

# 鹏扬现金通利货币市场基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 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

送出日期：2019 年 8 月 23 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2019 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 其他指标                                | 10        |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 14        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 15        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 16        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 16        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见      | 16        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>17</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 17        |
| 6.2 利润表                                 | 18        |

|                                              |           |
|----------------------------------------------|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                     | 19        |
| 6.4 报表附注 .....                               | 20        |
| <b>§7 投资组合报告 .....</b>                       | <b>41</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                         | 41        |
| 7.2 债券回购融资情况 .....                           | 41        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限 .....                       | 41        |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....        | 42        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                   | 42        |
| 7.6 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 .....     | 43        |
| 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....         | 43        |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 ..... | 43        |
| 7.9 投资组合报告附注 .....                           | 44        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>                    | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                  | 45        |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....                 | 45        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....               | 45        |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....      | 46        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                    | <b>46</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                      | <b>47</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                       | 47        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....       | 47        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....            | 47        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                         | 47        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                  | 47        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....          | 47        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                 | 47        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....                  | 48        |
| 10.9 其他重大事件 .....                            | 48        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>              | <b>50</b> |
| 11.1 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 .....     | 50        |

|                           |           |
|---------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... | 50        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>    | <b>51</b> |
| 12.1 备查文件目录.....          | 51        |
| 12.2 存放地点.....            | 51        |
| 12.3 查阅方式.....            | 51        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称            | 鹏扬现金通利货币市场基金       |                    |
| 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    |                    |
| 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       |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 4,181,048,314.90 份 |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                    |
| 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 | 46,914,048.28 份    | 4,134,134,266.62 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                     |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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。                                             |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                            | 基金托管人                 |
|---------|------|----------------------------------|-----------------------|
| 名称      |      | 鹏扬基金管理有限公司                       | 中国建设银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 吉瑞                               | 田青                    |
|         | 联系电话 | 010-68105888                     | 010-67595096          |
|         | 电子邮箱 | service@pyamc.com                | tianqingl.zh@ccb.com  |
| 客户服务电话  |      | 400-968-6688                     | 010-67595096          |
| 传真      |      | 010-68105966                     | 010-66275853          |
| 注册地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 120 号 3 层 302 室 | 北京市西城区金融大街 25 号       |
| 办公地址    |      | 北京市西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 16 层       | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码    |      | 100045                           | 100033                |

|       |     |     |
|-------|-----|-----|
| 法定代表人 | 杨爱斌 | 田国立 |
|-------|-----|-----|

## 2.4 信息披露方式

|                      |                                                         |
|----------------------|---------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《证券时报》                                                  |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.pyamc.com">http://www.pyamc.com</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的住所                                          |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                      |
|--------|------------|---------------------------|
| 注册登记机构 | 鹏扬基金管理有限公司 | 北京西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 16 层 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别          | 鹏扬通利货币 A                                | 鹏扬通利货币 B                                |
|---------------|-----------------------------------------|-----------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期( 2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日 ) | 报告期( 2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日 ) |
| 本期已实现收益       | 586,030.52                              | 74,328,711.58                           |
| 本期利润          | 586,030.52                              | 74,328,711.58                           |
| 本期净值收益率       | 1.2128%                                 | 1.3133%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2019 年 6 月 30 日 )                 |                                         |
| 期末基金资产净值      | 46,914,048.28                           | 4,134,134,266.62                        |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                                  | 1.0000                                  |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末( 2019 年 6 月 30 日 )                 |                                         |
| 累计净值收益率       | 6.5267%                                 | 6.9295%                                 |

注：1、本基金利润分配按日结转份额。

2、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，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。

#### 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         | 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     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月      | 0.1834%  | 0.0020%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.0724% | 0.0020% |
| 过去三个月      | 0.5590%  | 0.0026%     | 0.3366%    | 0.0000%       | 0.2224% | 0.0026% |
| 过去六个月      | 1.2128%  | 0.0022%     | 0.6695%    | 0.0000%       | 0.5433% | 0.0022% |
| 过去一年       | 2.7373%  | 0.0019%     | 1.3500%    | 0.0000%       | 1.3873% | 0.0019% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.5267%  | 0.0025%     | 2.5521%    | 0.0000%       | 3.9746% | 0.0025% |

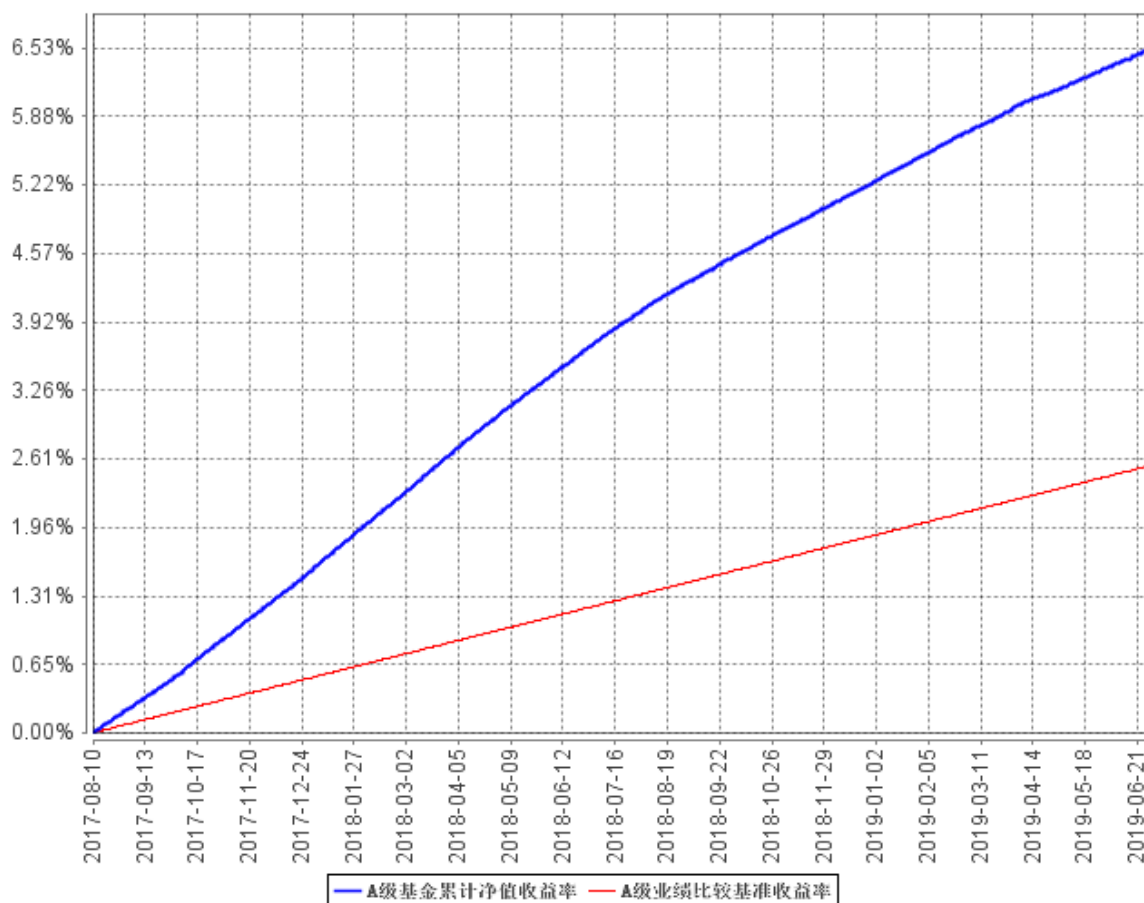
鹏扬通利货币 B

| 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     |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.1999%  | 0.0020%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.0889% | 0.0020% |
| 过去三个月 | 0.6092%  | 0.0026%     | 0.3366%    | 0.0000%       | 0.2726% | 0.0026% |

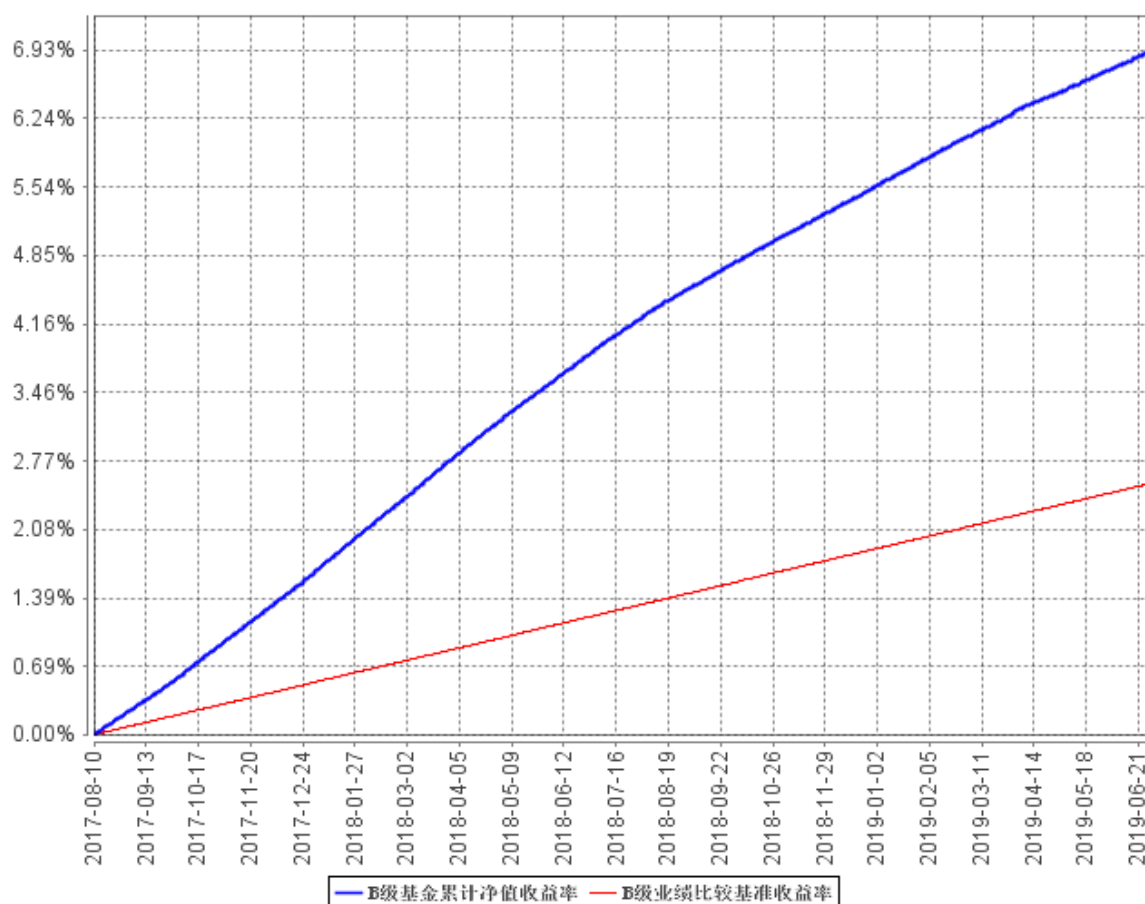
|            |         |         |         |         |         |         |
|------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 过去六个月      | 1.3133% | 0.0022% | 0.6695% | 0.0000% | 0.6438% | 0.0022% |
| 过去一年       | 2.9433% | 0.0019% | 1.3500% | 0.0000% | 1.5933% | 0.0019% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.9295% | 0.0025% | 2.5521% | 0.0000% | 4.3774% | 0.0025% |

### 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 06 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 1.2128%，本报告期鹏扬通利货币 B 的基金份额净值收益率为 1.3133%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

### 3.3 其他指标

注：无

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为鹏扬基金管理有限公司，经中国证监会证监许可【2016】1453 号文批准，成立于 2016 年 7 月 6 日，是我国第一家由阳光私募基金管理人股东发起设立的公募基金管理公司，该阳光私募基金管理人北京鹏扬投资管理有限公司（以下简称“鹏扬投资”）曾是国内最大的固定收益类私募基金管理人之一。公司注册资本 11800 万元人民币，杨爱斌持股比例为 50.000%，上海华石投资有限公司持股比例为 28.156%，宏实资本管理有限公司持股比例为 7.500%，上海济通企业管理中心（有限合伙）、上海璞识企业管理中心（有限合伙）和上海润京企业管理中心（有限合伙）持股比例分别为 4.364%、4.990%和 4.990%。公司注册地在上海，主要办公地在北京，已在北京、上海、深圳成立分公司。公司的经营宗旨为：纪律为本，稳健增值。公司长远目标是成为在中国资本市场上有影响力的、能持续为客户创造价值的专业化资产管理公司。公司于 2017 年荣获中国证券报中国基金业“2016 年度金牛特别贡献奖”；于 2018 年荣获证券时报“2018 年度明星基金公司成长奖”、荣获朝阳永续 2018 年度“创业成就奖”、荣获新浪 2018 年度“最受信赖责任投资基金公司”。

截至 2019 年 6 月 30 日，公司公募基金规模达 306.70 亿元，非货币公募基金规模 264.89 亿元。公司旗下有鹏扬汇利债券型证券投资基金、鹏扬利泽债券型证券投资基金、鹏扬现金通利货币市场基金、鹏扬景兴混合型证券投资基金、鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金、鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金、鹏扬双利债券型证券投资基金、鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金、鹏扬景欣混合型证券投资基金、鹏扬淳合债券型证券投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、鹏扬泓利债券型证券投资基金、鹏扬淳享债券型证券投资基金、鹏扬核心价值灵活配置混合型证券投资基金、鹏扬添利增强债券型证券投资基金、鹏扬淳盈 6 个月定期开放债券型证券投资基金共 16 只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务               | 任本基金的基金经理（助理）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 | 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利率债投资研 |

|     |           |                 |   |   |                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----|-----------|-----------------|---|---|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | 监，本基金基金经理 |                 |   |   | 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。 |
| 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。                                                                         |

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年全球经济下行压力加大，经合组织综合领先指标已进入明显“放缓”阶段，同时通货膨胀低于预期，美联储暂停加息，市场预期下半年降息 2 次。全球越来越多的央行跟随美联储下调经济增长预期转向鸽派立场，中国央行一季度大幅下调存款准备金率，同时通过公开市场操作投放大量流动性，并通过 TMLF 下调公开市场的利率。在宽松货币政策预期下，全球资本市场风险偏好明显提升，发达经济体国债收益率大幅下行，风险资产重新大幅上涨，美股重新创出历史新高，但商品价格出现回落趋势。

2019 年上半年中国经济在适度宽松的货币政策和积极财政政策共同支持下，出现企稳迹象略超市场预期。从需求数据来看，经济增长的主要推动力是房地产投资，但制造业投资持续回落。基建投资在一季度“早投放、早实施、早见效”的积极财政政策支持下，出现小幅回升迹象但面临后续乏力的压力。受减税降费政策的实施，消费需求出现回升，企业盈利增长也有所好转。二季度受中美贸易摩擦重新升级和货币信贷政策边际收紧影响，中国经济领先指标重新出现走弱的迹象，市场对下半年经济企稳回升的预期有所降低。通货膨胀方面，受猪肉和水果等食品价格上涨影响，CPI 出现明显回升，但核心 CPI 和 PPI 小幅回落，通货膨胀预期不强。流动性方面，4 月政治局会议后，央行适度回收流动性，但包商接管事件后，为对冲金融同业流动性收缩风险，央行通过公开市场投放巨额流动性，但流动性在大型金融机构和中小金融机构之间出现明显分层迹象，交易对手风险明显上升。

加权期限维持在 58 天附近，坚持以提高正偏离为目标，保持正偏离在 +5bp 以上，10 个工作

日内到期资产 30%附近，增强组合流动性。

#### 4.4.2 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 1.2128%，本报告期鹏扬通利货币 B 的基金份额净值收益率为 1.3133%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年全球经济增长从 2018 年周期分化转为同步放缓。经济合作与发展组织（OECD）公布 5 月份综合领先指标显示全球经济已经连续 9 个月下行且处于 100 点以下，主要经济体除中国在 2019 年 3 月企稳出现回升外，美国、日本、欧元区均面临持续下行压力。我们认为全球央行货币重回宽松能延缓经济下行压力，但在全球债务杠杆较高和全球贫富差距持续扩大导致的民粹主义兴起、全球贸易保护主义抬头的大背景下，全球政治经济格局将进入一个前所未有的新阶段，全球经济很可能进入一个较低的增长阶段，同时全球货币金融体系的分化将给全球资本市场带来巨大的不确定性。

我们认为，2019 年下半年中国经济将面临下行的压力，实际 GDP 增长将下降到 6%-6.2%的水平，名义 GDP 增长将下降到 7.5%-8%的水平。增长回落的主要驱动力是在上半年偏高的房地产投资在下半年房地产政策不放松甚至进一步加强的背景下，棚户区改造计划和货币化安置大幅减少导致房地产销量持续回落，而开发商土地高库存、高新开工、高施工、低竣工的格局不可持续。三季度受上半年宽松的货币政策和积极的财政政策刺激，经济仍有一定韧性，但展望四季度，受包商事件引发的流动性分层和信用收缩效应对总需求压制、中美贸易冲突长期化对出口增长和 FDI 等不利因素影响，经济增长预计将略微低于市场预期。

通货膨胀方面，短期来看，CPI 可能受到猪肉等食品价格上涨影响而继续有所抬升，但核心 CPI 继续保持低位；PPI 总体趋势下降，下半年工业品通缩趋势将更为明显。中期来看，制造业投资下降导致的名义工资下降短期对债券市场形成一定影响，科技创新力度加大导致的商品和服务价格下降，金融防风险、金融供给侧结构性改革导致的金融部门低质量扩张的终结，因此我们认为未来 1-2 年通货紧缩风险大于通货膨胀风险。

流动性方面，在 1 季度超预期的信贷和社融数据公布后，央行货币政策转为松紧适度，基础货币连续 2 月下降；5 月份，受中美贸易战 2.0 和包商接管引发同业流动性收缩风险的影响，央行连续大幅投放流动性。若 3 季度美联储如市场预期降息，中国央行降低公开市场操作利率也将是大概率事件。展望三季度信贷和社会融资总量，除地方政府债券可能继续高速增长外，企业部门融资环境略有收缩，这在一定程度上意味着私人非金融部门流动性重新面临收缩局面。

下半年债券市场总体机会大于风险，下跌即是买入机会。主要支持因素是全球经济下行趋势不变和全球货币政策重回宽松导致的流动性支持，主要的风险是猪肉等食品价格的超预期上涨和股票市场风险偏好的大幅提升。从债券类属来看，信用收缩和分化背景下对利率和中高等级信用债券仍比较有利，相反部分基本面不好、杠杆水平较高的中小民营企业、非行业龙头的房地产公司和债务水平较高且财政实力较弱的地方融资平台的债务违约风险仍较大，下沉信用评级仍面临较大风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（成员包括公司分管领导以及投资研究部、监察稽核部、交易管理部、基金运营部等部门负责人及相关业务骨干，估值委员会成员中不包括基金经理）。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配

但尚未实施的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期内向 A 级份额持有人分配利润：586,030.52 元，向 B 级份额持有人分配利润：74,328,711.58 元。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏扬现金通利货币市场基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 3,989,576.74                   | 403,722,223.86                   |
| 结算备付金           |            | -                              | 143,241.09                       |
| 存出保证金           |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 3,167,314,121.96               | 4,481,921,658.52                 |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 3,166,694,121.96               | 4,481,921,658.52                 |
| 资产支持证券投资        |            | 620,000.00                     | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 963,582,117.70                 | 1,017,660,271.47                 |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 30,494,644.24                  | 32,110,189.44                    |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 18,078,478.53                  | 38,500.00                        |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 4,183,458,939.17               | 5,935,596,084.38                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | 99,999,730.00                    |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                              | 799.10                           |
| 应付管理人报酬         |            | 1,002,934.76                   | 2,148,159.71                     |
| 应付托管费           |            | 300,880.40                     | 644,447.93                       |
| 应付销售服务费         |            | 41,957.26                      | 79,996.69                        |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 51,126.10                      | 96,237.56                        |
| 应交税费            |            | 122,382.41                     | 126,299.14                       |

|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利息          |          | -                | 63,523.95        |
| 应付利润          |          | 771,637.88       | 2,038,522.49     |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 119,705.46       | 219,000.90       |
| 负债合计          |          | 2,410,624.27     | 105,416,717.47   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 4,181,048,314.90 | 5,830,179,366.91 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | -                | -                |
| 所有者权益合计       |          | 4,181,048,314.90 | 5,830,179,366.91 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 4,183,458,939.17 | 5,935,596,084.38 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.00 元，基金份额总额 4,181,048,314.90 份，其中，鹏扬现金通利 A 类的基金份额净值人民币 1.00 元，份额总额 46,914,048.28 份；鹏扬现金通利 B 类的基金份额净值人民币 1.00 元，份额总额 4,134,134,266.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏扬现金通利货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 88,574,592.56                            | 87,241,104.62                                 |
| 1.利息收入                |            | 84,817,606.54                            | 86,973,758.26                                 |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 7,402,637.08                             | 5,741,656.44                                  |
| 债券利息收入                |            | 69,748,577.20                            | 53,365,628.58                                 |
| 资产支持证券利息收入            |            | 522,357.59                               | 702,911.71                                    |
| 买入返售金融资产收入            |            | 7,144,034.67                             | 27,163,561.53                                 |
| 其他利息收入                |            | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 3,756,986.02                             | 267,346.36                                    |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益                |            | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 3,756,986.02                             | 267,346.36                                    |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.3 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -                                        | -                                             |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | -                                        | -                                             |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -                                        | -                                             |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                        | -                                             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | -                                        | -                                             |

|                            |            |               |               |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 列)                         |            |               |               |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 13,659,850.46 | 10,826,316.37 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 8,494,972.75  | 5,320,407.79  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 2,548,491.77  | 1,596,122.30  |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 332,031.45    | 248,624.12    |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | -             | 50.00         |
| 5. 利息支出                    |            | 2,044,008.05  | 3,484,149.32  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 2,044,008.05  | 3,484,149.32  |
| 6. 税金及附加                   |            | 71,868.34     | 28,042.53     |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 168,478.10    | 148,920.31    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 74,914,742.10 | 76,414,788.25 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 74,914,742.10 | 76,414,788.25 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏扬现金通利货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |                |                    |
|----------------------------------------|---------------------------------------|----------------|--------------------|
|                                        | 实收基金                                  | 未分配利润          | 所有者权益合计            |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 5,830,179,366.91                      | -              | 5,830,179,366.91   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 74,914,742.10  | 74,914,742.10      |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -1,649,131,052.01                     | -              | -1,649,131,052.01  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 15,907,987,416.46                     | -              | 15,907,987,416.46  |
| 2. 基金赎回款                               | -17,557,118,468.47                    | -              | -17,557,118,468.47 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                     | -74,914,742.10 | -74,914,742.10     |

|                                        |                                            |                |                    |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|----------------|--------------------|
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 4,181,048,314.90                           | -              | 4,181,048,314.90   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |                |                    |
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计            |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 3,436,876,210.65                           | -              | 3,436,876,210.65   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                          | 76,414,788.25  | 76,414,788.25      |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | 1,570,581,014.04                           | -              | 1,570,581,014.04   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 13,061,761,437.49                          | -              | 13,061,761,437.49  |
| 2. 基金赎回款                               | -11,491,180,423.45                         | -              | -11,491,180,423.45 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                                          | -76,414,788.25 | -76,414,788.25     |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 5,007,457,224.69                           | -              | 5,007,457,224.69   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|            |           |           |
|------------|-----------|-----------|
| <u>杨爱斌</u> | <u>刘燕</u> | <u>韩欢</u> |
| 基金管理人负责人   | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人   |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏扬现金通利货币市场基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1208 号《关于准予鹏扬现金通利货币市场基金注册的批复》的注册，由鹏扬基金管理有限公司于 2017 年 7 月 24 日至 2017 年 8 月 4 日向社会公开募集，基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效，首次设立募集规模为 777,940,981.13 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为鹏扬基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金根据投资起点的不同，将基金份额分成 A 类和 B 类两类份额。其中 A 类基金份额按照

0.21%年费率计提销售服务费；B 类基金份额按照 0.01%年费率计提销售服务费。两类基金份额分别设置基金代码，并分别公布每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金；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；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；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。本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

注：无。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

注：无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

注：无。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017] 90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、

债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 3,989,576.74           |
| 定期存款           | —                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | —                      |
| 存款期限 1-3 个月    | —                      |
| 存款期限 3 个月以上    | —                      |
| 其他存款           | —                      |
| 合计：            | 3,989,576.74           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |                  |              |         |
|--------|-------|------------------------|------------------|--------------|---------|
|        |       | 摊余成本                   | 影子定价             | 偏离金额         | 偏离度     |
| 债券     | 交易所市场 | —                      | —                | —            | —       |
|        | 银行间市场 | 3,166,694,121.96       | 3,170,043,144.66 | 3,349,022.70 | 0.0801% |
|        | 合计    | 3,166,694,121.96       | 3,170,043,144.66 | 3,349,022.70 | 0.0801% |
| 资产支持证券 |       | 620,000.00             | 620,000.00       | —            | 0.0000% |
| 合计     |       | 3,167,314,121.96       | 3,170,663,144.66 | 3,349,022.70 | 0.0801% |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

|       | 账面余额           | 其中：买断式逆回购 |
|-------|----------------|-----------|
| 交易所市场 | 131,780,000.00 | -         |
| 银行间市场 | 831,802,117.70 | -         |
| 合计    | 963,582,117.70 | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 577.06                 |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | -                      |
| 应收债券利息     | 29,880,190.55          |
| 应收资产支持证券利息 | 209.95                 |
| 应收买入返售证券利息 | 613,666.68             |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 其他         | -                      |
| 合计         | 30,494,644.24          |

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                      |
| 银行间市场应付交易费用 | 51,126.10              |
| 合计          | 51,126.10              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                      |
| 应付赎回费       | —                      |
| 预提费用        | 119,705.46             |
| 合计          | 119,705.46             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 鹏扬通利货币 A      |                                       |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 49,780,477.40                         | 49,780,477.40   |
| 本期申购          | 170,750,308.66                        | 170,750,308.66  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -173,616,737.78                       | -173,616,737.78 |
| — 基金拆分/份额折算前  | —                                     | —               |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | —                                     | —               |
| 本期申购          | —                                     | —               |
| 本期赎回(以“-”号填列) | —                                     | —               |
| 本期末           | 46,914,048.28                         | 46,914,048.28   |

金额单位：人民币元

| 鹏扬通利货币 B      |                                       |                    |
|---------------|---------------------------------------|--------------------|
| 项目            | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |                    |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额               |
| 上年度末          | 5,780,398,889.51                      | 5,780,398,889.51   |
| 本期申购          | 15,737,237,107.80                     | 15,737,237,107.80  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -17,383,501,730.69                    | -17,383,501,730.69 |
| — 基金拆分/份额折算前  | —                                     | —                  |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | —                                     | —                  |
| 本期申购          | —                                     | —                  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | —                                     | —                  |
| 本期末           | 4,134,134,266.62                      | 4,134,134,266.62   |

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 鹏扬通利货币 A       |             |       |             |
|----------------|-------------|-------|-------------|
| 项目             | 已实现部分       | 未实现部分 | 未分配利润合计     |
| 上年度末           | -           | -     | -           |
| 本期利润           | 586,030.52  | -     | 586,030.52  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -           | -     | -           |
| 其中：基金申购款       | -           | -     | -           |
| 基金赎回款          | -           | -     | -           |
| 本期已分配利润        | -586,030.52 | -     | -586,030.52 |
| 本期末            | -           | -     | -           |

单位：人民币元

| 鹏扬通利货币 B       |                |       |                |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分 | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | -              | -     | -              |
| 本期利润           | 74,328,711.58  | -     | 74,328,711.58  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -              | -     | -              |
| 其中：基金申购款       | -              | -     | -              |
| 基金赎回款          | -              | -     | -              |
| 本期已分配利润        | -74,328,711.58 | -     | -74,328,711.58 |
| 本期末            | -              | -     | -              |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 14,519.99                             |
| 定期存款利息收入  | 7,388,110.66                          |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 6.43                                  |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 7,402,637.08                          |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

注：无。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 3,756,986.02               |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | —                          |
| 债券投资收益——申购差价收入                | —                          |
| 合计                            | 3,756,986.02               |

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 12,438,986,187.40          |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 12,369,481,231.90          |
| 减：应收利息总额                | 65,747,969.48              |
| 买卖债券差价收入                | 3,756,986.02               |

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额   | 99,917,818.29              |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 99,380,000.00              |
| 减：应收利息总额       | 537,818.29                 |
| 资产支持证券投资收益     | —                          |

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

#### 6.4.7.16 股利收益

注：无。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

注：无。

#### 6.4.7.18 其他收入

注：无。

#### 6.4.7.19 交易费用

注：无。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 54,547.97                             |
| 信息披露费 | 55,857.49                             |
| 账户维护费 | 18,900.00                             |
| 银行费用  | 39,172.64                             |
| 其他    | —                                     |
| 合计    | 168,478.10                            |

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易各关联方**

| 关联方名称                  | 与本基金的关系             |
|------------------------|---------------------|
| 杨爱斌                    | 基金管理人股东             |
| 鹏扬基金管理有限公司             | 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 基金托管人               |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

注：无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月<br>30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30<br>日 |
|-----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 8,494,972.75                             | 5,320,407.79                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 468,683.99                               | 329,958.32                                    |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月<br>30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30<br>日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,548,491.77                             | 1,596,122.30                                  |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.09% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.09\% / \text{当年天数}$

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

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日      |            |            |
|--------------------|--------------------------------------------|------------|------------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |            |            |
|                    | 鹏扬通利货币 A                                   | 鹏扬通利货币 B   | 合计         |
| 鹏扬基金管理有限公司         | 33,847.09                                  | 248,898.60 | 282,745.69 |
| 合计                 | 33,847.09                                  | 248,898.60 | 282,745.69 |
| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |            |            |
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |            |            |
|                    | 鹏扬通利货币 A                                   | 鹏扬通利货币 B   | 合计         |
| 鹏扬基金管理有限公司         | 21,894.09                                  | 155,616.51 | 177,510.60 |
| 合计                 | 21,894.09                                  | 155,616.51 | 177,510.60 |

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.21%，B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%。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：

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

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日的该类基金份额的基金资产净值

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |          |
|----|---------------------------------------|----------|
|    | 鹏扬通利货币 A                              | 鹏扬通利货币 B |

|                                 |   |               |
|---------------------------------|---|---------------|
| 基金合同生效日（2017 年 8 月 10 日）持有的基金份额 | - | -             |
| 报告期初持有的基金份额                     | - | 21,725,331.69 |
| 报告期间申购/买入总份额                    | - | 6,000,020.00  |
| 报告期间因拆分变动份额                     | - | -             |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | - | 18,000,020.00 |
| 报告期末持有的基金份额                     | - | 10,030,145.52 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | - | 0.24%         |

| 项目                              | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |               |
|---------------------------------|--------------------------------------------|---------------|
|                                 | 鹏扬通利货币 A                                   | 鹏扬通利货币 B      |
| 基金合同生效日（2017 年 8 月 10 日）持有的基金份额 | -                                          | -             |
| 报告期初持有的基金份额                     | -                                          | -             |
| 报告期间申购/买入总份额                    | -                                          | 30,000,000.00 |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -                                          | -             |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | -                                          | -             |
| 报告期末持有的基金份额                     | -                                          | 30,326,791.84 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | -                                          | 0.61%         |

注：1、本期末持有份额中的 304,813.83 份为红利发放份额。上年度可比期间期末持有的份额中 326,791.84 份为红利发放份额。

2、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

3、如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

4、对于分级基金，下属分级份额的比例的分母采用基金总份额。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

鹏扬通利货币 A

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|-------|------------------------|--------------------------|
|-------|------------------------|--------------------------|

|     | 持有的<br>基金份额 | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额 | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
|-----|-------------|--------------------------|-------------|--------------------------|
| 杨爱斌 | 10,647.37   | 0.00%                    | 10,518.08   | 0.00%                    |

注：以上关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。对于分级基金，下属分级份额的比例的分母采用基金总份额。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方<br>名称 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |          |
|-----------|---------------------------------------|-----------|--------------------------------------------|----------|
|           | 期末余额                                  | 当期利息收入    | 期末余额                                       | 当期利息收入   |
| 中国建设银行    | 3,989,576.74                          | 14,519.99 | 3,736,138.75                               | 9,319.41 |

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

##### 鹏扬通利货币A

| 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配<br>合计 | 备注 |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 594,457.01   | -                 | -8,426.49    | 586,030.52   | -  |

##### 鹏扬通利货币B

| 已按再投资形式转实收基金  | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动  | 本期利润分配<br>合计  | 备注 |
|---------------|-------------------|---------------|---------------|----|
| 75,587,169.70 | -                 | -1,258,458.12 | 74,328,711.58 | -  |

#### 6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人通过制定政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理思想融入公司整体组织架构的设计中，从而实现全方位、多角度风险管理，确保产品风险暴露不超越投资者的风险承受能力。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。基金经理、风险管理部、交易管理部、基金运营部以及监察稽核部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理。从投资决策制定层面，投资决策委员会、投资总监、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理。从投资决策执行层面，风险管理部、交易管理部与基金运营部对投资交易与交收的合规风险、操作风险等风险进行管理。从风险监控层面，公司督察长、风险管理人员及监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、风险管理委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告。

同时，本基金管理人采用科学的风险管理分析方法对组合面对的投资风险进行分析，主要通过定性分析和定量分析的方法，评估各种金融工具的风险及可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据基金资产所投资的不同金融工具的特征，制定相关风险量化指标及模型，并通过日常量化分析报告确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好

信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不超过该证券的 10%。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 0.00                   | 61,290,368.62            |
| A-1 以下 | 0.00                   | 0.00                     |
| 未评级    | 2,450,134,085.45       | 1,568,997,154.69         |
| 合计     | 2,450,134,085.45       | 1,630,287,523.31         |

注：（1）债券评级取自第三方评级机构（不含中债资信评估有限责任公司）的债项评级。

（2）未评级债券包含期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的地方政府债、短期融资券。

（3）债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 0.00                   | 0.00                     |
| A-1 以下 | 0.00                   | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                   | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                   | 0.00                     |

注：（1）资产支持证券评级取自第三方评级机构（不含中债资信评估有限责任公司）的债项评级。

（2）资产支持证券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
|--------|------------------------|--------------------------|

|        |                |                  |
|--------|----------------|------------------|
| A-1    | 0.00           | 0.00             |
| A-1 以下 | 0.00           | 0.00             |
| 未评级    | 746,440,227.06 | 2,880,297,862.32 |
| 合计     | 746,440,227.06 | 2,880,297,862.32 |

注：（1）同业存单评级取自第三方评级机构（不含中债资信评估有限责任公司）的债项评级。

（2）未评级同业存单为期限在一年以内的未有第三方评级机构债项评级的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 0.00                   | 0.00                     |
| AAA 以下 | 0.00                   | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                   | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                   | 0.00                     |

注：（1）债券评级取自第三方评级机构（不含中债资信评估有限责任公司）的债项评级。

（2）未评级债券为期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的地方政府债。

（3）债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 620,209.95             | 0.00                     |
| AAA 以下 | 0.00                   | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                   | 0.00                     |
| 合计     | 620,209.95             | 0.00                     |

注：（1）资产支持证券评级取自第三方评级机构（不含中债资信评估有限责任公司）的债项评级。

（2）资产支持证券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 0.00                   | 0.00                     |
| AAA 以下 | 0.00                   | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                   | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                   | 0.00                     |

注：（1）同业存单评级取自第三方评级机构（不含中债资信评估有限责任公司）的债项评级。

(2) 长期信用评级列示的同业存单投资为期限在一年以上的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金管理人通过限制投资集中度、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金、一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券（不包括可转换债券）、期限在一年以内（含一年）的债券回购、剩余期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、以及经中国证监会、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。无重大流动性风险。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金按资产的流动性特征，对资产类别做出以下划分：

1、短期高流动性资产，包括活期存款、结算备付金、交易保证金、国债、央票、政策性金融债，一个交易日内自然到期的其他债券、逆回购、银行存款、应收申购款、证券清算款等金融工具以及无条件可支取的银行存款。

2、短期可变现资产，主要包括短期高流动性资产，以及一个交易日以上、五个交易日以内自然到期的其他债券、逆回购和银行存款。

3、流动性风险资产，主要包括五个交易日以上自然到期的债券以及到期日在五个交易日以上、十个交易日以内的逆回购、银行存款（不含无条件支取的银行存款）。

4、流动性受限资产，是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流动性受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等。

本基金于本报告期末的短期高流动性资产占基金资产净值的比例为 27.41%，短期可变现资产

合计占基金资产净值的比例为 43.70%，流动性风险资产占基金资产净值的比例为 55.63%，流动受限资产占基金资产净值的比例为 0.01%。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本计量的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。

本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 1 个月以内           | 1-3 个月           | 3 个月-1 年       | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计               |
|------------------------|------------------|------------------|----------------|-------|-------|---------------|------------------|
| 资产                     |                  |                  |                |       |       |               |                  |
| 银行存款                   | 3,989,576.74     | -                | -              | -     | -     | -             | 3,989,576.74     |
| 交易性金融资产                | 470,697,405.38   | 2,286,265,132.06 | 410,351,584.52 | -     | -     | -             | 3,167,314,121.96 |
| 买入返售金融资产               | 963,582,117.70   | -                | -              | -     | -     | -             | 963,582,117.70   |
| 应收利息                   | -                | -                | -              | -     | -     | 30,494,644.24 | 30,494,644.24    |
| 应收申购款                  | -                | -                | -              | -     | -     | 18,078,478.53 | 18,078,478.53    |
| 其他资产                   | -                | -                | -              | -     | -     | -             | -                |
| 资产总计                   | 1,438,269,099.82 | 2,286,265,132.06 | 410,351,584.52 | -     | -     | 48,573,122.77 | 4,183,458,939.17 |
| 负债                     |                  |                  |                |       |       |               |                  |
| 应付管理人报酬                | -                | -                | -              | -     | -     | 1,002,934.76  | 1,002,934.76     |
| 应付托管费                  | -                | -                | -              | -     | -     | 300,880.40    | 300,880.40       |
| 应付销售服务费                | -                | -                | -              | -     | -     | 41,957.26     | 41,957.26        |
| 应付交易费用                 | -                | -                | -              | -     | -     | 51,126.10     | 51,126.10        |
| 应交税费                   | -                | -                | -              | -     | -     | 122,382.41    | 122,382.41       |
| 应付利润                   | -                | -                | -              | -     | -     | 771,637.88    | 771,637.88       |
| 其他负债                   | -                | -                | -              | -     | -     | 119,705.46    | 119,705.46       |
| 负债总计                   | -                | -                | -              | -     | -     | 2,410,624.27  | 2,410,624.27     |
| 利率敏感度缺口                | 1,438,269,099.82 | 2,286,265,132.06 | 410,351,584.52 | -     | -     | 46,162,498.50 | 4,181,048,314.90 |

| 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 | 1 个月以内           | 1-3 个月           | 3 个月-1 年         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计               |
|--------------------------|------------------|------------------|------------------|-------|-------|----------------|------------------|
| 资产                       |                  |                  |                  |       |       |                |                  |
| 银行存款                     | 3,722,223.86     | 200,000,000.00   | 200,000,000.00   | -     | -     | -              | 403,722,223.86   |
| 结算备付金                    | 143,241.09       | -                | -                | -     | -     | -              | 143,241.09       |
| 交易性金融资产                  | -                | 3,194,154,660.80 | 1,287,766,997.72 | -     | -     | -              | 4,481,921,658.52 |
| 买入返售金融资产                 | 1,017,660,271.47 | -                | -                | -     | -     | -              | 1,017,660,271.47 |
| 应收利息                     | -                | -                | -                | -     | -     | 32,110,189.44  | 32,110,189.44    |
| 应收申购款                    | -                | -                | -                | -     | -     | 38,500.00      | 38,500.00        |
| 其他资产                     | -                | -                | -                | -     | -     | -              | -                |
| 资产总计                     | 1,021,525,736.42 | 3,394,154,660.80 | 1,487,766,997.72 | -     | -     | 32,148,689.44  | 5,935,596,084.38 |
| 负债                       |                  |                  |                  |       |       |                |                  |
| 卖出回购金融资产款                | 99,999,730.00    | -                | -                | -     | -     | -              | 99,999,730.00    |
| 应付赎回款                    | -                | -                | -                | -     | -     | 799.10         | 799.10           |
| 应付管理人报酬                  | -                | -                | -                | -     | -     | 2,148,159.71   | 2,148,159.71     |
| 应付托管费                    | -                | -                | -                | -     | -     | 644,447.93     | 644,447.93       |
| 应付销售服务费                  | -                | -                | -                | -     | -     | 79,996.69      | 79,996.69        |
| 应付交易费用                   | -                | -                | -                | -     | -     | 96,237.56      | 96,237.56        |
| 应付利息                     | -                | -                | -                | -     | -     | 63,523.95      | 63,523.95        |
| 应交税费                     | -                | -                | -                | -     | -     | 126,299.14     | 126,299.14       |
| 应付利润                     | -                | -                | -                | -     | -     | 2,038,522.49   | 2,038,522.49     |
| 其他负债                     | -                | -                | -                | -     | -     | 219,000.90     | 219,000.90       |
| 负债总计                     | 99,999,730.00    | -                | -                | -     | -     | 5,416,987.47   | 105,416,717.47   |
| 利率敏感度缺口                  | 921,526,006.42   | 3,394,154,660.80 | 1,487,766,997.72 | -     | -     | -26,731,701.97 | 5,830,179,366.91 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产公允价值产生的影响。本基金于本报告期末在“影子定价”机制有效的前提下，若市场利率上升或下降 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产公允价值不会发生重大变动。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于具有良好流动性的货币市场工具，不投资股票、权证等其他交易性金融资产，因

此无重大其他市场价格风险。

#### **6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

注：无

#### **6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

注：无

#### **6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

注：无

### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

#### **6.4.14.1 公允价值**

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### **(1) 各层次金融工具公允价值**

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 3,167,314,121.96 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元。

##### **(2) 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在第一层次和第二层次之间无重大转换。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

#### **6.4.14.2 承诺事项**

无。

#### **6.4.14.3 其他事项**

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 固定收益投资            | 3,167,314,121.96 | 75.71         |
|    | 其中:债券             | 3,166,694,121.96 | 75.70         |
|    | 资产支持证券            | 620,000.00       | 0.01          |
| 2  | 买入返售金融资产          | 963,582,117.70   | 23.03         |
|    | 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      | 3,989,576.74     | 0.10          |
| 4  | 其他各项资产            | 48,573,122.77    | 1.16          |
| 5  | 合计                | 4,183,458,939.17 | 100.00        |

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 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 | 3.14           |                |
|    | 其中:买断式回购融资   | —              |                |
| 序号 | 项目           | 金额             | 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%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 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    | 50 |
| 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 | 50 |

## 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

### 7.3.2 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比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------------|--------------------|--------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 34.40              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 23.14              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60 天(含)—90 天           | 31.54              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 4  | 90 天(含)—120 天          | 3.35               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 5  | 120 天(含)—397 天(含)      | 6.47               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 合计 |                        | 98.90              | -                  |

### 7.4 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。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 摊余成本             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -             |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 840,701,625.11   | 20.11         |
|    | 其中：政策性金融债 | 840,701,625.11   | 20.11         |
| 4  | 企业债券      | -                | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | 1,579,552,269.79 | 37.78         |
| 6  | 中期票据      | -                | -             |
| 7  | 同业存单      | 746,440,227.06   | 17.85         |
| 8  | 其他        | -                | -             |

|    |                      |                  |       |
|----|----------------------|------------------|-------|
| 9  | 合计                   | 3,166,694,121.96 | 75.74 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                | -     |

## 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称           | 债券数量(张)   | 摊余成本           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 180209    | 18 国开 09       | 3,700,000 | 370,072,151.84 | 8.85         |
| 2  | 180410    | 18 农发 10       | 2,100,000 | 210,049,421.57 | 5.02         |
| 3  | 011900618 | 19 中电投 SCP009  | 2,000,000 | 200,100,669.72 | 4.79         |
| 4  | 011900573 | 19 华电股 SCP002  | 2,000,000 | 199,905,668.66 | 4.78         |
| 5  | 111810562 | 18 兴业银行 CD562  | 2,000,000 | 199,139,693.38 | 4.76         |
| 6  | 111907092 | 19 招商银行 CD092  | 2,000,000 | 198,852,001.69 | 4.76         |
| 7  | 011901380 | 19 大唐发电 SCP003 | 1,200,000 | 120,054,435.76 | 2.87         |
| 8  | 120235    | 12 国开 35       | 1,000,000 | 100,168,003.95 | 2.40         |
| 9  | 180312    | 18 进出 12       | 1,000,000 | 100,007,861.14 | 2.39         |
| 10 | 011900289 | 19 华电股 SCP001  | 1,000,000 | 100,005,253.54 | 2.39         |

## 7.7 “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 | -       |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.1734% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0187% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0791% |

### 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。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码    | 证券名称      | 数量(份)     | 公允价值       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|-----------|-----------|------------|--------------|
| 1  | 1989013 | 19 上和 1A1 | 1,000,000 | 620,000.00 | 0.01         |

注：本基金本报告期末仅持有以上资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 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。

### 7.9.2 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 招商银行 CD092（111907092.IB）为鹏扬现金通利货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 7 月 5 日深圳保监局针对招商银行存在电话销售欺骗投保人违法行为，罚款 30 万元。

本基金投资 19 招商银行 CD092 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 19 招商银行 CD092 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。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | —             |
| 2  | 应收证券清算款 | —             |
| 3  | 应收利息    | 30,494,644.24 |
| 4  | 应收申购款   | 18,078,478.53 |
| 5  | 其他应收款   | —             |
| 6  | 待摊费用    | —             |
| 7  | 其他      | —             |
| 8  | 合计      | 48,573,122.77 |

### 7.9.4 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级别            | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构            |            |                |            |
|---------------------|------------------|---------------|------------------|------------|----------------|------------|
|                     |                  |               | 机构投资者            |            | 个人投资者          |            |
|                     |                  |               | 持有份额             | 占总份额<br>比例 | 持有份额           | 占总份额<br>比例 |
| 鹏扬<br>通利<br>货币<br>A | 1,271            | 36,911.13     | 33,342,595.15    | 71.07%     | 13,571,453.13  | 28.93%     |
| 鹏扬<br>通利<br>货币<br>B | 67               | 61,703,496.52 | 3,978,174,432.30 | 96.23%     | 155,959,834.32 | 3.77%      |
| 合计                  | 1,338            | 3,124,849.26  | 4,011,517,027.45 | 95.95%     | 169,531,287.45 | 4.05%      |

注：对下属分级基金比例的分母采用各自级别的份额，对合计数比例的分母采用下属分级份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份）        | 占总份额比例 |
|----|-------|----------------|--------|
| 1  | 产品    | 510,332,533.41 | 12.21% |
| 2  | 机构    | 408,186,542.94 | 9.76%  |
| 3  | 机构    | 304,567,681.58 | 7.28%  |
| 4  | 产品    | 269,961,738.20 | 6.46%  |
| 5  | 产品    | 236,639,589.68 | 5.66%  |
| 6  | 产品    | 189,581,024.40 | 4.53%  |
| 7  | 机构    | 150,658,907.21 | 3.60%  |
| 8  | 产品    | 147,275,059.73 | 3.52%  |
| 9  | 产品    | 124,088,346.32 | 2.97%  |
| 10 | 产品    | 115,800,000.00 | 2.77%  |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|----|------|-----------|----------|
|----|------|-----------|----------|

|                  |          |            |         |
|------------------|----------|------------|---------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 鹏扬通利货币 A | 685,553.21 | 1.4613% |
|                  | 鹏扬通利货币 B | 0.00       | 0.0000% |
|                  | 合计       | 685,553.21 | 0.0164% |

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级份额的合计数（即期末基金份额总额）。

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 份额级别     | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 鹏扬通利货币 A | 0~10              |
|                                | 鹏扬通利货币 B | 0                 |
|                                | 合计       | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 鹏扬通利货币 A | 0~10              |
|                                | 鹏扬通利货币 B | 0                 |
|                                | 合计       | 0~10              |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                | 鹏扬通利货币 A       | 鹏扬通利货币 B          |
|--------------------------------|----------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2017 年 8 月 10 日）基金份额总额 | 7,843,008.52   | 770,097,972.61    |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 49,780,477.40  | 5,780,398,889.51  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 170,750,308.66 | 15,737,237,107.80 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 173,616,737.78 | 17,383,501,730.69 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -              | -                 |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 46,914,048.28  | 4,134,134,266.62  |

注：如有相应情况，总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人：

本基金管理人于 2019 年 3 月 27 日发布《鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告》，李操纲先生自 2019 年 3 月 25 日起不再担任鹏扬基金管理有限公司副总经理。本基金管理人已按有关规定报中国基金业协会和北京证监局备案上述重大人事变动事项。

#### 2、基金托管人托管部门：

本报告期内基金托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|            |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 中泰证券股份有限公司 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源证券有限公司 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、

定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

3、本基金本报告期无新增/撤销交易单元。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 债券交易 |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              |
|------------|------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|            | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中泰证券股份有限公司 | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 申万宏源证券有限公司 | -    | -            | 9,036,920,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内未存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

## 10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                             | 法定披露方式         | 法定披露日期          |
|----|----------------------------------|----------------|-----------------|
| 1  | 鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金销售机构名称变更的公告      | 中证报、公司网站       | 2019 年 1 月 4 日  |
| 2  | 鹏扬现金通利货币市场基金 2018 年第 4 季度报告      | 证监会网站、中证报、公司网站 | 2019 年 1 月 21 日 |
| 3  | 鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金合作销售机构名称变更的公告    | 证券时报、公司网站      | 2019 年 1 月 23 日 |
| 4  | 鹏扬基金管理有限公司关于增加基金销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站      | 2019 年 2 月 19 日 |
| 5  | 鹏扬基金管理有限公司关于增加基金销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站      | 2019 年 3 月 4 日  |
| 6  | 鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构           | 证券时报、公司网站      | 2019 年 3 月 19 日 |

|    |                                    |                 |                 |
|----|------------------------------------|-----------------|-----------------|
|    | 并参加费率优惠活动的公告                       |                 |                 |
| 7  | 鹏扬现金通利货币市场基金更新的招募说明书及其摘要           | 证券时报、公司网站       | 2019 年 3 月 20 日 |
| 8  | 鹏扬现金通利货币市场基金 2018 年度报告及摘要          | 证监会网站、证券时报、公司网站 | 2019 年 3 月 27 日 |
| 9  | 鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站       | 2019 年 3 月 29 日 |
| 10 | 鹏扬基金管理有限公司关于增加基金销售机构的公告            | 证券时报、公司网站       | 2019 年 4 月 3 日  |
| 11 | 鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构的公告          | 证券时报、公司网站       | 2019 年 4 月 17 日 |
| 12 | 鹏扬现金通利货币市场基金 2019 年第 1 季度报告        | 证监会网站、证券时报、公司网站 | 2019 年 4 月 18 日 |
| 13 | 鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金销售机构名称变更的公告        | 证券时报、公司网站       | 2019 年 5 月 8 日  |
| 14 | 鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站       | 2019 年 5 月 20 日 |
| 15 | 鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金的基金合作销售机构名称变更的公告   | 证券时报、公司网站       | 2019 年 5 月 22 日 |
| 16 | 鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站       | 2019 年 5 月 22 日 |
| 17 | 鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告               | 证监会网站、中证报、公司网站  | 2019 年 3 月 27 日 |
| 18 | 鹏扬基金管理有限公司关于公司注册资本及股权变更的公告         | 中证报、公司网站        | 2019 年 2 月 26 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

注：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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

|   |
|---|
| 无 |
|---|

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 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。

### 12.3 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

2019 年 8 月 23 日