

鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	鹏扬淳优债券
基金主代码	005398
交易代码	005398
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2018 年 1 月 19 日
报告期末基金份额总额	1,444,844,515.43 份
投资目标	本基金在力求本金长期安全的基础上，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。
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、适度的融资杠杆策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。
业绩比较基准	中债总财富(总值)指数收益率
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	招商银行股份有限公司

§ 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）
1. 本期已实现收益	982,073.99
2. 本期利润	-165,708.71
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0001
4. 期末基金资产净值	1,486,191,162.99
5. 期末基金份额净值	1.0286

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。

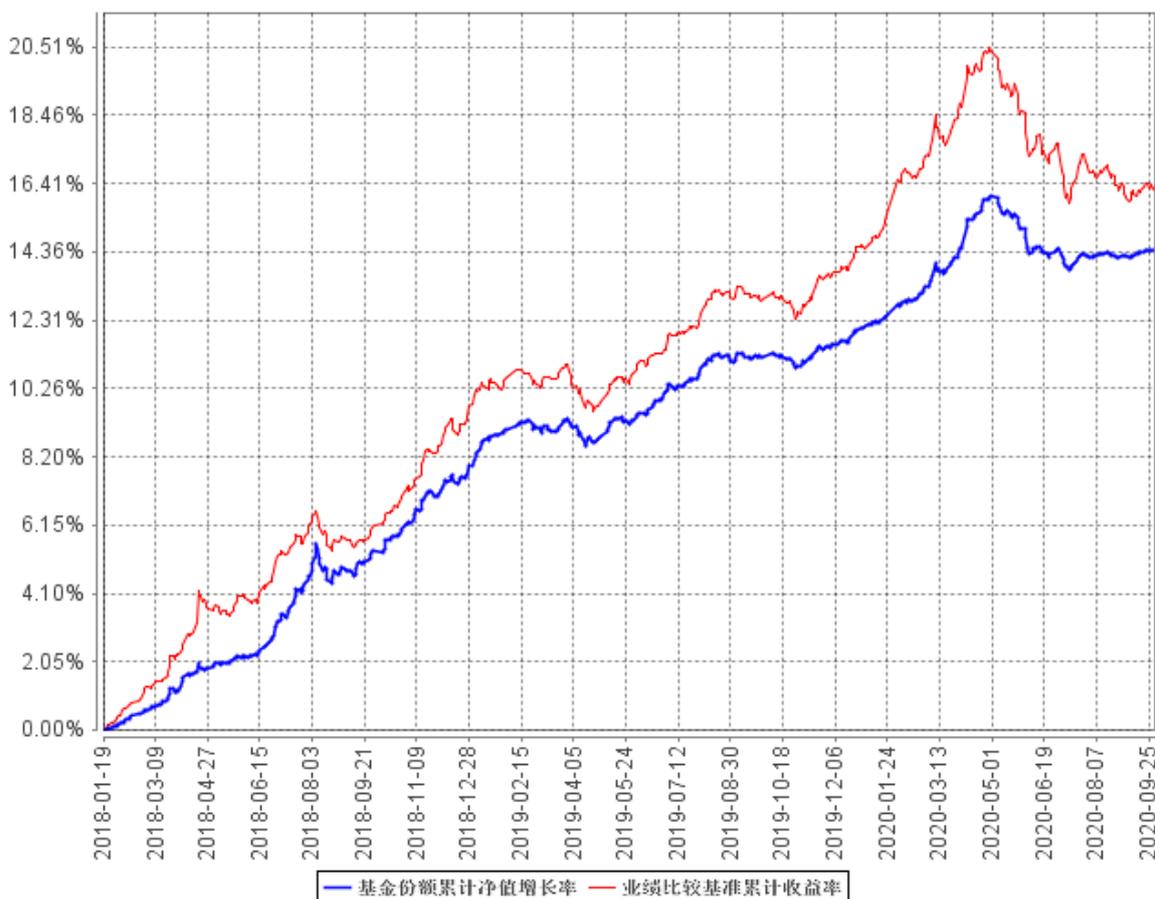
3.2 基金净值表现

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

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	-0.01%	0.04%	-1.19%	0.14%	1.18%	-0.10%
过去六个月	0.08%	0.08%	-2.00%	0.17%	2.08%	-0.09%
过去一年	2.89%	0.08%	2.89%	0.15%	0.00%	-0.07%
自基金合同 生效起至今	14.41%	0.07%	16.21%	0.12%	-1.80%	-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

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



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 2018 年 1 月 19 日生效。

（3）按基金合同规定，本基金建仓期为自基金合同生效之日起 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 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	现金管理部总经理，本基金基金经理	2018 年 1 月 19 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，鹏扬基金管理有限公司固

				<p>定收益部基金经理。现任鹏扬基金管理有限公司现金管理部总经理。2017 年 8 月 10 日至 2020 年 3 月 20 日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 日至今任鹏扬利泮短债债券型证券投资基金基金经理；2019 年 11 月 6 日至今任鹏扬淳开债券型证券投资基金基金经理；2019 年 12 月 17 日至今任鹏扬浦利中短债债券型证券投资基金基金经理；2020 年 7 月 21 日至今任鹏扬淳安 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。</p>	
王莹莹	本基金基金经理	2018 年 8 月 24 日	-	4	<p>英国埃克斯特大学硕士。曾任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。</p>

					<p>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 日至今任鹏扬利泮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。</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，三季度组合基本维持防守策略，久期维持在 1 年附近，保持低杠杆与无杠杆状态。随着货币市场利率逐步上行，借力资金波动，积极置换底仓，配置 1 年利率、存单及商业银行金融债，提升静态收益。至 9 月末，部分品种开始具备配置价值，久期小幅增加至 1.5 年，仍以哑铃型配置。三季度利率债供给压力较大，组合积极参与利率债一级市场投标，灵活波段，增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0286 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.01%，业绩比较基准收益率为-1.19%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,495,456,500.90	98.14
	其中：债券	1,495,456,500.90	98.14
	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	1,202,905.12	0.08
8	其他资产	27,216,786.93	1.79
9	合计	1,523,876,192.95	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

本基金本报告期末未持有股票。

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 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

本基金本报告期末未持有股票。

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	59,818,000.00	4.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,113,430,500.90	74.92
	其中：政策性金融债	568,797,500.90	38.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	50,622,000.00	3.41
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	271,586,000.00	18.27
9	其他	-	-
10	合计	1,495,456,500.90	100.62

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	200406	20 农发 06	3,000,000	298,410,000.00	20.08
2	190203	19 国开 03	1,900,000	189,392,000.00	12.74
3	1820009	18 宁波银行 01	1,000,000	101,470,000.00	6.83
4	1820038	18 南京银行 01	1,000,000	101,030,000.00	6.80
5	112011189	20 平安银行 CD189	1,000,000	97,010,000.00	6.53

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

16 交行绿色金融债 02(1628022. IB)为鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资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交通银行存在以下主要违法违规事实,处以罚款合计 260 万元。交通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)理财产品数量漏报;(二)资金交易信息漏报严重(三)贸易融资业务漏报;(四)信贷业务担保合同漏报;(五)分户账明细记录应报未报;(六)分户账账户数据应报未报;(七)关键且应报字段漏报或填报错误。2019 年 12 月 27 日中国银行保险监督管理委员会针对交通银行存在以下主要违法违规事实,处以罚款合计 150 万元。主要违法违规事实如下:(一)授信审批不审慎;(二)总行对分支机构管控不力承担管理责任。

20 中信银行 CD156(112008156. IB)为鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资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中信银行存在以下主要违法违规事实,处以罚款合计 160 万元。中信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)理财产品数量漏报;(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 2 月 20 日北京银保监局针对中信银行存在以下主要违法违规事实,责令中信银行股份有限公司改正,并给予合计 2020 万元罚款的行政处罚。主要违法违规事实如下:(一)中信银行股份有限公司违规发放土地储备贷款;(二)受托支付不符合监管规定;(三)信托消费贷款业务开展不审慎;(四)流动资金贷款被挪用于股权投资;(五)信贷资金被挪用流入房地产开发公司;(六)个人经营性贷款资金被挪用于购房;(七)非真实转让不良信贷资产;(八)未对融资人交易材料合理性进行必要的审查,资金被用于缴纳土地竞买保证金;(九)违规为房地产开发企业发放流动资金性质融资;(十)签署抽屉协议互投涉房信贷资产腾挪信贷规模;(十一)卖出回购信贷资产收益权,实现信贷规模阶段性出表;(十二)理财资金违规投向未上市房地产企业股权;(十三)理财资金被挪用于支付土地出让价款;(十四)违规向资本金不足的房地产开发项目提供融资;(十五)并购贷款真实性审核不足,借款人变相用于置换项目公司缴纳的土地出让价款;(十六)协助合作机构签署抽屉协议,规避相关监管规定;(十七)理财资金实际用于置换项目前期股东支付的土地出让金;(十八)违规为房地产企业支付土地购置费用提供融资;(十九)违规向四证不全的商业性房地产开发项目提供融资。

16 广发银行 01(1628004. IB)为鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资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。

18 南京银行 01 (1820038. IB) 为鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2019 年 12 月 31 日中国银行保险监督管理委员会江苏监管局针对南京银行存在以下主要违法违规事实，处以没收违法所得 137701 元，处以人民币 610 万元罚款。主要违法违规事实如下：1. 未将部分银行承担风险的业务纳入统一授信管理；2. 同业投资资金违规用于支付土地出让金；3. 同业投资资金违规用于上市公司定向增发；4. 同业投资资金违规用于土地储备开发；5. 违规为第三方金融机构同业投资业务提供信用担保；6. 理财产品之间相互调节收益；7. 理财资金投资非标债权资产总额超过规定上限；8. 面向一般个人客户销售的理财产品违规投资权益类资产；9. 理财资金与自营资金未充分隔离；10. 理财投资非标业务未比照自营贷款管理；11. 关联方管理不全面；12. 违规向关系人发放信用贷款；13. 债券投资操作不规范。

20 平安银行 CD189 (112011189. IB) 为鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2020 年 1 月 20 日中国银保监会深圳监管局针对平安银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款 720 万元。主要违法违规事实如下：1. 汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成；2. 代理保险销售的人员为非商业银行人员；3. 汽车消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平；4. 个人消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平；5. 个人经营性贷款分类结果不能反映真实风险水平；6. 汽车消费贷款和汽车抵押贷款贷前调查存在缺失；7. 汽车消费及经营贷款审查不到位；8. 个人

汽车贷款和汽车抵押贷款业务存在同一抵押物重复抵押；9. 个别汽车消费贷款和汽车抵押贷款用途管控不力，贷款资金被挪用；10. 个人消费贷款及个人经营性贷款用途管控不力，贷款资金被挪用；11. 部分个人消费贷款未按要求进行受托支付；12. 信用卡现金分期用途管控不力；13. 代销产品风险评级结果与合作机构评级结果不一致，未采用较高风险评级的评级结果；14. 代销产品底层资产涉及本行非标资产，没有实现代销业务与其他业务的风险隔离；15. “双录”管理审慎性不足，理财销售人员销售话术不当。

18 宁波银行 01 (1820009. IB) 为鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2019 年 12 月 5 日宁波银保监局针对宁波银行存在设立时点性规模考核指标，股权质押管理不合规情形，处以罚款人民币 40 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

本基金投资 16 交行绿色金融债 02、20 中信银行 CD156、16 广发银行 01、18 南京银行 01、20 平安银行 CD189、18 宁波银行 01 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 16 交行绿色金融债 02、20 中信银行 CD156、16 广发银行 01、18 南京银行 01、20 平安银行 CD189、18 宁波银行 01 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。

5.10.2 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

本基金本报告期内未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	7,182.38
2	应收证券清算款	10,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	17,209,604.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,216,786.93

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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

报告期期初基金份额总额	1,444,844,515.43
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
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	1,444,844,515.43

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

本报告期内基金管理人未持有本基金。

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

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	2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日	299,999,000.00	-	-	299,999,000.00	20.76%
	2	2020 年 7 月 1	299,999,000.00	-	-	299,999,000.00	20.76%

		日-2020 年 9 月 30 日					
	3	2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日	296,519,585.63	-	-	296,519,585.63	20.52%
个人	-	-	-	-	-	-	-
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淳优一年定期开放债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬淳优一年定期开放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

2020 年 10 月 28 日