

鹏扬现金通利货币市场基金 2020 年第 3 季度报告

2020 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 28 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 10 月 26 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏扬通利货币		
基金主代码	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	1,275,666,831.36 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	鹏扬通利货币 E
下属分级基金的交易代码	004983	004984	010005
报告期末下属分级基金的份额总额	92,006,184.31 份	1,183,660,647.05 份	-

注：基金管理人决定自 2020 年 8 月 27 日起对鹏扬现金通利货币市场基金增设 E 类份额，鹏扬现金通利货币 E 增设至今无份额。

§ 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（2020年7月1日—2020年9月30日）		
	鹏扬通利货币 A	鹏扬通利货币 B	鹏扬通利货币 E
1. 本期已实现收益	362,199.03	6,357,092.23	-
2. 本期利润	362,199.03	6,357,092.23	-
3. 期末基金资产净值	92,006,184.31	1,183,660,647.05	-

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、本基金自 2020 年 8 月 27 日起增设 E 类份额，截至报告期末未满足一季度的，鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	0.4426%	0.0009%	0.3393%	0.0000%	0.1033%	0.0009%
过去六个月	0.8809%	0.0034%	0.6750%	0.0000%	0.2059%	0.0034%
过去一年	1.9782%	0.0033%	1.3509%	0.0000%	0.6273%	0.0033%
过去三年	8.6859%	0.0033%	4.0509%	0.0000%	4.6350%	0.0033%
自基金合同生效起至今	9.2414%	0.0033%	4.2433%	0.0000%	4.9981%	0.0033%

鹏扬通利货币 B

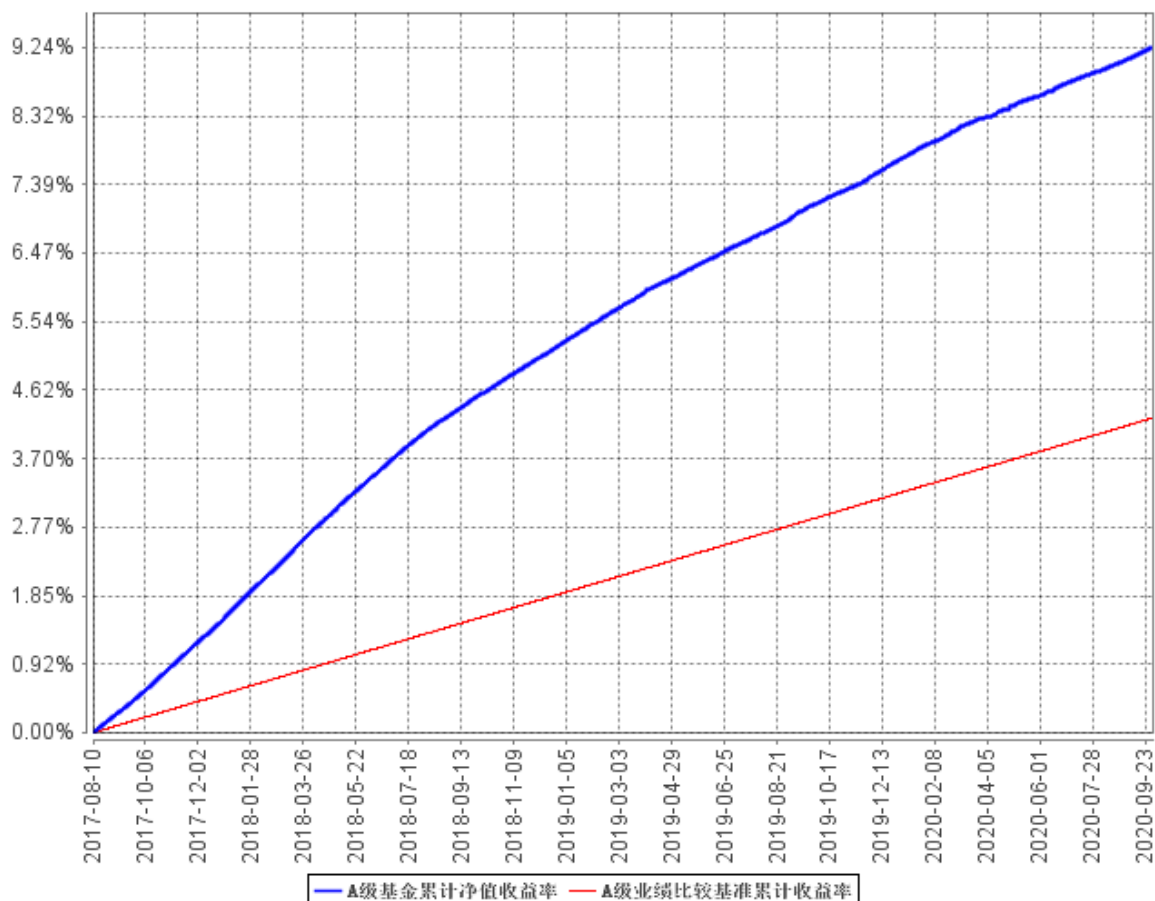
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4932%	0.0009%	0.3393%	0.0000%	0.1539%	0.0009%
过去六个月	0.9815%	0.0034%	0.6750%	0.0000%	0.3065%	0.0034%
过去一年	2.1826%	0.0033%	1.3509%	0.0000%	0.8317%	0.0033%
过去三年	9.3398%	0.0033%	4.0509%	0.0000%	5.2889%	0.0033%
自基金合同生效起至今	9.9294%	0.0033%	4.2433%	0.0000%	5.6861%	0.0033%

鹏扬通利货币 E

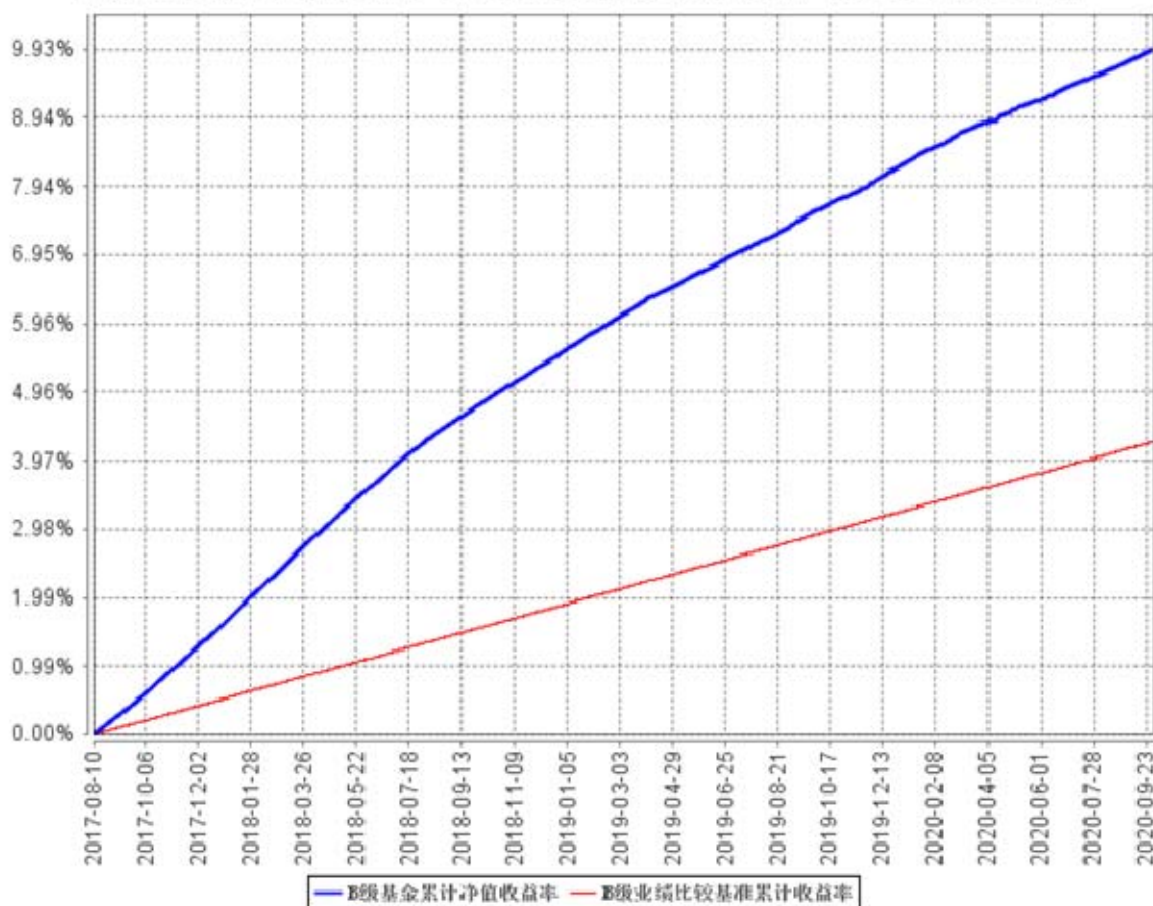
鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

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 2020 年 9 月 30 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 0.4426%，本报告期鹏扬通利货币 B 的基金份额净值收益率为 0.4932%，同期业绩比较基准收益率为 0.3393%。

（5）鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

§ 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		
王莹莹	本基金基	2018年8月	-	4	英国埃克斯特大学硕士。曾任

	金经理	24 日			京粮置业财务部资金专员、北京鹏扬投资管理有限公司交易管理部债券交易员。鹏扬基金管理有限公司交易管理部债券交易员、专户投资部投资组合经理。现任鹏扬基金管理有限公司现金管理部基金经理。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，2020 年 3 月 16 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。2020 年 4 月 14 日至今任鹏扬景科混合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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度以来，全球疫情防控有所缓解但仍未出现拐点，美国、巴西、印度等国家新增确诊病例继续维持高位，进入 9 月甚至出现二次反弹态势，全球经济仍面临疫情带来的负面冲击，预计主要发达经济体经济增长在三季度仍难以转正但领先经济指标出现复苏趋势。货币政策方面，全球主要央行在二季度采取了宽松货币政策，在三季度总体货币政策没有进一步宽松进入观察期。美联储推出“平均通货膨胀目标制”的新货币政策框架。财政政策方面，美国两党围绕新一轮的财政刺激计划展开激烈的政治博弈；欧盟达成 7500 亿欧元的复兴基金计划，这是欧元区从宽货币转向宽财政的重要标志。全球金融市场总体平稳，中美两国股票市场涨幅较好，美元指数大幅走弱导致黄金、铜等硬商品大幅上涨，大豆、玉米等软商品价格也出现大幅上涨行情。债券方面，除人民币债券下跌外，全球主要债券市场均呈现上涨态势。

二季度中国经济在宽松货币政策和积极财政政策支持下大幅回升到 3.2% 的水平，同时通货膨胀水平稳步下降到 2.4%。进入三季度，货币政策边际收紧，银行间隔夜和 7 天回购利率水平在逐步回升到央行公开市场操作利率水平之上。信贷和社会融资总量扩张方面在宽信贷和宽财政的政策支持下继续维持较高的增长速度。从最新公布的一系列经济指标来看，三季度中国经济在房地产投资、基建投资和超预期的出口数据的支持下回升到 4.9% 的水平。

三季度债券市场持续走弱，中债综合全价指数下跌 1.48%。收益率曲线呈现熊市变平格局。

1-5 年期限国债利率平均上升幅度约 50BP，7 年以上中长期国债利率上行幅度约 30-40BP。信用债券方面，1-3 年期限的 AAA 和 AA+信用债券利率上行幅度约 50BP，5 年期限利率上行幅度约 30BP。以国开债券为衡量标准，信用利差水平整体呈现压缩趋势。

操作方面，三季度货币市场收益率继续大幅波动，组合坚持防风险为首要原则，通过对市场的研判来调整配置节奏与资产配比，维持中低的久期，增加了无估值波动资产与高流动性资产的比例，在始终保持维持日均偏离度为正的情况下，收益在市场中位数以上。

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 0.4426%，本报告期鹏扬通利货币 B 的基金份额净值收益率为 0.4932%，同期业绩比较基准收益率为 0.3393%。鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

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	678,159,993.06	53.03
	其中：债券	678,159,993.06	53.03
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	371,756,637.63	29.07
	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	220,301,089.60	17.23
4	其他资产	8,715,007.60	0.68
5	合计	1,278,932,727.89	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	1.06	
	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

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	46
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	33

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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	41.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	21.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	26.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	5.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	3.87	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.57	-

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

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	70,418,161.21	5.52
	其中：政策性金融债	70,418,161.21	5.52
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	209,668,218.48	16.44
6	中期票据	-	-
7	同业存单	398,073,613.37	31.21
8	其他	-	-
9	合计	678,159,993.06	53.16
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	112020149	20 广发银行 CD149	1,000,000	99,562,182.72	7.80
2	112018302	20 华夏银行 CD302	1,000,000	99,529,581.05	7.80
3	140203	14 国开 03	500,000	50,435,010.53	3.95
4	012002588	20 浙能源 SCP010	500,000	49,956,956.53	3.92
5	012002925	20 陕延油 SCP010	500,000	49,926,780.97	3.91
6	112003055	20 农业银行 CD055	500,000	49,919,582.17	3.91
7	012002957	20 中石集 SCP006	500,000	49,910,223.96	3.91
8	012003074	20 北控集 SCP004	500,000	49,898,258.46	3.91
9	112003072	20 农业银行 CD072	500,000	49,883,335.77	3.91
10	112017189	20 光大银行 CD189	500,000	49,827,126.00	3.91

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	0.0372%
报告期内偏离度的最低值	-0.0026%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0118%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

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

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 报告期末按摊余成本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。

5.9 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

20 光大银行 CD189(112017189. IB)为鹏扬现金通利货币市场基金的前十大持仓证券。2020 年 4 月 20 日中国银行保险监督管理委员会针对光大银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款合计 160 万元。光大银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：(一)分户账明细记录应报未报；(二)关键且应报字段漏报或填报错误；(三)向检查组提供与事实不符的材料；(四)账户设置不能如实反映业务实际。2020 年 2 月 10 日中国人民银行针对光大银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款 1820 万元。主要违法违规事实如下：(一)未按规定履行客户身份识别义务；(二)未按规定保存客户身份资料和交易记录；(三)未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告；(四)与身份不明的客户进行交易。2019 年 12 月 27 日中国银行保险监督管理委员会针对光大银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款 180 万元。主要违法违规事实如下：(一)授信审批不审慎；(二)为还款来源不清晰的项目办理业务；(三)总行对分支机构管控不力承担管理责任。

20 广发银行 CD149(112020149. IB)为鹏扬现金通利货币市场基金的前十大持仓证券。2020 年 6 月 29 日中国银行保险监督管理委员会针对广发银行存在以下主要违法违规事实，没收违法所得 511.53 万元，罚款 8771.53 万元，罚没合计 9283.06 万元。主要违法违规事实如下：(一)向关系人发放信用贷款；(二)对个人贷款资金使用未做到有效跟踪监控，使消费性贷款用于支付购房首付款；(三)违规办理无真实贸易背景银行承兑汇票；(四)对银行承兑汇票贸易背景审查不规范；(五)信贷资金购买本行理财产品；(六)以贷款资金作为保证金发放贷款；(七)不良贷款转让不规范；(八)违规向房地产开发企业发放流动资金贷款；(九)违规向资本金不到位的房地产开发企业发放贷款；(十)资金以同业投资形式违规投向房地产领域；(十一)理财资金违规投向房地产企业；(十二)面向不合格个人投资者发行理财产品投资权益性资产；(十三)未按规定向

投资者披露理财产品投资非标准化债权资产情况；（十四）向地方政府违规融资，要求地方政府违规提供担保承诺；（十五）投资交易本行主承销债券超规定比例；（十六）信用卡透支用于非消费领域；（十七）案件信息报送不规范；（十八）未经任职资格核准履行高级管理人员职责；（十九）违规提前发放应延期支付的绩效薪酬；（二十）股东违规提名董事及监事；（二十一）股权质押管理不到位。2020 年 7 月 7 日中国银保监会广东监管局针对广发银行存在贷款分类、从业人员处罚信息报送、信用卡“财智金”业务贷后管理严重违反审慎经营规则的违法违规事实，处以罚款 220 万元。2019 年 12 月 17 日国家外汇管理局广东省分局针对广发银行存在办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理结汇；违反外汇账户管理规定情形，处以责令改正，给予警告，没收违法所得 370961.98 元人民币，并处 120 万元人民币罚款。

20 农业银行 CD072(112003072. IB)、20 农业银行 CD055(112003055. IB)为鹏扬现金通利货币市场基金的前十大持仓证券。2020 年 7 月 13 日中国银行保险监督管理委员会针对农业银行存在以下主要违法违规事实，处以没收违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元。主要违法违规事实如下：（一）向关系人发放信用贷款；（二）批量处置不良资产未公告；（三）批量处置不良资产未向监管部门报告；（四）违规转让正常类贷款；（五）个人住房贷款首付比例违规；（六）流动资金贷款被用于固定资产投资；（七）超过实际需求发放流动资金贷款；（八）贷后管理缺失导致企业套取扶贫贷款资金用于房地产开发；（九）贷款用于偿还银行承兑汇票垫款；（十）承兑业务贸易背景审查不严；（十一）保理业务授权管理不到位；（十二）贴现资金直接回流至银行承兑汇票出票人；（十三）贷款资金直接转存银行承兑汇票保证金；（十四）信贷资金用于兑付到期理财产品；（十五）信贷资金用于承接承销债券；（十六）销售非保本理财产品违规出具承诺函；（十七）提供与事实不符的报告；（十八）理财产品相互交易、相互调节收益；（十九）面向一般个人投资者销售的理财产品投向股权投资；（二十）将系统内资金纳入一般存款核算，虚增存款；（二十一）开立同业银行结算账户不合规；（二十二）个别人员未经核准即履行高管人员职责；（二十三）对小微企业不当收费；（二十四）未按规定报送案件。2020 年 4 月 22 日中国银行保险监督管理委员会针对农业银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款合计 200 万元。主要违法违规事实如下：（一）“两会一层”境外机构管理履职不到位；（二）国别风险管理不满足监管要求；（三）信贷资金被挪用作保证金；（四）未将集团成员纳入集团客户统一授信管理。2020 年 4 月 22 日中国银行保险监督管理委员会针对农业银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款合计 230 万元。农业银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：（一）资金交易信息漏报严重；（二）信贷资产转让业务漏报；（三）贸易融资业务漏报；（四）分户账明细记录

应报未报；（五）分户账账户数据应报未报；（六）关键且应报字段漏报或填报错误。2020 年 3 月 9 日中国银行保险监督管理委员会针对农业银行存在以下主要违法违规事实：（一）可回溯制度执行不到位、可回溯基础管理不到位、部分可回溯视频质检结果未反馈给保险公司、可回溯资料不符合监管规定等行为，处以罚款 50 万元。（二）虚假代理业务行为，处以罚款合计 150 万元。

20 华夏银行 CD302 (112018302. IB) 为鹏扬现金通利货币市场基金的前十大持仓证券。2020 年 7 月 13 日中国银行保险监督管理委员会针对华夏银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款合计 110 万元。主要违法违规事实如下：（一）内控制度执行不到位，严重违反审慎经营规则；（二）生产系统存在重大风险隐患，严重违反审慎经营规则；（三）账务管理工作存在重大错漏，长期未发现异常挂账情况，严重违反审慎经营规则；（四）长期未处置风险监控预警信息，严重违反审慎经营规则。

本基金投资 20 光大银行 CD189、20 广发银行 CD149、20 农业银行 CD072、20 农业银行 CD055、20 华夏银行 CD302 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 20 光大银行 CD189、20 广发银行 CD149、20 农业银行 CD072、20 农业银行 CD055、20 华夏银行 CD302 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	2,126.69
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,696,729.91
4	应收申购款	5,016,151.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	8,715,007.60

5.9.4 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	鹏扬通利货币 A	鹏扬通利货币 B	鹏扬通利货币 E
报告期期初基金份额总额	121,075,652.48	1,854,169,677.74	-
报告期期间基金总申购份额	98,523,566.47	1,423,974,835.54	-

报告期期间基金总赎回份额	127,593,034.64	2,094,483,866.23	-
报告期期末基金份额总额	92,006,184.31	1,183,660,647.05	-

注：1、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。

2、鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

§ 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	申购	2020年7月3日	20,000,000.00	20,000,000.00	0.00%
2	申购	2020年7月7日	30,000,000.00	30,000,000.00	0.00%
3	转换出	2020年7月8日	-10,001,000.00	-10,001,000.00	0.00%
4	转换出	2020年7月17日	-10,001,000.00	-10,001,000.00	0.00%
5	赎回	2020年7月30日	-15,000,000.00	-15,000,000.00	0.00%
6	申购	2020年8月17日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
7	转换出	2020年8月27日	-6,001,000.00	-6,001,000.00	0.00%
8	转换出	2020年8月27日	-6,001,000.00	-6,001,000.00	0.00%
9	转换出	2020年8月27日	-6,001,000.00	-6,001,000.00	0.00%
10	转换出	2020年8月27日	-6,001,000.00	-6,001,000.00	0.00%
11	转换出	2020年8月27日	-6,001,000.00	-6,001,000.00	0.00%
12	申购	2020年9月23日	15,000,000.00	15,000,000.00	0.00%
13	赎回	2020年9月29日	-8,000,000.00	-8,000,000.00	0.00%
14	红利再投	-	214,079.38	214,079.38	0.00%
合计			2,207,079.38	2,207,079.38	

注：本基金按日计算并分配收益，本报告期的收益分配列示在“红利再投”项下汇总披露。

§ 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 10 月 28 日