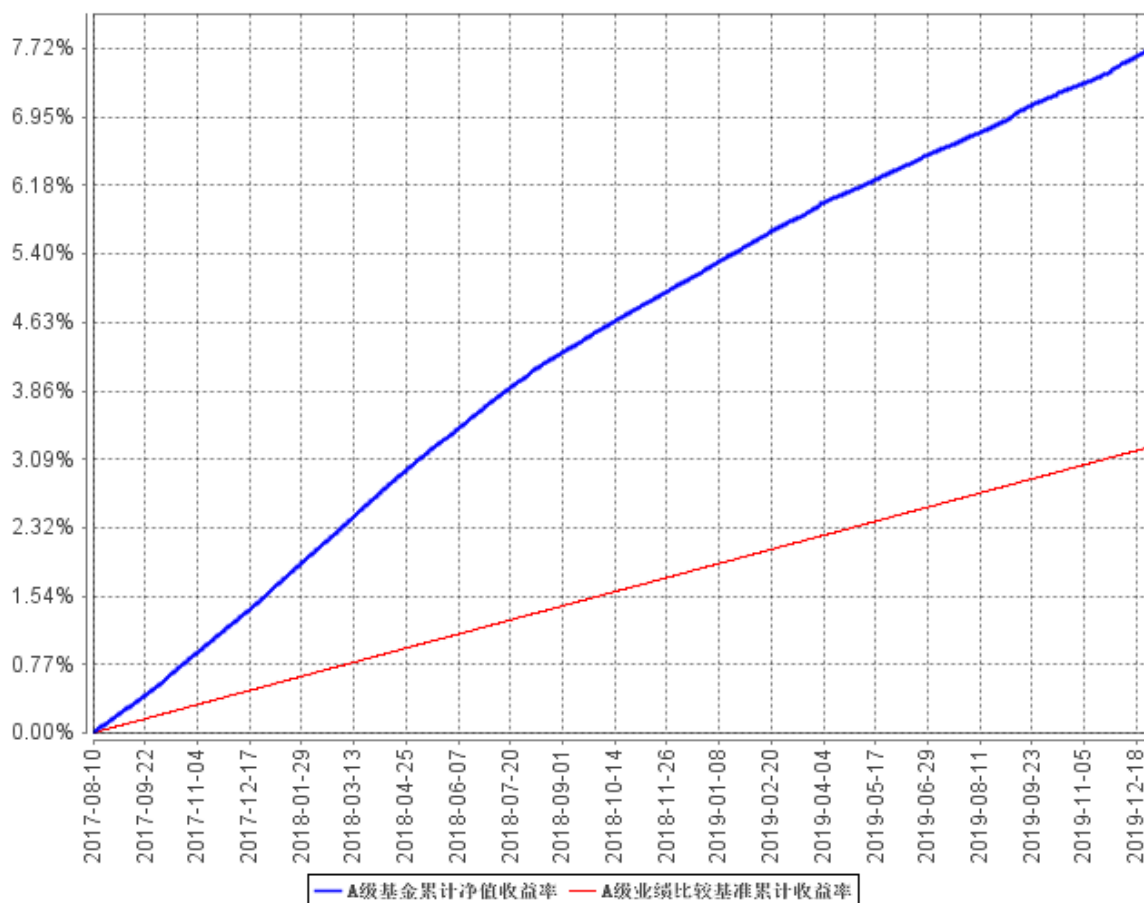
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.5609%	0.0032%	0.3403%	0.0000%	0.2206%	0.0032%

鹏扬通利货币 B

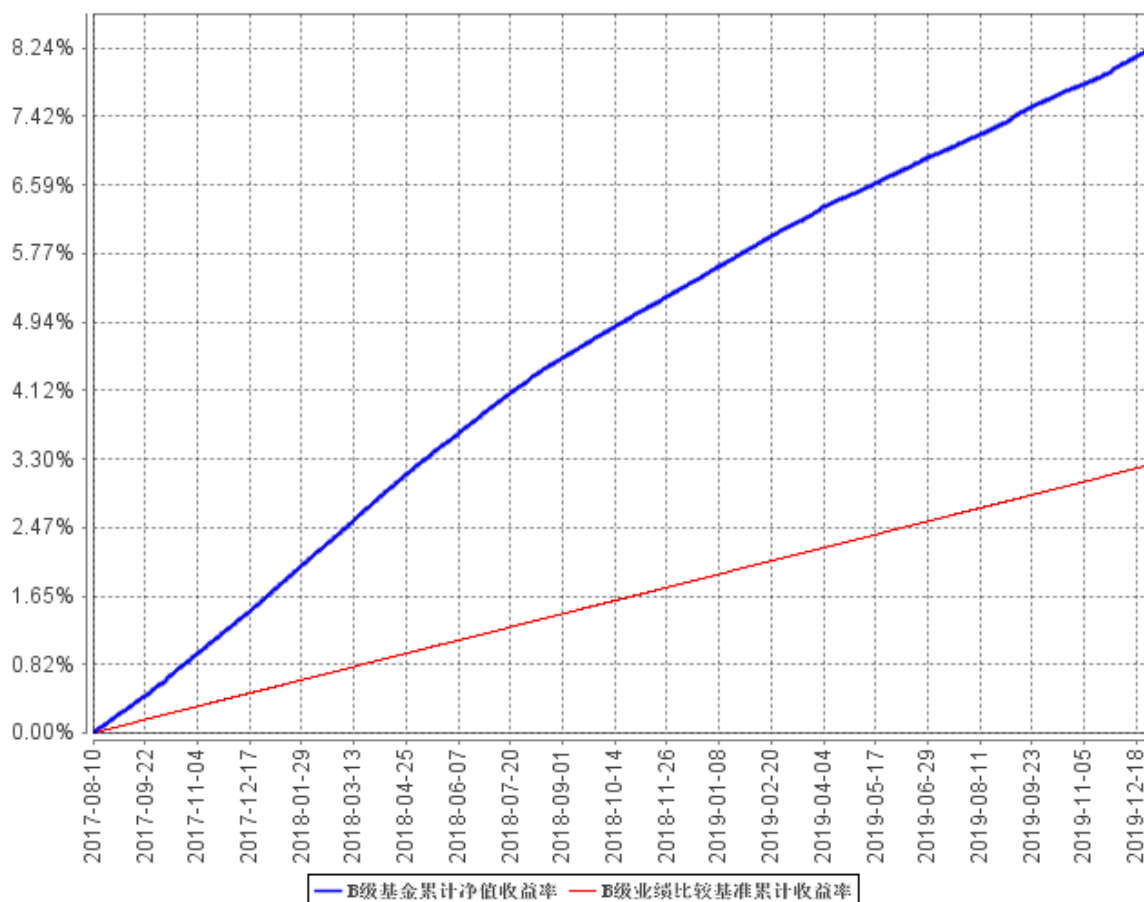
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.6119%	0.0032%	0.3403%	0.0000%	0.2716%	0.0032%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：(1) 上图基金净值表现及业绩比较基准截止日期为 2019 年 12 月 31 日。

(2) 本基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效。

(3) 按基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围，四、投资限制”的有关规定。

(4) 本报告期鹏扬通利货币 A 的基金份额净值收益率为 0.5609%，本报告期鹏扬通利货币 B 的基金份额净值收益率为 0.6119%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

§ 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		
陈钟闻	固定收益部执行总经理、现金策略总监，	2017年8月10日	-	7	北京理工大学工商管理硕士。曾任北京鹏扬投资管理有限公司固定收益部投资经理、交易主管，负责银行投资顾问与

	本基金基金经理				利率债投资研究、债券交易工作。现任鹏扬基金管理有限公司固定收益部执行总经理、现金策略总监、固定收益投资决策委员会委员。2017 年 8 月 10 日至今任鹏扬现金通利货币市场基金基金经理；2018 年 1 月 19 日至今任鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2018 年 2 月 5 日至今任鹏扬利泽债券型证券投资基金基金经理；2018 年 8 月 9 日至今任鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金基金经理；2019 年 6 月 21 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 9 日至今任鹏扬利沣短债债券型证券投资基金基金经理；
王莹莹	本基金基金经理	2018 年 8 月 24 日	-	4	北京交通大学经济学学士、英国埃克斯特大学硕士。曾任北京鹏扬投资管理有限公司交易管理部债券交易员。2016 年 8 月加入鹏扬基金管理有限公司，曾任交易管理部债券交易员、专户投资部投资组合经理。2018 年 8 月 24 日至今任鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金基金经理、鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、鹏扬现金通利货币市场基金基金经理，2019 年 11 月 13 日至今任鹏扬利沣短债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 11 月 18 日至今任鹏扬淳开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，本着诚实守信、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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年四季度全球经济出现了企稳回升迹象，全球通货膨胀仍保持低位。在中美有望达成第一阶段协议背景下，全球贸易企稳，最新公布的韩国 12 月前 20 日出口金额同比增速延续回升。从领先指标来看，全球制造业 PMI 在 8 月结束 15 个月的连续下滑，最近三个月小幅回升。OECD 经济领先指标来看，中国 10 月以来持续回升，美国 10 月首次回升，欧洲延续下滑。全球主要央行货币政策重新转为宽松，美联储连续 3 次降息，并在 10 月 11 日宣布开始买入短期美国国债进行重启所谓的“量化宽松”。德拉吉掌管下的欧央行进一步降息 10BP，并重启了每月 200 亿欧元的量化宽松。全球主要股票指数均大幅回升，市场风险偏好明显上升，避险资产黄金和国债震荡回落。

经济增长数据来看，三季度实际 GDP 同比增速 6.0%（前值 6.2%），名义 GDP 同比增速 7.6%（前值 8.3%），GDP 平减指数 1.6%（前值 2.1%），经济面临一定下行压力。进入四季度，受出口回升和房地产投资保持韧性支持下，叠加中央加大逆周期调节政策支持，经济增长出现弱复苏信号。2019 年 12 月中采 PMI 指标环比持平 50.2，连续两月位于 50 以上，高于市场预期，生产、新出口订单、原材料价格均较上月回升。鹏扬基金经济领先指标模型 CLI 指标在 11 月、12 月连续两月环比回升，而历史上 2012 年 11 月、2016 年 5 月均出现类似信号。通货膨胀方面，受猪肉价格大涨影响，

消费品价格指数 CPI 大幅走高到 11 月 4.5%，但核心 CPI 持续回落仅 1.4%，11 月工业品价格指数 PPI 同比-1.4%，环比-0.1%，工业品继续保持通货紧缩格局。流动性方面，受 CPI 大幅走高影响，央行流动性投放总体中性，进入 11 月，央行为缓解局部性社会信用紧缩压力，下调公开市场操作利率 5BP，加大流动性投放力度。

四季度债券市场先抑后扬，总体小幅走牛，收益率曲线呈牛陡格局。3 年以内中短端品种受央行降准预期和宽松流动性支持，短端下行 20BP 左右，5-7 年下行约 5-15BP，10 年以上长端下行幅度较小。信用利差方面，包商事件后部分问题银行风险处置方案逐步出台，城农商行与国有股行信用利差重新收窄，信用分层有所缓解。信用债券方面，AA+及以上的中高等级信用债券利差小幅扩大约 5-15 BP 左右，但 AA 及以下的中低等级信用债券，尤其是受益于地方政府隐形债务置换的 1-3 年期限的城投债券，信用利差收窄 5-15BP。

债券策略方面，本基金在全年始终保持在正偏离状态，全年日均正偏离 7bp，收益在 12 月维持市场中位数水平以上，整体规模相应比较稳定，在资产收益逐步下行前积极储备资产，并不断积累正偏离，积极调整组合资产结构，维持组合静态收益，加权期限维持在 50 天以内，控制流动性风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期鹏扬通利货币 A 的基金份额净值收益率为 0.5609%，本报告期鹏扬通利货币 B 的基金份额净值收益率为 0.6119%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

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	固定收益投资	2,214,560,423.89	71.95
	其中：债券	2,184,560,423.89	70.98
	资产支持证券	30,000,000.00	0.97
2	买入返售金融资产	847,580,551.37	27.54

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,107,957.88	0.07
4	其他资产	13,548,468.38	0.44
5	合计	3,077,797,401.52	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.91	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额 (元)	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例取报告期内每交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	47
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	52
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合的平均剩余期限未超过 120 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	45.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	12.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	34.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	4.23	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	2.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.61	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合的平均剩余存续期未超过 240 天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	280,124,042.92	9.11
	其中：政策性金融债	280,124,042.92	9.11
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,089,522,797.52	35.42
6	中期票据	-	-
7	同业存单	814,913,583.45	26.49
8	其他	-	-
9	合计	2,184,560,423.89	71.01
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190201	19 国开 01	2,500,000	249,996,994.78	8.13
2	111915619	19 民生银行 CD619	2,200,000	218,494,224.28	7.10
3	011902892	19 苏交通 SCP029	1,300,000	129,803,097.24	4.22
4	011901635	19 华电 SCP023	1,000,000	100,129,134.56	3.25
5	071900131	19 兴业证券 CP001	1,000,000	100,004,388.95	3.25
6	071900134	19 国信证券 CP009	1,000,000	100,000,598.83	3.25
7	071900163	19 华泰证券 CP007	1,000,000	99,998,460.20	3.25
8	011901982	19 邮政 SCP003	1,000,000	99,960,621.79	3.25
9	011902057	19 中电投 SCP025	1,000,000	99,924,807.67	3.25
10	011902269	19 浙交投 SCP001	1,000,000	99,845,203.81	3.25

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0

报告期内偏离度的最高值	0.0852%
报告期内偏离度的最低值	0.0277%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0540%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	165243	19 建花 11A	300,000.00	30,000,000.00	0.98

注：本基金本报告期末仅持有上述资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

5.9.2 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

19 民生银行 CD619(111915619. IB)为鹏扬现金通利货币市场基金的前十大持仓证券。2019 年 12 月 14 日北京银保监局针对民生银行存在以下主要违法违规事实，责令民生银行股份有限公司改正，并给予合计 700 万元罚款的行政处罚；对顾立辉给予警告并处 5 万元罚款的行政处罚。主要违法违规事实：1. 民生银行总行同业票据业务管理失控（该违规事实下具体违法行为已由属地监管部门处罚。）；2. 民生银行总行违反内控指引要求计量转贴现卖断业务信用风险加权资产；3. 民生银行总行案件风险信息报送管理不到位；4. 民生银行总行未有效管理承兑业务；5. 民生银行总行办理无真实贸易背景承兑业务；6. 民生银行总行承兑业务质押资金来源为本行贷款；7. 民生银行银川分行为已注销法人公司办理票据贴现业务；8. 民生银行杭州分行为票据中介办理票据贴现业务；9. 民生银行上海自贸区分行为票据中介办理票据贴现业务；10. 民生银行福州分行转贴现卖断业务担保情况数据严重失实；11. 民生银行苏州分行转贴现卖断业务担保情况数据严重失实；12. 民生银行郑州分行转贴现卖断业务担保情况数据严重失实。2019 年 4 月 2 日中国银行保险监督管理委员会大连监管局针对民生银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款 100 万元。主要违

违法违规事实：（一）贷后管理不到位，以贷收贷，掩盖资产真实质量；（二）贴现资金回流作银行承兑汇票保证金，滚动循环签发银行承兑汇票。2019 年 4 月 2 日中国银行保险监督管理委员会大连监管局针对民生银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款 100 万元。主要违法违规事实：（一）以贷收贷，掩盖资产真实质量；（二）以贷转存，虚增存贷款规模。2019 年 4 月 2 日中国银行保险监督管理委员会大连监管局针对民生银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款 50 万元。主要违法违规事实：（一）贷后管理不到位，银行承兑汇票保证金来源审查不严格，贷款回流作银行承兑汇票保证金。

19 华泰证券 CP007（071900163. IB）为鹏扬现金通利货币市场基金的前十大持仓证券。2019 年 8 月 23 日江苏证监局针对华泰证券股份有限公司存在在代销“聚潮资产-中科招商新三板 I 期 A、B 专项资管计划”过程中，存在使用未经报备的宣传推介材料的情形。该行为违反《证券公司代销金融产品管理规定》第十条的规定，反映出你公司内部控制不完善。根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，我局决定对你公司采取责令改正的监督管理措施。你公司应采取切实有效措施，完善内部控制，并于收到本决定之日起 30 日内向我局提交书面整改报告。

19 国信证券 CP009（071900134. IB）为鹏扬现金通利货币市场基金的前十大持仓证券。2019 年 12 月 17 日江苏证监局针对国信证券股份有限公司检查并发现存在以下问题：发行人的募集资金使用监督不到位，未及时发现其募集资金中有 2 亿元存在未按约定用途使用的情形，发行人在 2016 年 5 月 17 日至 2016 年 9 月 23 日期间将募集资金中 2 亿元转借他人；而你公司出具的 2016 年受托管理事务报告中，披露发行人不存在挪用募集资金，将募集资金转借他人等违规行为，未按照《受托管理协议》的约定履行职责。上述行为不符合《公司债券受托管理人执业行为准则》第十条、第十三条的规定，违反了《公司债券发行与交易管理办法》第七条、第五十二条的规定。现根据《公司债券发行与交易管理办法》第五十八条的规定，决定对你公司采取出具警示函的监管措施。

本基金投资 19 民生银行 CD619、19 华泰证券 CP007、19 国信证券 CP009 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 19 民生银行 CD619、19 华泰证券 CP007、19 国信证券 CP009 外，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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收利息	13,238,117.99
4	应收申购款	310,350.39
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	13,548,468.38

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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	鹏扬通利货币 A	鹏扬通利货币 B
报告期期初基金份额总额	105,039,506.11	3,498,917,024.07
报告期期间基金总申购份额	88,753,648.98	2,169,670,719.66
报告期期间基金总赎回份额	122,046,208.54	2,664,043,855.06
报告期期末基金份额总额	71,746,946.55	3,004,543,888.67

注：报告期期间基金总申购份额含转换入和分红份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 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	22-申购	2019年12月5日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
2	43-红利发放	2019年12月6日	2,132.90	0.00	0.00%
3	43-红利发放	2019年12月9日	1,610.12	0.00	0.00%
4	43-红利发放	2019年12月10日	534.38	0.00	0.00%
5	43-红利发放	2019年12月11日	577.50	0.00	0.00%
6	43-红利发放	2019年12月12日	567.99	0.00	0.00%
7	43-红利发放	2019年12月13日	1,248.70	0.00	0.00%
8	43-红利发放	2019年12月16日	1,740.22	0.00	0.00%
9	43-红利发放	2019年12月17日	1,101.47	0.00	0.00%
10	43-红利发放	2019年12月18日	1,102.31	0.00	0.00%
11	43-红利发放	2019年12月19日	1,028.00	0.00	0.00%
12	43-红利发放	2019年12月20日	583.05	0.00	0.00%
13	43-红利发放	2019年12月23日	1,792.98	0.00	0.00%
14	43-红利发放	2019年12月24日	583.35	0.00	0.00%
15	43-红利发放	2019年12月25日	968.22	0.00	0.00%
16	43-红利发放	2019年12月26日	1,191.00	0.00	0.00%
17	43-红利发放	2019年12月27日	649.90	0.00	0.00%
18	43-红利发放	2019年12月30日	1,872.67	0.00	0.00%
19	22-申购	2019年12月31日	60,000.00	60,000.00	0.00%
20	43-红利发放	2019年12月31日	644.47	0.00	0.00%

合计			10,079,929.23	10,060,000.00	
----	--	--	---------------	---------------	--

注：本报告期内基金管理人没有申购、红利发放业务。

§ 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	1	2019 年 10 月 16 日 -2019 年 12 月 18 日	513,506,971.76	3,139,275.21	0.00	516,646,246.97	16.79%
个人	-	-	-	-	-	-	-

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

注：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现金通利货币市场基金募集的文件；
2. 《鹏扬现金通利货币市场基金基金合同》；
3. 《鹏扬现金通利货币市场基金托管协议》；
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

2020 年 1 月 20 日