

**鹏扬现金通利货币市场基金
更新的招募说明书摘要
(2018 年第 2 号)**

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

截止日：2018 年 8 月 10 日

【重要提示】

1、本基金根据2017年7月12日中国证券监督管理委员会《关于准予鹏扬现金通利货币市场基金注册的批复》（证监许可[2017] 1208号）进行募集。本基金基金合同于2017年8月10日正式生效，自该日起基金管理人正式开始管理本基金。

2、基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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。

3、投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。投资人需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险等等。

4、本基金为货币市场基金，预期收益和预期风险低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。属于低风险/收益的产品。

5、本基金投资于货币市场工具，面临货币市场利率波动的风险，基金每日的收益将根据市场情况上下波动，在极端情况下可能为负值。由于货币市场基金的特殊要求，为满足投资者的赎回需要，基金必须保持一定的现金比例以应对赎回的需求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险或现金过多而带来的机会成本风险。

6、在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负时，当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额1%以上的，该基金份额持有人可能面临被征收1%的强制赎回费用的风险，上述赎回费用全额计入基金财产。

7、基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

8、基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

9、投资人购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

10、本招募说明书所载内容截止日为2018年8月10日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2018年6月30日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：鹏扬基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区栖霞路120号3层302室

办公地址：北京市西城区复兴门外大街A2号中化大厦16层

邮政编码：100045

法定代表人：杨爱斌

成立日期：2016年7月6日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2016]1453号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.0518亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：李雯婷

联系电话：010-68105888

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

范勇宏先生：董事长，经济学博士。现任香山财富研究院联席理事长、宏实资本管理有限公司执行董事兼总经理。曾先后在中国建设银行、华夏证券股份有限公司、华夏基金管理有限公司、中国人寿资产管理有限公司等单位工作。从事金融工作近30年，具有比较丰富的金融工作经历。

杨爱斌先生：董事，复旦大学国际金融专业经济学硕士。现任鹏扬基金管理有限公司总经理。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总

经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

姜山先生：董事，美国印第安纳大学商学院工商管理硕士。现任上海华石投资有限公司执行董事兼总经理，北京鹏扬企业管理有限公司总经理。历任安达信华强会计师事务所审计师、美国 Sara Lee 公司内部审计师、瑞银投资银行董事、高盛亚洲有限公司执行董事、美国德州太平洋集团董事及北京代表处首席代表、摩根士丹利华鑫证券有限责任公司投资银行部董事总经理。

董建瑾女士：独立董事，美国伊利诺伊理工学院肯特法学院法学硕士。现任北京观韬律师事务所合伙人。历任北京市新闻出版局科员、北京高华证券有限公司执行董事、上海国际能源交易中心首席律师、北京市君泽君律师事务所合伙人。

邱峻女士：独立董事，美国波士顿学院工商管理硕士。现任信达金誉（上海）投资管理有限公司财务总监。历任安永会计师事务所美国纽约分所高级审计师、高级经理、安永华明会计师事务所上海分所高级经理、蓝山投资咨询（北京）有限公司财务总监。

王鹤菲女士：独立董事，美国斯坦福大学商学院金融系哲学博士。现任中国人民大学国际学院金融学教授。历任美国伊利诺伊大学芝加哥分校商学院金融系助理教授、美联储芝加哥银行访问经济学家、清华大学经济管理学院金融系访问学者、中国投资有限责任公司风险管理部访问经济学家。中国人民大学汉青研究院金融系副教授、副系主任。

2、基金管理人监事会成员

王徽先生：监事，江苏大学经济学学士。现任中钰资本管理（北京）股份有限公司合伙人、首席风控官。历任中国华晶电子集团会计、爱韩华电子（无锡）电子有限公司财务经理、江苏苏亚会计师事务所南方分所审计经理、北京中星微电子有限公司财务经理、无锡东林会计师事务所合伙人、利安达会计师事务所（特殊普通合伙）合伙人。王徽先生现担任北京注册会计师协会经济责任审计专业委员会专家委员及北京总会计师协会理事。

吉瑞女士：监事（职工监事），对外经济贸易大学管理学学士。现任鹏扬基金管理有限公司监察稽核部总监。历任安永华明会计师事务所金融审计部审计师，毕马威华振会计师事务所风险咨询部助理经理及高瓴资本管理有限公司法律合规部高级经理。

曹铮女士：监事（职工监事），北京大学经济学学士。现任鹏扬基金管理有限公司人力资源及行政管理部总监。历任国家电网公司监察局文员、北京科舵整合创意咨询有限公司人事助理、索尼爱立信（中国）有限公司人事专员、微软亚洲研究院人事经理、北京鹏扬投资管理公司人力资源及行政管理部总监。

3、高级管理人员

杨爱斌先生：总经理，复旦大学国际金融专业经济学硕士。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

李刚先生：副总经理，中国社科院经济学博士。历任中国农业银行资产负债管理部交易员、资金营运部高级交易员、金融市场部处长、副总经理。

卢安平先生：副总经理，清华大学工商管理硕士。历任全国社保基金理事会资产配置处长、风险管理处长，中国平安保险（集团）股份有限公司委托与绩效评估部总经理，平安人寿保险股份有限公司委托投资部总经理。

李操纲先生：副总经理，南京大学管理学博士。历任华夏证券股份有限公司资金清算中心总经理、华夏基金管理有限公司副总经理、中国金融在线有限公司首席运营官、阳光保险集团股份有限公司执行委员会委员。

宋震先生：督察长，北京大学数学学院理学学士，中国经济研究中心经济学双学士，北京大学信息科学技术学院工学硕士，曾任 Schlumberger Ltd 工程师、龙翌创富顾问有限公司副总裁、中国证监会北京监管局主任科员。

4、本基金基金经理

陈钟闻先生：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利率债投资研究，债券交易工作。鹏扬利泽债券型证券投资基金基金经理（2018年2月5日起任）、鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金（2018年1月19日）、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金（2018年8月9日）。

5、固定收益投资决策委员会成员情况

王华先生：固定收益总监、固定收益投资决策委员会主任委员，清华大学理学学士，CFA、FRM，曾任银河期货有限公司研究员，银河期货有限公司自营子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。

杨爱斌先生：总经理，复旦大学国际金融专业经济学硕士。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

李刚先生：副总经理，中国社科院经济学博士。历任中国农业银行资产负债管理部交易员、资金营运部高级交易员、金融市场部处长、副总经理。

陈钟闻先生：固定收益部执行总经理、现金策略总监，毕业于北京理工大学，工商管理硕士。曾任北京鹏扬投资管理有限公司交易主管、投资经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

三、相关服务机构

(一) 基金份额销售机构

1、直销机构

(1) 鹏扬基金管理有限公司直销柜台

办公地址：北京市西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 16 层

法定代表人：杨爱斌

全国统一客户服务电话：4009686688

联系人：吴瑞

传真：010-68105966

(2) 鹏扬基金管理有限公司电子直销交易

客服电话：4009686688

网址：www.pyamc.com

2、其他销售机构

各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

(1) 中国国际金融股份有限公司

注册地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

代理法定代表人:毕明建

联系人:杨涵宇

电话:010-65051166

传真:010-85679203

客户服务电话:400-910-1166

网址:www.cicc.com

(2) 招商银行股份有限公司

注册地址:深圳市福田区深南大道7088号

办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:李建红

联系人:周嘉谊

电话:0755-83271192

传真:0755-83195049

客户服务电话:95555

网址:www.cmbchina.com

(3) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人:鲍东华

联系人:宁博宇

电话:021-20665952

传真:021-22066653

客服电话:4008219031

网址:www.lufunds.com

(4) 上海好买基金销售有限公司

注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

法定代表人:杨文斌

联系人:陆敏

电话：021-20613999

传真：021-68596919

客户服务电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(5) 天津万家财富资产管理有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

联系人：褚琦

电话：18513528806

传真：021-38909659

客户服务电话：010-59013825

网址：www.wanjiawealth.com

(6) 济安财富（北京）资本管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：010-65309516

传真：010-65330699

客户服务电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

(7) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人：江卉

联系人：赵德赛

电话：010-89188345

客户服务电话：95118（个人业务）；400 088 8816（企业业务）

网址：<http://fund.jd.com>

(8) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：张彦

联系人：文雯

电话：010-83363101

客户服务电话：400-116-1188

网址：8.jrj.com.cn

(9) 通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼

法定代表人：马刚

联系人：杨徐霆

电话：021-60818249

客户服务电话：400-66-95156

网址：<https://www.tonghuafund.com>

(10) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：何薇

电话：010-65980380-8011

客户服务电话：95021 / 4001818188

网址：<http://www.1234567.com.cn>

(11) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

客户服务电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com

(12) 一路财富（北京）信息科技股份

注册地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室

法定代表人：吴雪秀

联系人：徐越

电话：(010)88312877

客户服务电话：400-001-1566

网址：<http://www.yilucaifu.com>

(13) 兴业银行股份有限公司

注册地址:福建省福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：上海市江宁路 168 号兴业大厦

法定代表人：高建平

联系人：卞晷煜

电话：021-52629999-218022

传真：021-62565787

客户服务电话：95561

网址：www.cib.com.cn

(14) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

联系人：戚晓强

电话：15810005516

客户服务电话：4000-618-518

网址：<http://danjuanapp.com>

(15) 凤凰金信（银川）基金销售有限公司

宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402(750000)

办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼 (100000)

法定代表人：程刚

联系人：张旭

电话：010-58160168

客户服务电话：400-810-5919

网址：www.fengfd.com

(16) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

联系人：仲秋玥

电话：010-88066632

客户服务电话：400-817-5666

网址: www.amcfortune.com

(17) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人: 李昭琛

联系人: 吴翠

电话: 010-62675369

客户服务电话: 010-62675369

网址: www.xincai.com

(18) 中信建投证券股份有限公司

注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 18 层

法定代表人: 王常青

联系人: 刘芸

电话: 010-85156310

传真: 010-65182261

客户服务电话: 95587/4008-888-108

网址: www.csc108.com

(19) 中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

联系人: 郑慧

电话: 010-60838888

传真: 010-6083 6029

客户服务电话: 95548

网址: www.cs.ecitic.com

(20) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址: 青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人: 姜晓林

联系人: 刘晓明

电话：0531—89606165

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

(21) 中信期货有限公司

注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、
14层

办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、
14层

法定代表人:张皓

联系人:刘宏莹

电话:010-60833754

传真:0755-83217421

客户服务电话:400-990-8826

网址：www.citicsf.com

(22) 申万宏源证券有限公司

注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人:李梅

联系人:王叔胤

电话:021-33388252

传真:021-33388224

客户服务电话:95523/400-889-5523

网址：www.swhysc.com

(23) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005
室

办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼

法定代表人:韩志谦

联系人:王叔胤

电话:021-33388252

传真:021-33388224

客户服务电话:400-800-0562

网址：www.hysec.com

(24) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

电话：0755-89460500

客户服务电话：400-684-0500

网址：<https://www.ifastps.com.cn>

(25) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户服务电话：020-89629066

网址：<https://www.yingmi.cn/>

(26) 众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08

法定代表人：李招弟

联系人：李艳

电话：010-59497361

客户服务电话：400-876-9988

网址：<http://www.zscffund.com/>

(27) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14楼、16楼、17楼

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14楼、16楼、17楼

法定代表人：丁益

联系人：金夏

电话：0755-83516289

电子邮件：jinxia@cgws.com

客服电话：4006666888

网址: www.cgws.com

(28) 上海挖财金融信息服务有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人: 胡燕亮

联系人: 孙琦

电话: 021-50810687

客户服务电话: 021-50810673

网址: www.wacaijijin.com

(29) 嘉实财富管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

办公地址: 北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人: 赵学军

联系人: 余永健

电话: 010-85097570

客户服务电话: 400-021-8850

网址: <https://www.harvestwm.cn/>

(30) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人: 杨德红

客户服务电话: 95521 / 4008888666

总机: 021-38676666

传真: 021-38670666

网址: www.gtja.com

(31) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址: 上海市中山东一路 12 号

法定代表人: 高国富

联系人: 张佳乐

电话: 021-61162071

传真: 021-63604199

客户服务电话: 95528

网址: <http://www.spdb.com.cn/>

(32) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：中国杭州市西湖区西溪路 556 号蚂蚁 Z 空间

法定代表人：陈柏青

联系人：傅强

电话：13811165370

客户服务电话：95188

网址：<http://www.antfortune.com/>

(33) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人：戎兵

联系人：魏晨

电话：010-52413385

电子邮件：chenwei@creditease.cn

客服电话：400-6099-200

网址：www.yixinfund.com

(34) 北京坤元基金销售有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 8 号 B 座 501

办公地址：北京市东城区建国门内大街 8 号 B 座 501

法定代表人：李雪松

联系人：刘洋

电话：13910846056

电子邮件：liuyang@kunyuanfund.com

客服电话：400-818-5585

网址：<http://kunyuanfund.com/>

(35) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)

办公地址：上海浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

注册资本：2000 万元人民币

联系人：吴鸿飞

电话：021-65370077*268

电子邮件：wuhongfei@fofund.com.cn

客服电话：4008205369

网址：<https://www.jiyufund.com.cn/>

(36) 上海朝阳永续基金销售有限公司

注册地址：浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室

办公地址：上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼

法定代表人：廖冰

注册资本：壹亿元人民币

联系人：裘爱萍

电话：021-80234888-6693

客服电话：400-699-1888

网址：www.998fund.com

(37) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

(38) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：万玉琳

电话：0755-82026907

客户服务电话：95532

网址：www.china-invs.cn

(二) 登记机构

名称：鹏扬基金管理有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 16 层

法定代表人：杨爱斌

全国统一客户服务电话： 4009686688

联系人：韩欢

传真： 010-68105932

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：021- 51150298

传真： 021- 51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、范佳斐

（四）会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：（010）58153000

传真电话：（010）85188298

经办注册会计师：王珊珊、贺耀

联系人：贺耀

四、基金的名称

鹏扬现金通利货币市场基金

五、基金运作方式和类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括：

- 1、现金；
 - 2、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；
 - 3、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；
 - 4、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。
- 如法律法规或监管机构以后对货币市场基金的投资范围与限制进行调整，本基金将随之调整。

八、基金的投资策略

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。

1、流动性管理策略

本基金紧密关注申购/赎回现金流情况、季节性资金流动、日历效应等，建立组合流动性预警指标，实现对基金资产的结构化管理。在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下，通过基金资产安排（包括现金库存、资产变现、剩余期限管理或以其他措施），确保基金资产的整体变现能力。

2、平均剩余期限和组合期限结构策略

货币市场利率预测是进行货币市场投资的基础，本基金将建立利率分析系统，对货币市场利率走势进行预测，动态跟踪国内外宏观经济走势、央行货币政策及公开市场操作、市场资金面供需关系变化，以此为根据确定组合的平均剩余期限。预测货币市场利率上升时，适当缩短组合平均剩余期限，规避利率风险；预测利率水平下降时，适当延长组合平均剩余期限，获取利率下降带来的回报。同时，本基金将结合货币市场收益率曲线变动趋势进行利率期限结构管理，确定合理的组合期限结构分布方式，合理确定不同期限品种的配置比例。

3、资产配置策略

本基金将主要依据各短期金融工具细分市场的规模、流动性、收益性及信用风险环境等，寻找相对投资价值更高的品种，建立动态规划模型，确定不同资产配置比例和同类资产的基于不同利率期限结构的配置比例，具体确定各类资产的占比。

4、个券选择策略

用自下而上的方法选择价值相对低估的债券。通过考察收益率曲线的相对位置和形状，结合票息、税收、可否回购等其他决定债券价值的因素，从而发现市场中个券的价值相对低估状况。

5、融资杠杆策略

通过分析回购品种之间的利差及其变动，结合对年末效应和长假效应的灵活使用，进行回购品种的比例配置。本基金将流动性要求作为首务，在资金面出现波动时，应提前反应，缩减杠杆至安全水平。

6、资产支持证券投资策略

重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

九、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）

如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、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。

十一、基金的投资组合报告

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2018年7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。

以下内容摘自本基金2018年第2季度报告，所列财务数据未经审计。

（一）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	3,448,360,942.33	64.99
	其中：债券	3,418,360,942.33	64.43

	资产支持证券	30,000,000.00	0.57
2	买入返售金融资产	1,572,677,500.00	29.64
	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	255,085,870.26	4.81
4	其他资产	29,793,703.22	0.56
5	合计	5,305,918,015.81	100.00

(二) 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	6.85	
	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	295,299,652.35	5.90
	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%。

(三) 基金投资组合平均剩余期限

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	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	75

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。

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	各期限负债占基金资产
----	--------	------------	------------

		产净值的比例 (%)	净值的比例 (%)
1	30 天以内	31.69	5.90
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	14.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	23.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	10.31	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	25.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	105.37	5.9

(四) 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。

(五) 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	320,091,434.33	6.39
	其中：政策性金融债	320,091,434.33	6.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	840,027,296.97	16.78
6	中期票据	10,043,071.09	0.20

7	同业存单	2,248,199,139.94	44.90
8	其他	-	-
9	合计	3,418,360,942.33	68.27
10	剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债券	-	-

(六) 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	111809170	18 浦发银行 CD170	2,500,000	247,994,803.02	4.95
2	111820104	18 广发银行 CD104	2,000,000	198,995,664.42	3.97
3	111811134	18 平安银行 CD134	2,000,000	198,748,034.79	3.97
4	111809182	18 浦发银行 CD182	2,000,000	198,340,282.56	3.96
5	111815262	18 民生银行 CD262	2,000,000	198,340,282.56	3.96
6	111815243	18 民生银行 CD243	1,500,000	148,901,025.44	2.97
7	111811097	18 平安银行 CD097	1,500,000	148,240,243.02	2.96
8	180201	18 国开 01	1,300,000	130,193,737.41	2.60
9	011801179	18 豫交投 SCP003	1,000,000	100,005,436.42	2.00
10	011801177	18 澜沧江 SCP004	1,000,000	100,002,764.67	2.00

(七) “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	0.1862%
报告期内偏离度的最低值	0.0042%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0742%

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。

(八) 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	146689	花呗 50A1	300,000	30,000,000.00	0.60

(九) 投资组合报告附注

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。

2、基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明：

18 浦发银行 CD170 (111809170.IB)、18 浦发银行 CD182 (111809182.IB) 为鹏扬现金通利货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 2 月 12 日中国银监会针对浦发银行存在以下主要违法违规事实，罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元。主要违法违规事实：(一) 内控管理严重违反审慎经营规则；(二) 通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款；(三) 通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节；(四) 理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求；(五) 提供不实说明材料、不配合调查取证；(六) 以贷转存，虚增存贷款；(七) 票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严；(八) 国内信用证业务贸易背景审查不严；(九) 贷款管理严重缺失，导致大额不良贷款；(十) 违规通过同业投资转存款方式，虚增存款；(十一) 票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理；(十二) 对代理收付资金的信托计划提供保本承诺；(十三) 以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产；(十四) 投资多款同业理财产品未尽职审查，涉及金额较大；(十五) 修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符；(十六) 为非保本理财产品出具保本承诺函；(十七) 向关系人发放信用贷款；(十八) 向客户收取服

务费，但未提供实质性服务，明显质价不符；（十九）收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本。

18 广发银行 CD104(111820104. IB)为鹏扬现金通利货币市场基金的前十大持仓证券。2017 年 11 月 17 日中国银监会针对广发银行存在以下主要违法违规事实，给予警告，没收违法所得 17553.79 万元，并处 3 倍罚款 52661.37 万元，对其他违规行为罚款 2000 万元，罚没合计 72215.16 万元。主要违法违规事实：（一）出具与事实不符的金融票证；（二）未尽审查保理业务贸易背景真实性；（三）内控管理严重违反审慎经营规则；（四）劳务派遣用工管理不到位；（五）对押品评估费用管理不到位；（六）未向监管部门报告风险信息；（七）未向监管部门报告重要信息系统突发事件；（八）会计核算管理薄弱；（九）信息系统与业务流程控制未按规定执行；（十）流动资金贷款用途监督不到位，未尽审查银行承兑汇票贸易背景真实性；（十一）以流动资金贷款科目向房地产开发企业发放贷款；（十二）报送监管数据不真实。

18 平安银行 CD134（111811134. IB）、18 平安银行 CD097（111811097. IB）为鹏扬现金通利货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 3 月 14 日中国人民银行针对平安银行违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定，给予警告，没收违法所得 3,036,061.39 元，并处罚款 10,308,084.15 元，合计处罚金额 13,344,145.54 元。2018 年 2 月 7 日大连银监局针对平安银行存在贷款资金转存款质押开立银行承兑汇票并在他行贴现，贴现资金回流转存款质押重复开立银行承兑汇票的违法事实，处以人民币四十万元罚款。

本基金投资 18 浦发银行 CD170、18 浦发银行 CD182、18 广发银行 CD104、18 平安银行 CD134、18 平安银行 CD097 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 18 浦发银行 CD170、18 浦发银行 CD182、18 广发银行 CD104、18 平安银行 CD134、18 平安银行 CD097 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。

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	13,767,695.55

4	应收申购款	16,026,007.67-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	29,793,703.22

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。

十二、基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。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。

本基金合同生效日为2017年8月10日，基金合同生效以来（截至2018年6月30日）的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

鹏扬通利货币 A

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 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
自基金合 同生效起 至2017年 12月31 日	1.5587%	0.0013%	0.5326%	0.0000%	1.0261%	0.0013%
2018年1 月1日至 2018年6 月30日	2.0970%	0.0013%	0.6695%	0.0000%	1.4275%	0.0013%
自基金合 同生效起 至2018年 6月30日	3.6884%	0.0013%	1.2021%	0.0000%	2.4863%	0.0013%

鹏扬通利货币 B

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 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
自基金合 同生效起 至2017年 12月31 日	1.6378%	0.0013%	0.5326%	0.0000%	1.1052%	0.0013%
2018年1 月1日至 2018年6 月30日	2.1984%	0.0013%	0.6695%	0.0000%	1.5289%	0.0013%
自基金合 同生效起 至2018年 6月30日	3.8722%	0.0013%	1.2021%	0.0000%	2.6701%	0.0013%

十三、基金费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.09%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.09\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金销售服务费

本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.21%，对于由B类基金份额降级为A类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额的费率。B类基金份额的年销售服务费率为0.01%，对于由A类基金份额升级为B类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起适用B类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第4—10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

（五）与基金销售有关的费用

- 1、本基金的基金份额净值保持为人民币 1.00 元。
- 2、本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用，但在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个工作日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额的 1%以上的赎回申请（即超过基金总份额 1%以上的部分）征收 1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金资产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及《鹏扬现金通利货币市场基金基金合同》，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2018年3月17日刊登的本基金的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书的截止日期、财务数据截止日期等相关内容；

- 2、在“第一部分 绪言”部分，加入了《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的相关信息；
- 3、在“第二部分 释义”部分，加入了《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的相关信息；
- 4、在“第三部分 基金管理人”部分，更新了基金管理人的相关信息；
- 5、在“第四部分 基金托管人”部分，更新了基金托管人的相关信息；
- 6、在“第五部分 相关服务机构”部分，增加了新的销售机构及其相关信息，相关事项均已公告，并更新了会计师事务所部分信息；
- 7、在“第八部分 基金份额的申购与赎回”部分，更新了部分内容；
- 8、在“第九部分 基金的投资”部分，更新了基金的投资组合报告等部分内容；
- 9、在“第十部分 基金的业绩”部分，更新了相关数据内容；
- 10、在“第十二部分 基金资产的估值”部分，更新了部分内容；
- 11、在“第十六部分 基金的信息披露”部分，更新了部分内容；
- 12、在“第二十部分 基金托管协议的内容摘要”部分，更新了部分内容；
- 13、在“第二十三部分 其他应披露事项”这一部分，更新了本基金招募说明书更新期间，本基金及基金管理人的有关公告。

鹏扬基金管理有限公司

2018年9月21日