

鹏扬现金通利货币市场基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 31 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。本中期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 2021 年 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
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	16
§ 5 托管人报告	16
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
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
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 债券回购融资情况	42

7.3 基金投资组合平均剩余期限	42
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	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	44
7.8 期末按摊余成本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	44
7.9 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	49
10.9 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 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	706,302,742.10 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	鹏扬通利货币 D	鹏扬通利货币 E
下属分级基金的交易代码	004983	004984	011754	010005
报告期末下属分级基金的份额总额	79,134,408.61 份	627,159,400.95 份	8,932.54 份	-

注：(1)本基金自 2021 年 3 月 12 日起增设 D 类份额，鹏扬通利货币 D 在 2021 年 3 月 12 日至 2021 年 6 月 27 日期间无份额。

(2)本基金自 2020 年 8 月 27 日起增设 E 类份额，鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

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	宋震
	联系电话	010-68105888
	电子邮箱	service@pyamc.com
		李申
		021-60637102
		lishen.zh@ccb.com

客户服务电话	400-968-6688	021-60637111
传真	010-68105966	021-60635778
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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.pyamc.com
基金中期报告备置地点	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	北京市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	鹏扬通利货币 D	鹏扬通利货币 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)	报告期(2021年3月12日-2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	683,107.30	8,224,613.15	3.54	-
本期利润	683,107.30	8,224,613.15	3.54	-
本期净值收益率	1.0424%	1.1425%	0.0152%	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)			
期末基金资产净值	79,134,408.61	627,159,400.95	8,932.54	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	-
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)			
累计净值收益率	10.9949%	11.8611%	0.0152%	-

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) 本基金自 2021 年 3 月 12 日起增设 D 类份额, 鹏扬通利货币 D 在 2021 年 3 月 12 日至 2021 年 6 月 27 日期间无份额。

(4) 鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏扬通利货币 A

阶段	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	0.1666%	0.0017%	0.1110%	0.0000%	0.0556%	0.0017%
过去三个月	0.4907%	0.0016%	0.3366%	0.0000%	0.1541%	0.0016%
过去六个月	1.0424%	0.0015%	0.6695%	0.0000%	0.3729%	0.0015%
过去一年	2.0548%	0.0014%	1.3481%	0.0000%	0.7067%	0.0014%
过去三年	7.0466%	0.0026%	4.0500%	0.0000%	2.9966%	0.0026%
自基金合同生效起至今	10.9949%	0.0031%	5.2521%	0.0000%	5.7428%	0.0031%

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	0.1830%	0.0017%	0.1110%	0.0000%	0.0720%	0.0017%
过去三个月	0.5407%	0.0016%	0.3366%	0.0000%	0.2041%	0.0016%
过去六个月	1.1425%	0.0015%	0.6695%	0.0000%	0.4730%	0.0015%
过去一年	2.2591%	0.0014%	1.3481%	0.0000%	0.9110%	0.0014%
过去三年	7.6910%	0.0026%	4.0500%	0.0000%	3.6410%	0.0026%
自基金合同生效起至今	11.8611%	0.0031%	5.2521%	0.0000%	6.6090%	0.0031%

鹏扬通利货币 D

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今	0.0152%	0.0009%	0.0111%	0.0000%	0.0041%	0.0009%

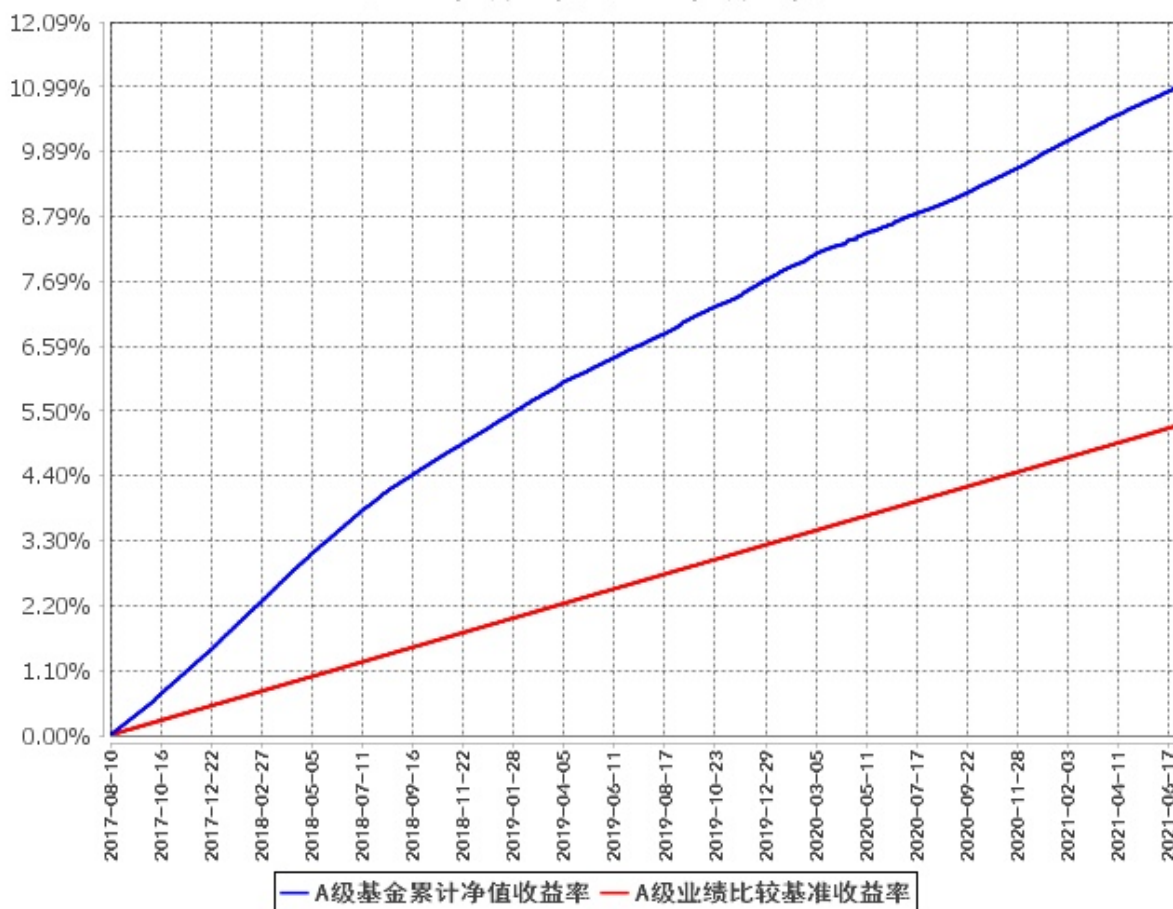
注：本基金自 2021 年 3 月 12 日起增设 D 类份额，鹏扬通利货币 D 在 2021 年 3 月 12 日至 2021 年 6 月 27 日期间无份额。

鹏扬通利货币 E

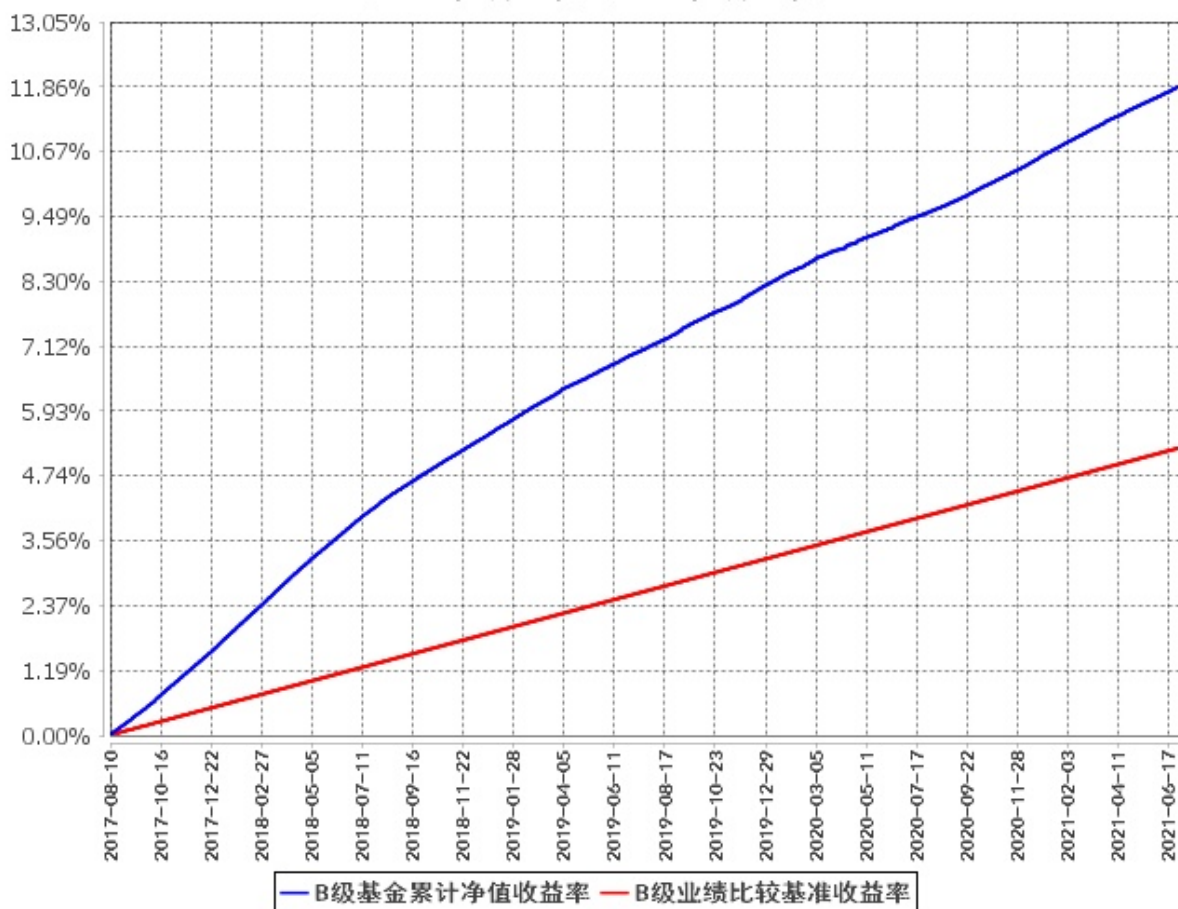
鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

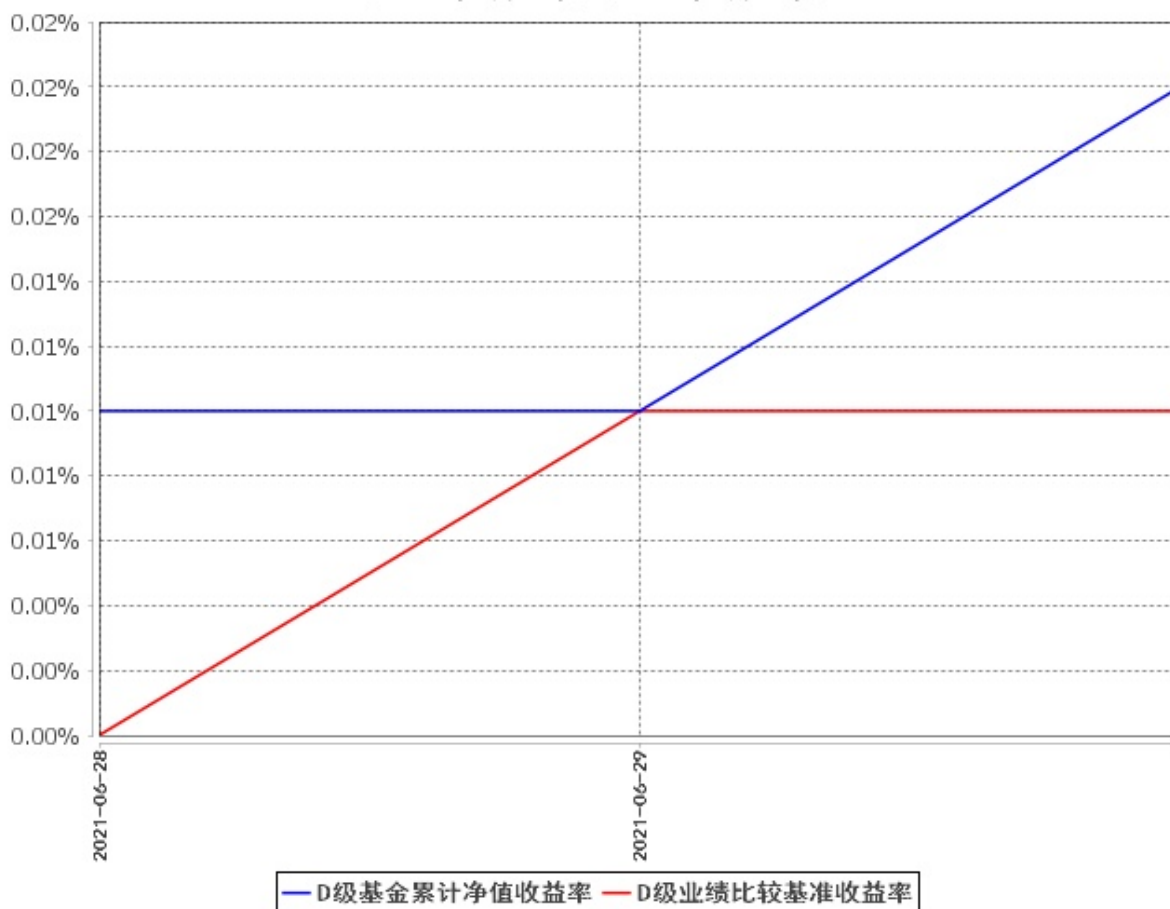
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年8月10日至2021年6月30日)



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
(2017年8月10日至2021年6月30日)



D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
(2021年6月28日至2021年6月30日)



注：(1)本基金自2021年3月12日起增设D类份额，鹏扬通利货币D在2021年3月12日至2021年6月27日期间无份额。

(2)鹏扬通利货币E增设至今无份额。

§ 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

鹏扬基金管理有限公司(以下简称“鹏扬基金”)成立于2016年7月6日,是经中国证监会批准成立的基金管理公司,注册地在上海,主要办公地在北京,在北京、上海、深圳设有分公司。

鹏扬基金的愿景是“成为资本市场上有影响力的、持续为客户创造价值的资产管理公司”。公司以“为客户创造价值,为美好生活助力”为使命,以“专业稳健,回报信任”为经营宗旨,秉持“客户至上、勇于担当、拥抱变化、合作共赢”的价值观,沿着“固定收益+”的发展规划路径并以此为特色,协同发展主动债券、主动股票、多资产、主动量化、指数增强五大核心策略。

鹏扬基金建立了行业领先的投研体系,不断强化投研能力,汇聚海内外优秀人才,核心投资人

员均具有 10 年以上优秀头部金融机构工作经历，为客户提供“全天候”的资产管理解决方案。同时，鹏扬基金注重风险管理，从文化上树立全员风险防范意识；从制度上实现风险管理在投前、投中、投后的全流程覆盖；从能力建设上持续提升宏观研究、信用研究、衍生品对冲的三大避险能力；从结果上检验风险管理成效，杜绝风险事件的发生。

凭借优秀的投资业绩和完善的全流程服务，鹏扬基金规模增长迅速。截至 2021 年 6 月 30 日，公司整体管理资产规模超过 1300 亿元，旗下公募基金数量增长到 45 只，非货币公募基金规模达 763 亿元，成立 1 年以上公募基金均实现了正收益。公司以追求绝对收益为突破点的“固收+”公募基金规模位居行业前列；根据海通证券研究所金融产品研究中心基金业绩评价报告，截至 2021 年 6 月 30 日，股票投资业务取得了投资业绩最近三年排名行业第 2 的优异成绩；指数投资业务在今年市场环境下也初露头角，实现了业绩和规模的快速提升。

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		
王莹莹	本基金基金经理, 现金管理部现金策略副总监	2018 年 8 月 24 日	-	5	英国埃克斯特大学硕士。曾任北京京粮置业有限公司财务部资金专员、北京鹏扬投资管理有限公司交易管理部债券交易员。鹏扬基金管理有限公司交易管理部债券交易员、专户投资部投资组合经理。现任鹏扬基金管理有限公司现金管理部现金策略副总监。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、鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金、鹏扬现金通利货币市场基金的基金经理；2019 年 11 月 13 日至 2021 年 3 月 18 日任鹏扬利洋短债债券型证券投资基金基金经理；2019 年 11 月 18 日至今任鹏扬淳开债券型证券投资基金基金经理；2020 年 3 月 16 日至今任鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2020 年 4 月 14

					日至今任鹏扬景科混合型证券投资基金基金经理；2021年1月25日至今任鹏扬淳明债券型证券投资基金基金经理；2021年3月18日至今任鹏扬淳合债券型证券投资基金基金经理；2021年6月16日至今任鹏扬景源一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1. 此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《鹏扬基金管理有限公司公平交易制度》，公平对待旗下管理的所有基金及其它组合。

本基金管理人通过统计检验的方法对本年度公司旗下管理的所有投资组合，在不同时间窗口下（1日内、3日内、5日内）同向交易的价差进行了专项分析，包括旗下各大类资产组合之间的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为0的T检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下组合存在违反公平交易的情况。

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

回顾 2021 年上半年，全球经济总体处于分步复苏阶段。中国和韩国受益于对疫情的有效防控，经济率先复苏。欧美等主要发达经济体随着疫苗接种提速，疫情明显缓解，并在积极财政政策和宽松货币政策的支持下，经济逐步复苏。拜登当选美国总统后，推出了第三轮财政刺激计划，并通过美联储的量化宽松政策配合实现财政赤字货币化，美国经济复苏进程明显加快。但印度等新兴市场国家疫苗接种进度缓慢，疫情出现反复，经济复苏进程相对落后。由于供给端受疫情影响恢复较慢，而需求端在政策刺激下恢复较快，全球通货膨胀短期压力明显上升。临近年中，随着主要经济体逐步进入扩张周期，部分国家开始逐步退出疫情期间的极度宽松政策，全球经济领先指标出现放缓回落信号。

2021 年上半年中国经济实现了 12.7% 的增长，其中 1 季度增长 18.3%，2 年复合增长率 5%；2 季度增长 7.9%，2 年复合增长率 5.5%。上半年中国经济总体仍处于扩张周期，但部分领先指标显示经济增长已出现放缓的迹象。从产出端来看，在出口和房地产投资的支持下，工业产出仍处于扩张周期，但 2 季度以来，受上游原材料价格大幅上涨和财政支出后置的影响，总需求增长出现小幅放缓迹象。通货膨胀方面，受猪肉价格大幅下跌和疫情影响，上半年居民消费价格(CPI)同比上涨 0.5%，涨幅处于比较低的水平。受供给不足和基数效应较低的影响，上半年大宗商品价格同比大幅上升；工业生产者出厂价格(PPI)3 月环比折年率达到 10.5%，6 月同比上涨高达 8.8%，1-6 月平均上涨 5.1%，通货膨胀上行风险有所扩大但总体可控。流动性方面，央行通过灵活适度的公开市场操作，逐步实现了货币政策的正常化，货币市场流动性先紧后松，总体保持中性略偏宽松局面。信用扩张方面，1-2 月社会融资总量增速仍超市场预期保持在较高水平，3 月起受票据短贷、企业债、政府债、非标的压缩影响，社会融资规模增速快速回落，对总需求扩张带来不利影响。

2021 年上半年债券市场先抑后扬，呈现牛市格局。1-2 月受全球“通货再膨胀”交易的影响，债券市场持续走低；3 月后在资金面重回宽松、专项债发行进度延迟和信用债券净发行减弱等多重利好因素支持下，债券市场持续走强，上半年中债综合全价指数上涨 0.65%。信用利差方面，受流动性和政策支持的影响，信用市场整体利差有所收窄，但信用市场继续分化，低评级信用债券流动性风险和利差扩大风险继续上升，但在资产荒背景下，部分经济发达区域的区县级城投债利率下行幅度较大，推动中低等级利差有所收窄。

操作方面，在上半年资产收益率与组合规模大幅波动的过程中，本基金始终保持在正偏离状态，B 类平均收益在全市场中位数附近，以防风险为主要任务。资金利率在 1 月末一度收紧，3 月后回归平稳宽松，组合自 1 月末 2 月初小幅提升久期至 40 天以上，后始终维持在 40 天附近，6 月基金规

模波动较大，至半年末，组合增加了逆回购占比以应对规模变化带来的流动性冲击，组合久期有所下降。

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 1.0424%，本报告期鹏扬通利货币 B 的基金份额净值收益率为 1.1425%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。本报告期(2021 年 6 月 28 日至 2021 年 6 月 30 日)鹏扬通利货币 D 的基金份额净值收益率为 0.0152%，同期业绩比较基准收益率为 0.0111%。鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，我们认为疫情防控、通货膨胀走势和宏观政策是影响下半年全球经济的三个关键因素。全球疫情虽然仍受到 Delta 变异毒株影响而出现反复，但主要发达经济体疫苗接种率较高，疫情重症率大幅下降，疫情反复对经济的负面影响大概率将逐步减弱。疫情期间，各国政府均实施大规模的需求扩张政策推动需求快速回升，但全球供给恢复明显慢于需求恢复的速度，由此导致全球通货膨胀水平快速上升，各国应对新冠疫情的宽松刺激政策将面临逐步退出的压力。考虑到当前全球贫富差距严重、债务杠杆高企、国际间合作互信大幅下降等深层次矛盾和问题仍未解决，全球经济复苏基础并不牢固，我们认为伴随各国刺激政策的逐步退出，全球经济将从扩张期转向放缓期。

在上述背景下，我们认为中国经济下半年也面临增长放缓的压力，但没有衰退风险。主要原因包括：1、上游原材料大幅涨价，不断挤压下游企业利润，下游企业理性的应对方式是推迟生产与投资，在一定程度上会导致经济出现短期放缓；2、伴随着“防范化解地方政府隐性债务风险”和“房住不炒”地产调控不断加码，由此导致的“信用收缩”和“财政后置”效应会对总需求扩张带来压力；3、领先指标 PMI 新出口订单连续 3 个月回落，与出口继续高增长形成明显背离，预计下半年由于海外供需缺口收窄，出口增长也面临回落压力。综合来看，预计 3 季度中国经济很可能面临内外需求同步走弱压力；4 季度，如果 10 月政治局会议政策方向由“供给侧结构性改革”和“防风险”重新转向“稳增长”，同时财政政策和货币政策转为积极，以对冲出口回落压力，则内需增长将重新回升。

通货膨胀方面，西方主要发达国家央行货币政策调控基本放弃传统的“先发制人”范式，转为目前“滞后于曲线”的范式，继续实施财政赤字货币化的政策组合，这将可能导致全球通货膨胀短期内超预期的风险。相对来说，中国货币政策最早实现正常化，信用扩张也明显放缓，积极的财政政策也从今年 2 季度开始逐步退出，尽管面临中上游大宗商品涨价向下游传递的风险，但在需求扩

张放缓的背景下，我们预计下半年中国通货膨胀风险总体可控。

流动性方面，目前市场普遍预期是全球经济恢复动能不足，全球央行政策退出只会滞后不会提前，市场对流动性保持充裕较为乐观。我们认为全球名义 GDP 快速回升的趋势不会改变，虽然货币政策退出预期较为缓慢，但边际上不可能进一步宽松、只会收紧，因此，全球宏观流动性收紧风险仍不可忽视。相对来说，7 月初中国央行超预期的全面降准，意味着中国货币政策方向可能从去年下半年的“边际收紧”转为正常化后的“边际放松”。从信用扩张来看，如果上半年延缓发行的地方政府专项债开始提速，同时配合高质量发展战略，加大对“双碳”“绿色金融”支持力度，信用收缩效应减弱，则 4 季度中国经济金融周期有望重新转为“宽货币”和“宽信贷”格局。

展望 2021 年下半年债券市场，我们认为机会与风险并存，收益率水平预计维持窄幅震荡。预计 3 季度在经济预期下行和信贷周期放缓的背景下，债券市场基本面及通胀的预期差将给市场带来一定的交易性机会，利率债券可灵活做多；4 季度应警惕出口增长超预期、通胀预期以及政策转向叠加的影响，主要的不确定性在供给节奏，年底若有意外冲击导致利率抬升，将会迎来较好的配置机会。信用债券方面，目前信用债利差偏低，下半年随着经济基本面压力有所加大，违约风险也会上升，尤其是对部分低资质城投债和杠杆率较高、受政策调控影响较大的房地产债券，我们仍需要保持谨慎。

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，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验。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

本基金收益分配方式为红利再投资，根据每日基金收益情况，以各类基金份额的每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。

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遵规守信情况声明

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遵规守信、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：683,107.30 元，向 B 级份额持有人分配利润：8,224,613.15 元，向 D 级份额持有人分配利润：3.54 元。

5.3 托管人对本中期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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	140,649,139.06	230,399,525.98
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	319,807,735.69	657,485,993.46

其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		319,807,735.69	657,485,993.46
资产支持证券投资		-	-
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	246,364,929.55	244,040,872.06
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,205,714.08	6,416,285.40
应收股利		-	-
应收申购款		70,271.00	2,037,810.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		708,097,789.38	1,140,380,487.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负债：			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,407,519.71	15,700.51
应付管理人报酬		139,601.44	324,460.31
应付托管费		41,363.40	97,338.13
应付销售服务费		17,599.37	23,530.62
应付交易费用	6.4.7.7	22,551.65	29,920.68
应交税费		3,544.38	12,772.47
应付利息		-	-
应付利润		46,951.09	82,318.56
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	115,916.24	224,300.00
负债合计		1,795,047.28	810,341.28
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	706,302,742.10	1,139,570,146.34
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		706,302,742.10	1,139,570,146.34
负债和所有者权益总计		708,097,789.38	1,140,380,487.62

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 706,302,742.10 份，其中鹏扬通利货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 79,134,408.61 份；鹏扬通利货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 627,159,400.95 份；鹏扬通利货币 D 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 8,932.54

份；鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		10,689,670.33	22,419,089.50
1. 利息收入		10,448,197.76	20,226,054.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,580,106.71	207,327.79
债券利息收入		6,856,603.84	14,932,045.20
资产支持证券利息收入		-	299,188.78
买入返售金融资产收入		2,011,487.21	4,787,492.58
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		241,472.57	2,193,035.15
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	241,472.57	1,868,628.87
资产支持证券投资	6.4.7.13.3	-	324,406.28
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	-	-
减：二、费用		1,781,946.34	3,783,554.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,115,096.84	2,616,689.20
2. 托管费	6.4.10.2.2	332,205.50	785,006.76
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	105,199.62	149,387.06
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-

5. 利息支出		69,723.93	45,782.38
其中：卖出回购金融资产支出		69,723.93	45,782.38
6. 税金及附加		4,332.05	27,395.74
7. 其他费用	6.4.7.20	155,388.40	159,293.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,907,723.99	18,635,535.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,907,723.99	18,635,535.05

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	1,139,570,146.34	-	1,139,570,146.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,907,723.99	8,907,723.99
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）	-433,267,404.24	-	-433,267,404.24
其中：1. 基金申购款	2,329,847,959.45	-	2,329,847,959.45
2. 基金赎回款	-2,763,115,363.69	-	-2,763,115,363.69
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）	-	-8,907,723.99	-8,907,723.99
五、期末所有者权益（基金净值）	706,302,742.10	-	706,302,742.10
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	3,076,290,835.22	-	3,076,290,835.22

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,635,535.05	18,635,535.05
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）	-1,101,045,505.00	-	-1,101,045,505.00
其中：1. 基金申购款	3,388,985,436.32	-	3,388,985,436.32
2. 基金赎回款	-4,490,030,941.32	-	-4,490,030,941.32
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）	-	-18,635,535.05	-18,635,535.05
五、期末所有者权益（基金净值）	1,975,245,330.22	-	1,975,245,330.22

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：

杨爱斌	崔雁巍	韩欢
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》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,首次募集的有效净认购金额为人民币777,841,192.56元,有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币99,788.57元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2017)验字第61290365_A07号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,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,其中认购资金利息折合99,788.57份基金份额,本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及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。根据基金管理人2020年8月26日发布的《关于鹏扬现金通利货币市场基金增设E类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》,本基金自2020年8月27日起增加E类基金份额类别。根据基金管理人2021年3月12日发布的《关于鹏扬现金通利货币市场基金修

改相关法律文件的公告》，本基金自 2021 年 3 月 12 日起调低管理费率 and 托管费率，并增加 D 类基金份额类别。

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。

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》、《公开募集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<年度和中期报告>》及其他中国证监会、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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

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。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	649,139.06
定期存款	140,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	60,000,000.00
存款期限 3 个月以上	80,000,000.00
其他存款	-
合计	140,649,139.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021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	319,807,735.69	319,873,000.00	65,264.31	0.0092%
	合计	319,807,735.69	319,873,000.00	65,264.31	0.0092%
资产支持证券		-	-	-	-
合计		319,807,735.69	319,873,000.00	65,264.31	0.0092%

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	246,364,929.55	-
合计	246,364,929.55	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	52.68
应收定期存款利息	676,531.13
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	444,953.43
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	84,176.84

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	1,205,714.08

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	22,551.65
合计	22,551.65

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	115,916.24
合计	115,916.24

6.4.7.9 实收基金

单位：人民币元

鹏扬通利货币 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	64,846,362.18	64,846,362.18
本期申购	227,858,616.05	227,858,616.05
本期赎回(以“-”号填列)	-213,570,569.62	-213,570,569.62
本期末	79,134,408.61	79,134,408.61

单位：人民币元

鹏扬通利货币 B		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,074,723,784.16	1,074,723,784.16
本期申购	2,101,820,066.07	2,101,820,066.07
本期赎回(以“-”号填列)	-2,549,384,449.28	-2,549,384,449.28
本期末	627,159,400.95	627,159,400.95

单位：人民币元

鹏扬通利货币 D		
项目	本期 2021 年 3 月 12 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	169,277.33	169,277.33
本期赎回(以“-”号填列)	-160,344.79	-160,344.79
本期末	8,932.54	8,932.54

注：(1)总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

(2)本基金自 2021 年 3 月 12 日起增设 D 类份额，鹏扬通利货币 D 在 2021 年 3 月 12 日至 2021 年 6 月 27 日期间无份额。

(3)鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

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	683,107.30	-	683,107.30
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	-683,107.30	-	-683,107.30
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	8,224,613.15	-	8,224,613.15
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	-8,224,613.15	-	-8,224,613.15
本期末	-	-	-

单位：人民币元

鹏扬通利货币 D			
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	3.54	-	3.54
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	-3.54	-	-3.54
本期末	-	-	-

注：鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,863.90
定期存款利息收入	1,578,242.81
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,580,106.71

6.4.7.12 股票投资收益

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 2021 年 1 月 1 日
----	----------------------

	至 2021 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	241,472.57
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	241,472.57

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
	2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,773,528,905.01
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,758,722,614.90
减：应收利息总额	14,564,817.54
买卖债券差价收入	241,472.57

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

无。

6.4.7.18 其他收入

无。

6.4.7.19 交易费用

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	47,108.87
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行汇划费	30,172.16
合计	155,388.40

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

截至财务报表批准日，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

本基金本报告期不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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏扬基金管理有限公司（“鹏扬基金”）	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（“建设银行”）	基金托管人
杨爱斌	基金管理人股东

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

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 2021 年 1 月 1 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日
----	----------------------	---------------------------

	至 2021 年 6 月 30 日	至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,115,096.84	2,616,689.20
其中：支付销售机构的客户维护费	44,840.63	82,015.96

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 0.27% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% / \text{当年天数}$$

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 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	332,205.50	785,006.76

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 0.08% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% / \text{当年天数}$$

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

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	鹏扬通利货币 D	鹏扬通利货币 E	合计
鹏扬基金	49,283.72	32,083.22	0.40	-	81,367.34
合计	49,283.72	32,083.22	0.40	-	81,367.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	鹏扬通利货币 D	鹏扬通利货币 E	合计
鹏扬基金	38,001.53	79,452.41	-	-	117,453.94
合计	38,001.53	79,452.41	-	-	117,453.94

注：(1) 基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。

本基金 A 类基金份额的销售服务费按前一日 A 类基金份额资产净值的 0.21% 年费率计提, B 类基金份额的销售服务费按前一日 B 类基金份额资产净值的 0.01% 年费率计提, D 类基金份额的销售服务费按前一日 D 类基金份额资产净值的 0.25% 年费率计提, E 类基金份额的销售服务费按前一日 E 类基金份额资产净值的 0.21% 年费率计提。计算方法如下:

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

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

(2) 本基金自 2021 年 3 月 12 日起增设 D 类份额, 鹏扬通利货币 D 在 2021 年 3 月 12 日至 2021 年 6 月 27 日期间无份额。

(3) 鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日			
	鹏扬通利货币 A	鹏扬通利货币 B	鹏扬通利货币 D	鹏扬通利货币 E
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	50,547.76	72,041,632.65	-	-
报告期间申购/买入总份额	445.47	146,335,469.86	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	50,993.23	208,334,101.31	-	-
报告期末持有的基金份额	-	10,043,001.20	-	-

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.42%	-	-
---------------------	---	-------	---	---

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日			
	鹏扬通利货币 A	鹏扬通利货币 B	鹏扬通利货币 D	鹏扬通利货币 E
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	-	10,079,929.23	-	-
报告期间申购/买入总份额	80,449.89	20,201,663.39	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	30,402.88	2,496.08	-	-
报告期末持有的基金份额	50,047.01	30,279,096.54	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	1.53%	-	-

注：1、基金管理人投资本基金的相关费用符合基金招募说明书及相关临时公告、交易所、登记结算机构的有关规定。

2、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。

6.4.10.5.2 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

份额单位：份

鹏扬通利货币 A				
关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
杨爱斌	11,088.56	0.00%	-	-

份额单位：份

鹏扬通利货币 B				
关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
杨爱斌	-	-	5,033,462.77	0.44%

注：1、以上关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书及相关临时公告、交易所、登记结算机构的有关规定。

2、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。

6.4.10.6 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

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日 至 2020 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
建设银行	649,139.06	1,863.90	600,716.89	9,158.36

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
682,619.23	-	488.07	683,107.30	-

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 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
8,260,469.16	-	-35,856.01	8,224,613.15	-

鹏扬通利货币 D

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
3.07	-	0.47	3.54	-

注：(1)本基金自 2021 年 3 月 12 日起增设 D 类份额，鹏扬通利货币 D 在 2021 年 3 月 12 日至 2021 年 6 月 27 日期间无份额。

(2)鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

6.4.12 期末（2021 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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之内。

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0.00	70,261,972.36
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	120,492,061.32	274,020,408.72
合计	120,492,061.32	344,282,381.08

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

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

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	上年度末
--------	-----	------

	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	199,760,627.80	297,860,358.18
合计	199,760,627.80	297,860,358.18

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	0.00	20,534,994.16
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	20,534,994.16

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、中期票据。

(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

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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

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

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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 2021 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	60,649,139.06	30,000,000.00	50,000,000.00	-	-	-	140,649,139.06
交易性金融资产	279,739,320.28	40,068,415.41	-	-	-	-	319,807,735.69
买入返售金融资产	246,364,929.55	-	-	-	-	-	246,364,929.55
应收利息	-	-	-	-	-	-1,205,714.08	1,205,714.08
应收申购款	-	-	-	-	-	70,271.00	70,271.00
资产总计	586,753,388.89	70,068,415.41	50,000,000.00	-	-	-1,275,985.08	708,097,789.38
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-1,407,519.71	1,407,519.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	139,601.44	139,601.44
应付托管费	-	-	-	-	-	41,363.40	41,363.40
应付	-	-	-	-	-	17,599.37	17,599.37

销售服务费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	22,551.65	22,551.65
应交税费	-	-	-	-	-	3,544.38	3,544.38
应付利润	-	-	-	-	-	46,951.09	46,951.09
其他负债	-	-	-	-	-	115,916.24	115,916.24
负债总计	-	-	-	-	-	1,795,047.28	1,795,047.28
利率敏感度缺口	586,753,388.89	70,068,415.41	50,000,000.00	-	-	-519,062.20	706,302,742.10
上年度末2020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	90,399,525.98	140,000,000.00	-	-	-	-	230,399,525.98
交易性金融资产	179,932,562.40	398,327,240.75	79,226,190.31	-	-	-	657,485,993.46
买入返售金融资产	244,040,872.06	-	-	-	-	-	244,040,872.06
应收利息	-	-	-	-	-	6,416,285.40	6,416,285.40
应收申购款	-	-	-	-	-	2,037,810.72	2,037,810.72
资产总计	514,372,960.44	538,327,240.75	79,226,190.31	-	-	8,454,096.12	1,140,380,487.62
负债							
应付	-	-	-	-	-	15,700.51	15,700.51

赎回款							
应付管理人报酬						324,460.31	324,460.31
应付托管费						97,338.13	97,338.13
应付销售服务费						23,530.62	23,530.62
应付交易费用						29,920.68	29,920.68
应交税费						12,772.47	12,772.47
应付利润						82,318.56	82,318.56
其他负债						224,300.00	224,300.00
负债总计						810,341.28	810,341.28
利率敏感度缺口	514,372,960.44	538,327,240.75	79,226,190.31			-7,643,754.84	1,139,570,146.34

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了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

无。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

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

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金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 319,807,735.69 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元(上年度末：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 657,485,993.46 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元)。

6.4.14.1.2.2 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的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

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	319,807,735.69	45.16
	其中：债券	319,807,735.69	45.16
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	246,364,929.55	34.79
	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	140,649,139.06	19.86
4	其他各项资产	1,275,985.08	0.18
5	合计	708,097,789.38	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		0.82
	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个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

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	22
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	56
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	22

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。

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的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	83.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	7.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	2.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	7.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		100.07	-

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

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	49,970,723.99	7.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,076,383.90	9.92
6	中期票据	-	-
7	同业存单	199,760,627.80	28.28
8	其他	-	-
9	合计	319,807,735.69	45.28
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名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	112004028	20 中国银行 CD028	500,000	49,980,998.88	7.08
2	112116045	21 上海银行 CD045	500,000	49,976,409.51	7.08
3	219901	21 贴现国债 01	500,000	49,970,723.99	7.07
4	112106123	21 交通银行 CD123	500,000	49,926,421.08	7.07
5	112012082	20 北京银行 CD082	500,000	49,876,798.33	7.06
6	012101273	21 光大集团 SCP010	200,000	20,035,431.08	2.84
7	012100988	21 中化股 SCP011	200,000	20,032,984.33	2.84
8	012100873	21 沪电力 SCP004	200,000	20,007,414.30	2.83
9	012101263	21 中化股 SCP012	100,000	10,000,554.19	1.42
10	-	-	-	-	-

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0965%
报告期内偏离度的最低值	-0.0063%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0422%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按摊余成本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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

报告期内基金投资的前十名证券除 21 上海银行 CD045(112116045), 20 北京银行 CD082(112012082), 20 中国银行 CD028(112004028)外其他证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。上海银保监局 2020 年 08 月 14 日对上海银行股份有限公司进行处罚(沪银保监银罚决字(2020)14 号), 上海银保监局 2020 年 11 月 18 日对上海银行股份有限公司进行处罚(沪银保监银罚决字(2020)25 号), 上海银保监局 2021 年 04 月 25 日对上海银行股份有限公司进行处罚(沪银保监罚决字(2021)31 号), 中国银行间市场交易商协会 2020 年第 8 次自律处分会议审议决定对北京银行股份有限公司进行处罚, 北京银保监局 2020 年 12 月 23 日对北京银行股份有限公司进行处罚(京银保监罚决字(2020)41 号), 北京银保监局 2020 年 12 月 30 日对北京银行股份有限公司进行处罚(京银保监罚决字(2020)45 号), 人行营管部 2021 年 02 月 05 日对北京银行股份有限公司进行处罚(银管罚(2021)4 号), 北京银保监局 2020 年 07 月 11 日对北京银行股份有限公司进行处罚(京银保监罚决字(2020)23 号), 银保监会 2020 年 12 月 01 日对中国银行股份有限公司进行处罚(银保监罚决字(2020)60 号), 银保监会 2021 年 05 月 17 日对中国银行股份有限公司进行处罚(银保监罚决字(2021)11 号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作, 上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

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	1,205,714.08
4	应收申购款	70,271.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,275,985.08

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因, 各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 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 比例	持有份额	占总份 额比例
鹏扬通利 货币 A	2,592	30,530.25	40,411,908.45	51.07%	38,722,500.16	48.93%
鹏扬通利 货币 B	21	29,864,733.38	618,152,982.09	98.56%	9,006,418.86	1.44%
鹏扬通利 货币 D	25	357.30	-	-	8,932.54	100.00%
鹏扬通利 货币 E	-	-	-	-	-	-
合计	2,638	267,741.75	658,564,890.54	93.24%	47,737,851.56	6.76%

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	银行类机构	100,528,594.93	14.23%
2	券商类机构	100,005,546.42	14.16%
2	保险类机构	100,005,546.42	14.16%
4	保险类机构	51,269,882.51	7.26%
5	保险类机构	50,002,773.21	7.08%
6	基金类机构	40,048,203.40	5.67%
7	券商类机构	30,702,395.78	4.35%
8	券商类机构	20,024,007.39	2.84%
9	基金类机构	19,533,521.30	2.77%
10	基金类机构	14,950,000.00	2.12%

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	7,262,659.35	9.1776%
	鹏扬通利货币 B	-	-
	鹏扬通利货币 D	440.06	4.9265%
	鹏扬通利货币 E	-	-
	合计	7,263,099.41	1.0283%

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
	鹏扬通利货币 D	0
	鹏扬通利货币 E	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
	鹏扬通利货币 D	0
	鹏扬通利货币 E	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏扬通利货币 A	鹏扬通利货币 B	鹏扬通利货币 D	鹏扬通利货币 E
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	64,846,362.18	1,074,723,784.16	-	-
本报告期基金总申购份额	227,858,616.05	2,101,820,066.07	169,277.33	-
减：本报告期基金总赎回份额	213,570,569.62	2,549,384,449.28	160,344.79	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-	-
本报告期末基金份额总额	79,134,408.61	627,159,400.95	8,932.54	-

注：(1)总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

(2)本基金自 2021 年 3 月 12 日起增设 D 类份额，鹏扬通利货币 D 在 2021 年 3 月 12 日至 2021 年 6 月 27 日期间无份额。

(3)鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

§ 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：

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人托管部门：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内本基金所聘用的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	
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
西部证券	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等。

(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。经公司批准后被选择的证券经营机构签订协议。

(3) 在上述租用的券商交易单元中，西部证券的交易单元为本基金本报告期内新增的交易单元。

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
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

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部分开放式基金在上海浦东发展银行股份有限公司开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 1 月 4 日
2	鹏扬现金通利货币市场基金 2020 年第 4 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 1 月 22 日
3	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 1 月 28 日
4	关于调整鹏扬现金通利货币市场基金在直销渠道大额申购(含大额转换转入)业务的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 2 月 5 日
5	关于调整鹏扬现金通利货币市场基金在代销渠道大额申购(含大额转换转入)业务的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 2 月 5 日
6	鹏扬基金管理有限公司关于旗下开放式基金在珠海盈米基金销售有限公司开展转换费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 1 日

7	关于鹏扬现金通利货币市场基金修改相关法律文件的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 12 日
8	鹏扬现金通利货币市场基金(鹏扬通利货币 E 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 12 日
9	鹏扬现金通利货币市场基金(鹏扬通利货币 D 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 12 日
10	鹏扬现金通利货币市场基金(鹏扬通利货币 B 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 12 日
11	鹏扬现金通利货币市场基金托管协议	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 12 日
12	鹏扬现金通利货币市场基金基金合同	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 12 日
13	鹏扬现金通利货币市场基金更新的招募说明书(2021 年第 1 号)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 12 日
14	鹏扬现金通利货币市场基金(鹏扬通利货币 A 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 12 日
15	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 25 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	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 29 日
17	鹏扬现金通利货币市场基金 2020 年年度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 30 日
18	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	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 4 月 6 日
19	鹏扬基金管理有限公司关于暂停直销电子交易平台货币基金快速赎回业务的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 4 月 9 日
20	鹏扬现金通利货币市场基金 2021 年第一季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 4 月 22 日
21	关于暂停及恢复鹏扬现金通利货币市场基金大额申购(含转换转入、定期定额投资)业务的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 4 月 28 日
22	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	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 5 月 17 日
23	鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金在直销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 5 月 25 日
24	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	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 6 月 3 日

25	关于暂停及恢复鹏扬现金通利货币市场基金在直销渠道大额申购(含大额转换转入、定期定额投资)业务的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021年6月9日
26	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021年6月17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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021年6月28日-2021年6月28日	-	200,953,004.22	100,424,409.29	100,528,594.93	14.23%
	2	2021年4月23日-2021年6月2日	-	245,734,337.13	245,711,338.94	22,998.19	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回,有效防控产品流动性风险,在运作中保持合适的流动性水平,保护持有人利益。

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

2021 年 8 月 31 日