

# 鹏扬现金通利货币市场基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 3 月 29 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 2022 年 3 月 25 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	15
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>16</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
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	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	23
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	24
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	25
4.9 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	25
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>25</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	25
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	25
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	25
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>26</b>
6.1 审计报告基本信息	26
6.2 审计报告的基本内容	26
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>27</b>
7.1 资产负债表	27
7.2 利润表	29

7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	30
7.4 报表附注 .....	31
<b>§ 8 投资组合报告 .....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	56
8.2 债券回购融资情况 .....	56
8.3 基金投资组合平均剩余期限 .....	56
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	57
8.6 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 .....	58
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	58
8.8 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 .....	58
8.9 投资组合报告附注 .....	59
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
9.4 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 .....	61
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
11.2 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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	63
11.9 其他重大事件 .....	63
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</b>
12.1 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 .....	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
13.1 备查文件目录 .....	67
13.2 存放地点 .....	67

13.3 查阅方式 ..... 67

## § 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	1,058,342,486.49 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	64,228,852.65 份	993,989,854.70 份	123,779.14 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	李申
	联系电话	010-68105888	021-60637102
	电子邮箱	service@pyamc.com	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.pyamc.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年				2020 年				2019 年			
	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	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	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
本期已实现收益	1,308,179.10	14,767,343.5	3,222.89	-	1,415,253.16	31,912,513.61	-	-	1,365,158.75	108,413,130.50	-	-

本期利润	1,308,179.10	14,767,734.35	3,222.89	-	1,415,253.16	31,912,513.61	-	-	1,365,158.75	108,413,130.50	-	-
本期净值收益率	1.9998%	2.2041%	0.9421%	-	1.9741%	2.1784%	-	-	2.3497%	2.5545%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末				2020 年末				2019 年末			
期末基金资产净值	64,228,852.65	993,989,854.70	123,779.14	-	64,846,362.18	1,074,723,784.16	-	-	71,746,955	3,004,543,888.67	-	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	-	1.0000	1.0000	-	-	1.0000	1.0000	-	-
3.1.3 累计期末指标	2021 年末				2020 年末				2019 年末			
累计净值收益率	12.0467%	13.0352%	0.9421%	-	9.8499%	10.5975%	-	-	7.7233%	8.2396%	-	-

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
过去三个月	0.4805%	0.0020%	0.3403%	0.0000%	0.1402%	0.0020%
过去六个月	0.9476%	0.0017%	0.6805%	0.0000%	0.2671%	0.0017%
过去一年	1.9998%	0.0016%	1.3500%	0.0000%	0.6498%	0.0016%
过去三年	6.4574%	0.0025%	4.0500%	0.0000%	2.4074%	0.0025%
自基金合同生效起至今	12.0467%	0.0031%	5.9326%	0.0000%	6.1141%	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
过去三个月	0.5312%	0.0020%	0.3403%	0.0000%	0.1909%	0.0020%
过去六个月	1.0496%	0.0017%	0.6805%	0.0000%	0.3691%	0.0017%
过去一年	2.2041%	0.0016%	1.3500%	0.0000%	0.8541%	0.0016%
过去三年	7.0983%	0.0025%	4.0500%	0.0000%	3.0483%	0.0025%
自基金合同生效起至今	13.0352%	0.0031%	5.9326%	0.0000%	7.1026%	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
过去三个月	0.4698%	0.0020%	0.3403%	0.0000%	0.1295%	0.0020%
过去六个月	0.9267%	0.0017%	0.6805%	0.0000%	0.2462%	0.0017%
自基金合同生效起至今	0.9421%	0.0017%	0.6916%	0.0000%	0.2505%	0.0017%

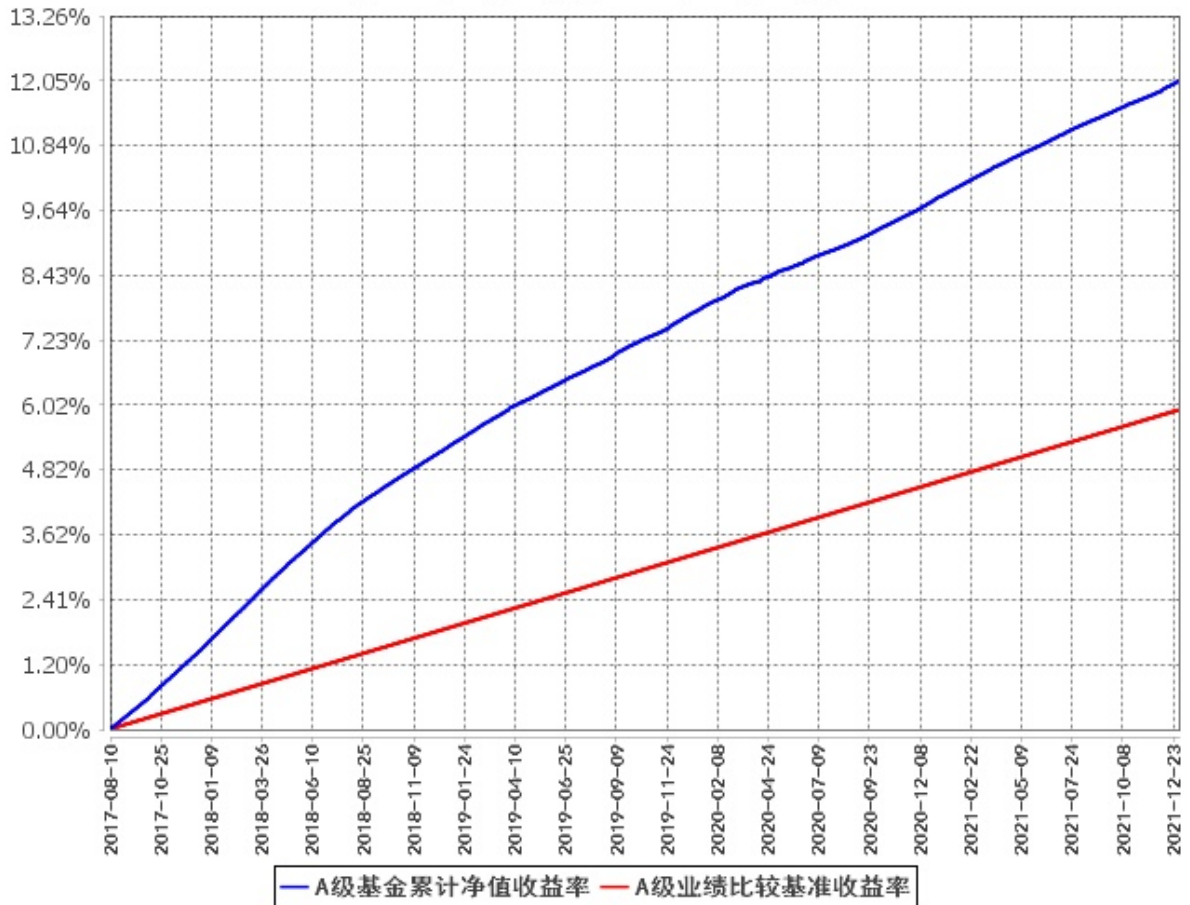
注：本基金自 2021 年 3 月 12 日起增设 D 类份额，鹏扬通利货币 D 在 2021 年 3 月 12 日至 2021 年 6 月 27 日期间无份额。

鹏扬通利货币 E

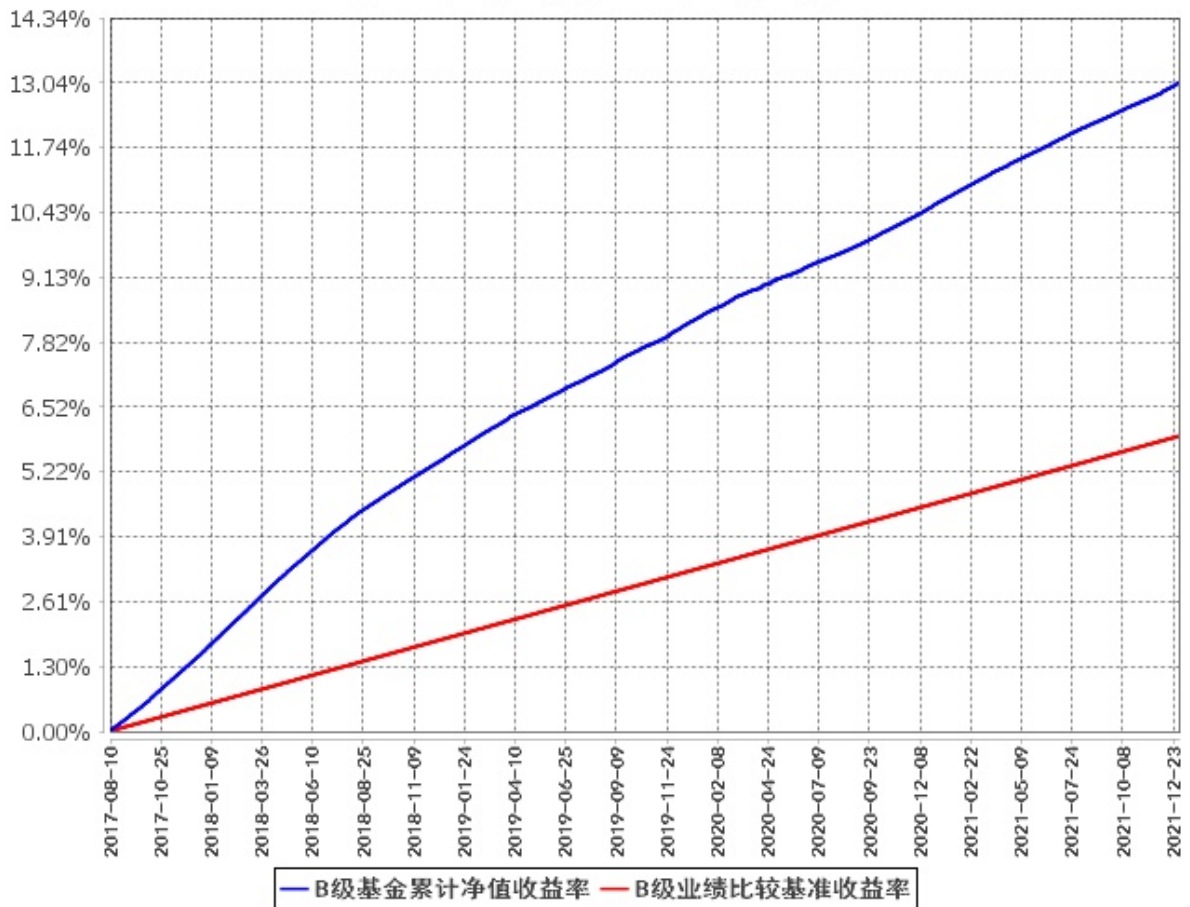
鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

### 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

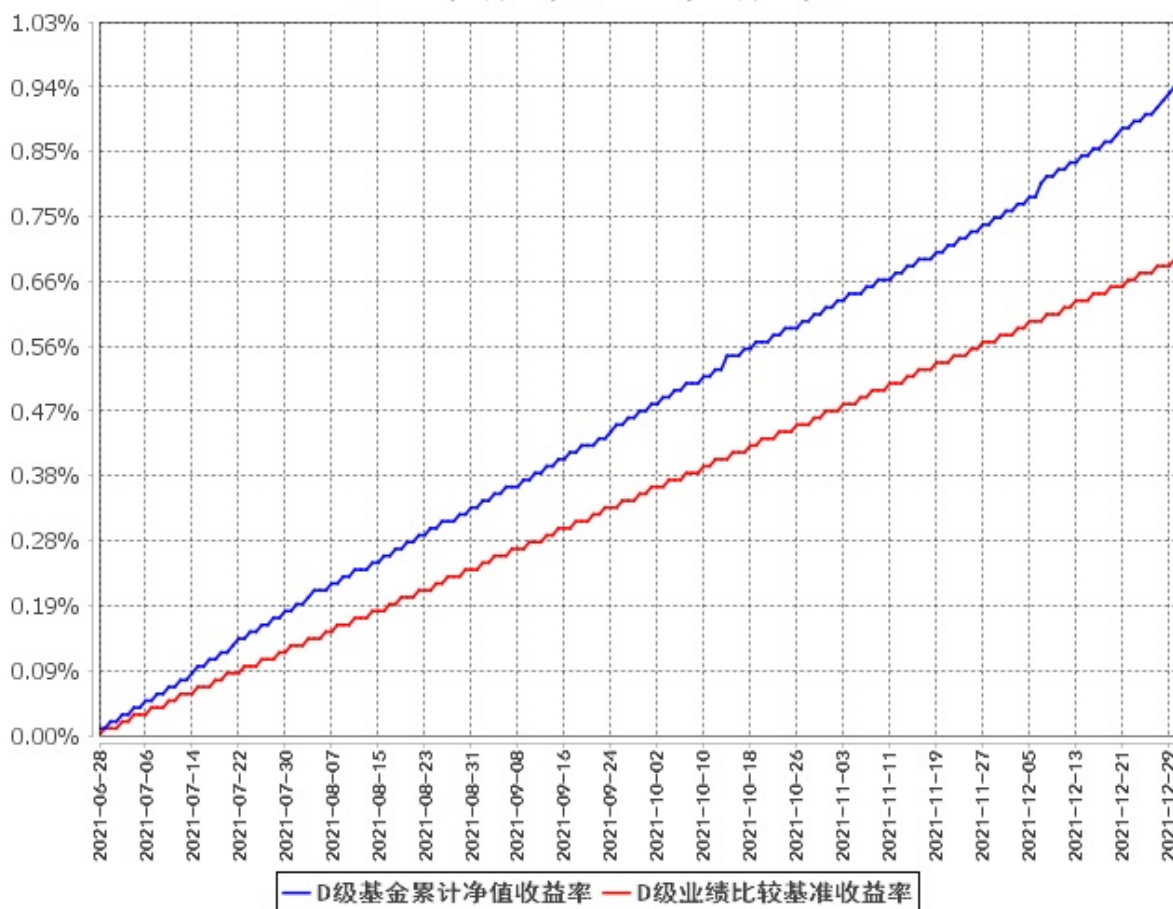
**A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**  
(2017年8月10日至2021年12月31日)



**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12月31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12月31日)

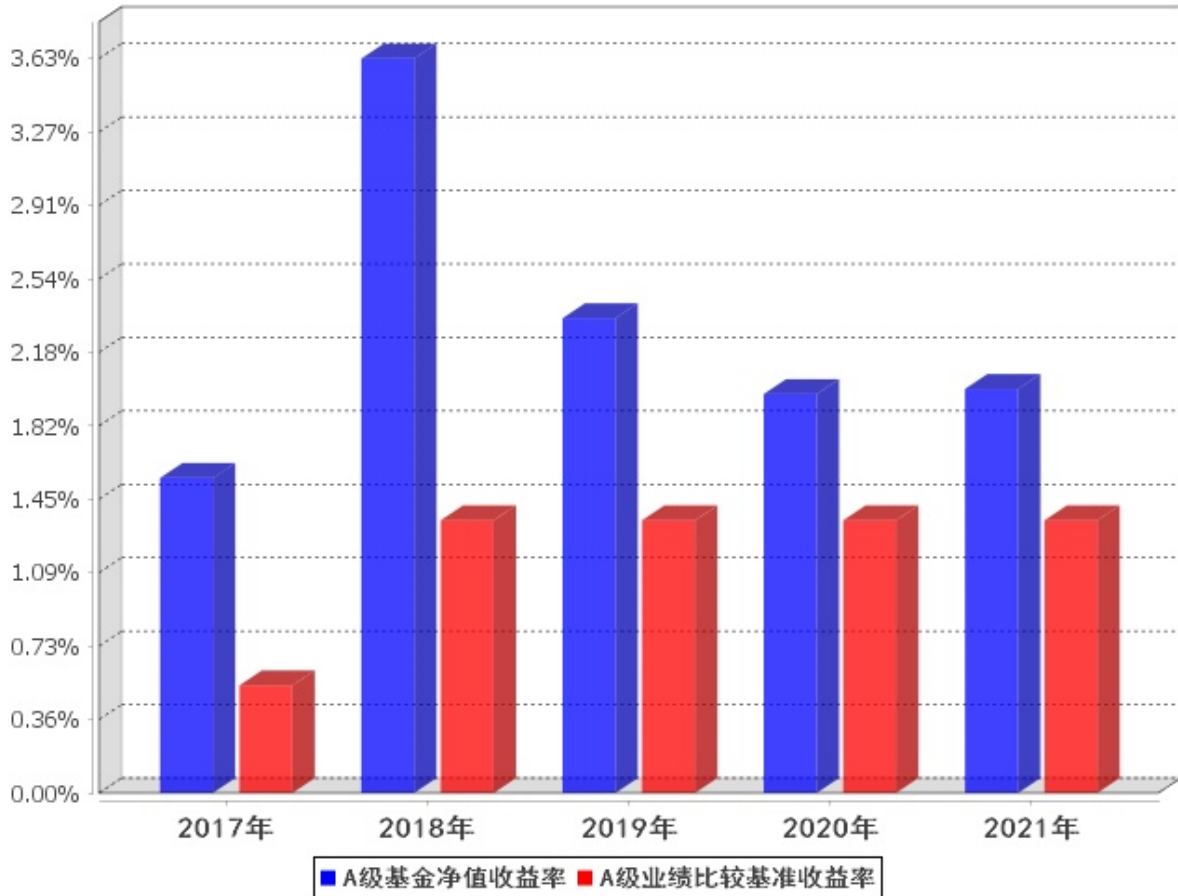


注：(1)本基金自2021年3月12日起增设D类份额，鹏扬通利货币D在2021年3月12日至2021年6月27日期间无份额。

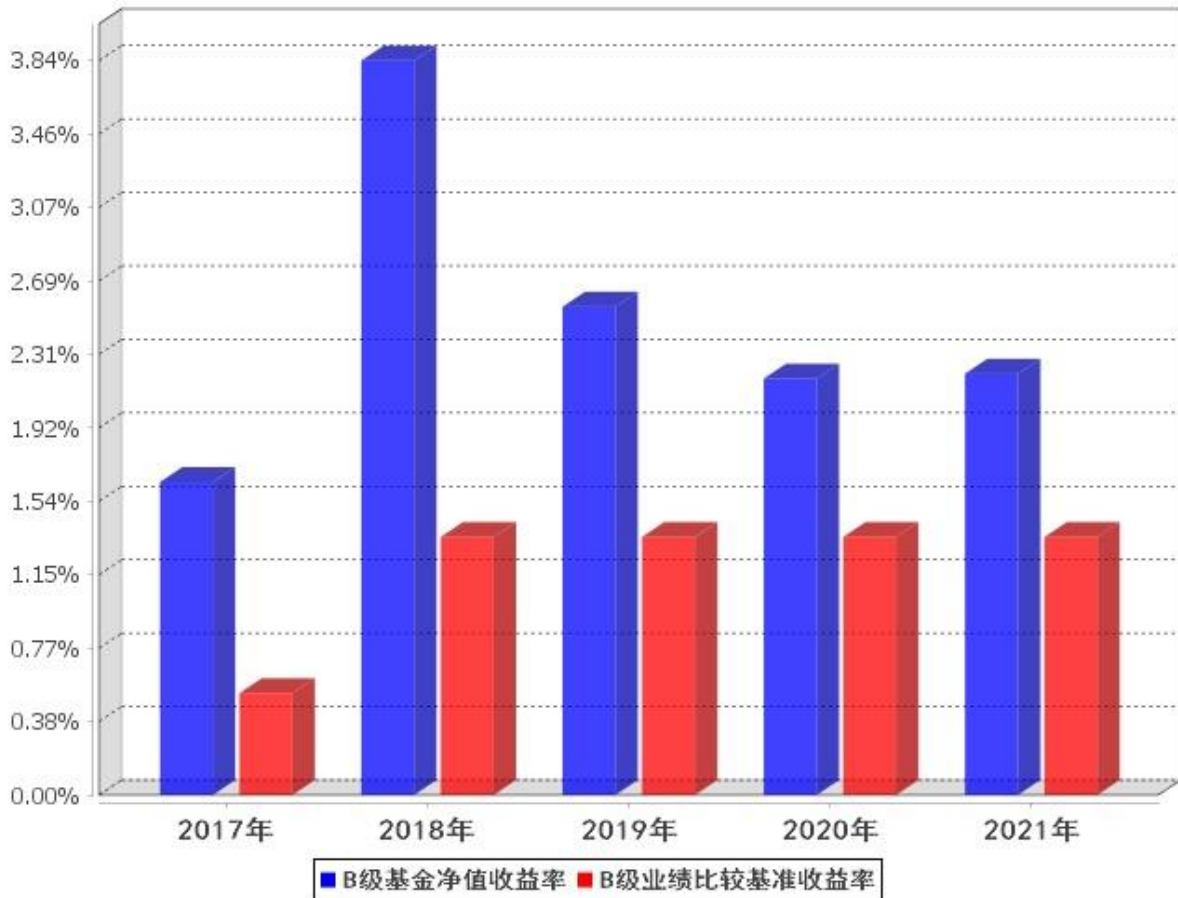
(2)鹏扬通利货币E增设至今无份额。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

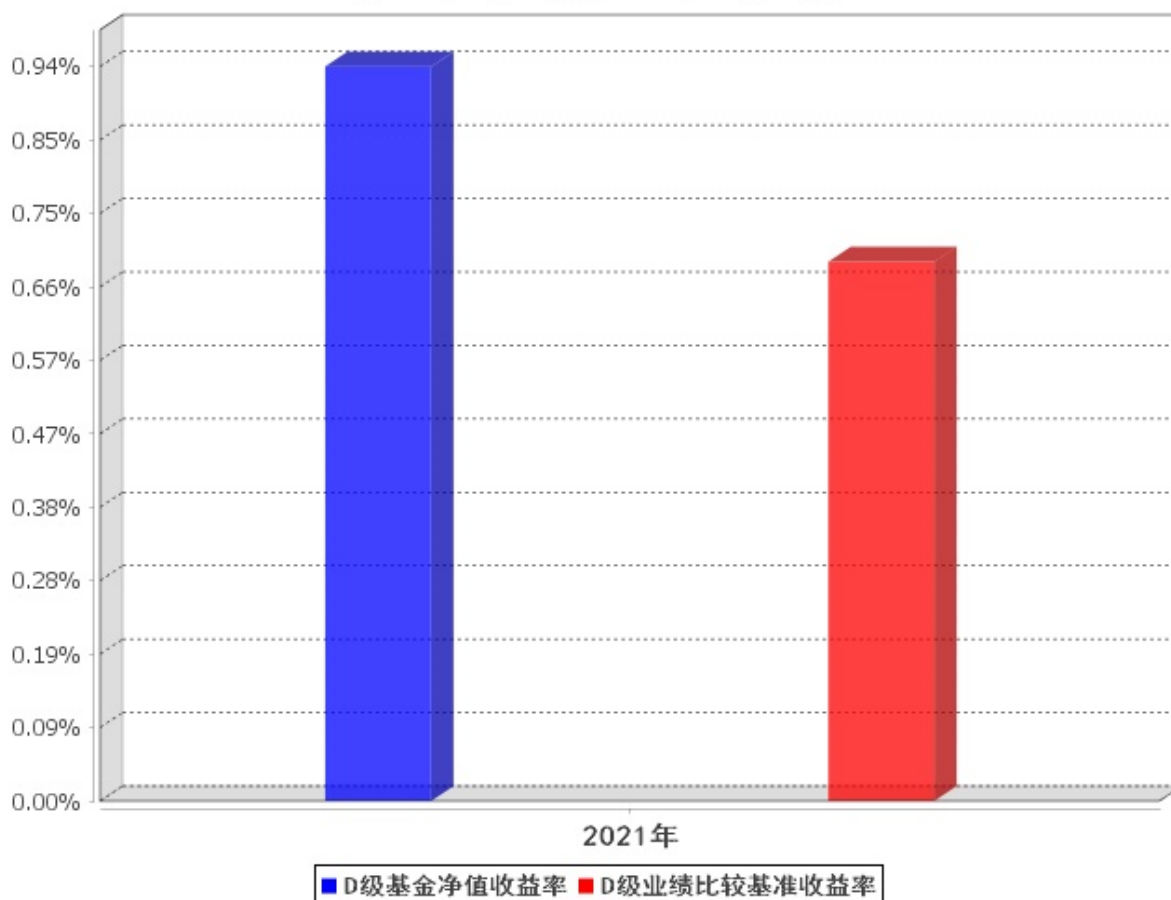
**A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图  
(2017年8月10日至2021年12月31日)**



**B级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**  
(2017年8月10日至2021年12月31日)



**D级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图  
(2021年6月28日至2021年12月31日)**



注：(1) 本基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

(2) 本基金自 2021 年 3 月 12 日起增设 D 类份额，份额首次确认日为 2021 年 6 月 28 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

(3) 鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

鹏扬通利货币 A					
年度	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	年度利润 分配合计	备注
2021	1,307,987.47	-	191.63	1,308,179.10	-
2020	1,415,212.82	-	40.34	1,415,253.16	-
2019	1,377,160.98	-	-12,002.23	1,365,158.75	-
合计	4,100,361.27	-	-11,770.26	4,088,591.01	-

单位：人民币元



鹏扬通利货币 B					
年度	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	年度利润 分配合计	备注
2021	14,769,650.65	-	-1,916.30	14,767,734.35	-
2020	32,031,044.02	-	-118,530.41	31,912,513.61	-
2019	110,238,842.13	-	-1,825,711.63	108,413,130.50	-
合计	157,039,536.80	-	-1,946,158.34	155,093,378.46	-

单位：人民币元

鹏扬通利货币 D					
年度	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	年度利润 分配合计	备注
2021	3,214.25	-	8.64	3,222.89	-
合计	3,214.25	-	8.64	3,222.89	-

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国内首家“私转公”基金管理公司,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。

公司以“为客户创造价值,为美好生活助力”为使命,秉持“客户至上、勇于担当、拥抱变化、合作共赢”的价值观,以“专业稳健,回报信任”作为经营宗旨。公司持续巩固“固定收益+”的特色,绩优主动股票和精品指数业务齐头并进。公司的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。在专业人士持股的治理机制下,客户利益、股东利益以及管理者的利益高度一致,使得公司能够更加专注于长期目标,不会被短期利益所裹挟,从而保障了我们能够在公募行业中行稳致远。

鹏扬基金致力于建立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。公司建立了固收、股票、指数量化、多资产四大团队,固收团队持续提升宏观研究与资产配置、信用研究、衍生品对冲的三大避险能力,力求为投资人获取长期、稳健的收益;股票团队致力于做深度的



个股研究和产业研究，遵循自下而上的基本面理念严选个股，同时充分保留基金经理自己的风格特点；指数团队聚焦高质量核心资产，深挖面向未来的行业主题，努力为投资者提供具有长期良好持有体验的指数产品；多资产团队将基于大数据的定量研究和基于调研访谈的定性研究有机结合，为投资者提供便捷的 FOF 组合方案，有效分散投资风险，助力资产稳健增值。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；从结果上检验风险管理成效，杜绝风险事件的发生；从科技手段上，公司自主研发的“基于大数据的智能投资与风险管理平台”已入围证监会首批资本市场金融科技创新项目。

凭借优异的投资业绩，鹏扬基金 2021 年获评《证券时报》颁发的第十六届中国基金业明星基金奖“三年持续回报明星基金公司”，在公募行业内，仅 3 家基金公司获此殊荣。截至 2021 年 12 月 31 日，鹏扬基金旗下公募基金数量增长到 56 只，公司资产管理总规模接近 1400 亿元，非货公募规模接近 900 亿元。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 12 月 31 日，鹏扬基金最近三年权益产品投资业绩排名行业第 5。

鹏扬基金将专业精神与社会责任相结合，在不同维度积极履行企业社会责任，获得官方机构和专业媒体的广泛认可。2021 年是我国国债恢复发行 40 周年。在财政部国库司和《中国财经报》联合组织的纪念征文中，鹏扬基金作品荣获三等奖，是唯一获奖的基金公司作品，展现了公募基金公司作为国债市场重要参与者的担当精神和专业水平。2021 年，鹏扬基金积极参与全国银行间本币市场的市场共建，履行社会责任，在银行间市场党建、培训、公益等方面取得一定的成绩，获得由全国银行间同业拆借中心颁发的“年度市场影响力奖”。此外，鹏扬基金积极投身巩固拓展脱贫攻坚成果、持续推进乡村振兴的国家战略，参与第一财经公益基金会“一份早餐”计划，为云南怒江山区小学师生捐赠爱心早餐，该项目 2021 年获得由《中国基金报》颁发的第三届公募基金英华奖“最佳公益实践”奖项。

#### 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	-	6	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。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基金经理；2018 年 8 月 24 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 8 月 24 日至今任鹏扬现金通利货币市场基金基金经理；2019 年 11 月 13 日至 2021 年 3 月 18 日任鹏扬利沣短债债券型证券投资基金基金经理；2019 年 11 月 18 日至今任鹏扬淳开债券型证券投资基金基金经理；2020 年 3 月 16 日至今任鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2020 年 4 月 14 日至今任鹏扬景科混合型证券投资基金基金经理；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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《鹏扬基金管理有限公司公平交易制度》，内容主要包括公平交易的原则、投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易行为分析、监控与评估及公平交易行为的信息披露。

公平交易制度所规范的范围涵盖公司旗下各类资产组合，围绕投资管理活动包括上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易(含银行间市场)等，贯穿授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

在投资决策的内部控制方面，通过建立规范的投资决策机制与健全的投资授权制度、共享研究资源为投资人员提供公平的投资机会。本基金管理人内控要求投资人员应公平对待其管理的不同投

投资组合，投资人员根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等建立不同投资组合的投资对象备选库并在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

在交易执行的内部控制方面，本基金管理人建立集中交易制度。交易系统具备执行公平交易的功能，对交易所公开竞价交易，交易系统自动启用公平交易功能，合理分配各投资指令的执行。对银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配、综合平衡的原则对交易结果进行分配。

在行为监控与分析评估方面，本基金管理人建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。公司严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。对于旗下投资组合之间(纯被动指数组合和量化投资组合除外)确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据并经过事前审批后方可交易，并留存记录备查。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

2021年全球经济总体处于分步复苏阶段，全年来看，疫情反复和宏观政策是影响各国经济增长的最重要因素。上半年，受益于疫苗接种提速和各国政府推出的宽松货币政策和积极财政政策支持，全球经济复苏进程明显加快。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，主要体现在生产国中上游工业品价格和消费国消费品价格的大幅上涨。下半年，随着主要经济体逐步进入扩张周期和通货膨胀压力上升，部分国家开始逐步退出疫情期间的极度宽松政策。受“德尔塔”、“奥密克戎”等新冠病毒变异冲击及全球货币财政政策边际收紧等多重因素影响，全球经济出现高位放缓迹象，同时受芯片短缺、海运费和上游原材料价格大涨等供给冲击因素影响，全球制造业动能不断走弱。随着商品和服务涨价扩散，美国单位劳动力成本开始明显上涨，西方国家主要矛盾已经由应对疫情的经济、就业冲击转为应对通货膨胀，部分发达与新兴市场国家开始加息，美联储正式宣布宽松货币政策的退出，全球主要央行进入加息周期。

2021 年中国经济增速 8.1%，1 至 4 季度 GDP 同比分别增长 18.3%、7.9%、4.9%、4.0%，两年平均分别增长 4.9%、5.5%、4.9%、5.2%，经济总体保持平稳运行。上半年经济运行积极因素较多，主要受超预期的出口增长和房地产投资增长支持；下半年面临“供给冲击、需求收缩、预期转弱”三重压力，下行压力不断加大。通货膨胀方面，受猪肉价格大幅下跌、疫情反复制约服务价格上涨和经济下行总需求不足等因素影响，全年 CPI 上涨 0.9%，涨幅比 2020 年回落 1.6 个百分点，总体运行在合理区间。受地方政府运动式减碳等政策影响，中上游大宗商品供给严重不足，叠加上年低基数效应，工业品出厂价格(PPI)由上年下降 1.8%转为大幅上涨 8.1%。但受城镇居民可支配收入增速回落和边际消费倾向不足影响，PPI 向 CPI 传导并不顺畅，PPI 和 CPI 背离不断加大，且背离持续高位时间拉长。

流动性方面，2021 年上半年央行主要通过灵活适度的公开市场操作保持流动性合理充裕，并通过再贷款和两项直达工具，在引导货币信贷增长回到常态的同时，优化信贷结构和降低融资成本。下半年，面对经济下行的三重压力，央行通过全面降准、降低公开市场政策利率、推出碳减排支持工具和清洁能源再贷款等宽松政策支持实体经济，货币市场流动性呈现偏宽松局面。信用扩张方面，2021 年初 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，社会融资规模存量增速开始快速回落；进入下半年，受房地产市场大幅下滑影响，实体信贷明显走弱，同时受房地产和地方政府融资平台等非标融资延续收缩及政府债去年基数高等因素共同拖累，社会融资总量增速回落到 10.3%的较低水平，信用收缩较快，对总需求扩张带来明显不利影响。12 月广义货币供应量增速回落到 8%-9%的偏低水平，考虑到 2021 年名义 GDP 水平较 2020 年有大幅回升，金融市场超额流动性明显下降。

2021 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”交易和货币市场流动性边际收紧影响，债券市场持续走低，10 年国债利率上行到 3.28%。3 月后在资金面重回宽松、债券供给不足、政策面降准降息、经济基本面持续回落等利好因素支持下，债券市场持续走强，10 年国债利率震荡下行至年底的 2.78%，全年中债综合全价指数上涨 2.1%。信用利差方面，受流动性充裕、

理财产品配置需求大增、非标收缩等利好因素支持，信用市场整体利差明显收缩，AA+以上中高等级产业和城投债券信用利差均下降到 20%的历史分位水平。但受部分民企地产公司债务违约和地方政府融资平台信贷收紧等因素影响，部分经济总量偏弱的区域城投债券和民企地产债信用利差大幅上升。

策略方面，本基金本报告期内坚决避免流动性风险与信用风险，全年日均偏离度控制在正的 3bp。在上半年资产收益率与组合规模大幅波动的过程中，B 类平均收益在全市场中位数以上；下半年因货币市场曲线陡峭，组合久期上限较低，收益排名略有下滑。本基金自 2 季度以来基本维持中性配置思路和较高水平的平均期限，合理运用杠杆策略增厚收益，同时注重负债管理，以配合资金面判断，加强负债稳定性。至 2021 年年底组合规模 10.6 亿，B 类份额 7 日年化 2.78%，剩余期限 55 天，集中度 65%。

#### 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 1.9998%，本报告期鹏扬通利货币 B 的基金份额净值收益率为 2.2041%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。本报告期(2021 年 6 月 28 日至 2021 年 12 月 31 日)鹏扬通利货币 D 的基金份额净值收益率为 0.9421%，同期业绩比较基准收益率为 0.6916%。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 2022 年，我们认为宏观政策、疫情防控和地缘政治冲突是影响全球经济金融市场的三个关键因素。由于在疫情防控和宏观经济政策应对方面的明显差异，当前全球经济影响力最大的中国和美国在经济周期方面并不同步，宏观经济和政策组合将明显分化。目前美国经济增长、就业形势良好，通货膨胀压力不断上升，经济主要矛盾是“胀”，宏观政策组合将转为财政货币双收缩。中国经济受“三重压力”影响，经济下行压力加大，但消费物价水平较低，工业品价格在保供稳价政策出台后稳中有降，通货膨胀压力不大，经济主要矛盾是“滞”，宏观政策组合将转为财政货币双宽松。我们认为中美两国宏观政策组合的力度、节奏和效果对全球资本市场走势有着非常重要的影响。疫情防控方面，由于“奥密克戎”病毒的高传染和低毒性的特点，全球主要国家疫情形势有向好趋势，各国防疫政策出现放宽趋势或全面取消防疫限制，如果疫情能在今年顺利结束“大流行”，毫无疑问，这对深受疫情冲击的全球供应链、线下经济活动恢复有很大的正面效应；但风险是如果新病毒变种出现，疫情反复叠加政策转向将对全球经济造成巨大影响。地缘政治冲突方面，我们认为北约东扩与俄罗斯国家安全底线矛盾，中美两国全面展开激烈竞争引发的贸易、科技冲突以及潜在的金融和其他层面的冲突风险都在不断上升，这可能会给 2022 年的资本市场带来巨大的波动。

展望 2022 年中国经济，我们认为 1 季度仍面临一定的下行压力，主要是疫情反复造成的消费需求较弱和房地产市场大幅回落导致的投资需求较弱。但由于政策已经全面转向“稳增长”，预计随着 1 季度财政政策前置发力和宽松货币政策支持，经济环比数据将在 2 季度迎来明显提升，经济同比增长数据有望在前 3 季度逐季回升。全年来看，中国经济仍有望实现 5%-6% 的平稳增长。我们认为主要有三方面因素驱动经济企稳回升：第一，供给方面，由于中央明确提出“要把稳增长放在更加突出的位置”和重回“以经济建设为中心”，在碳减排和碳达峰等长期结构性目标上提出“先立后破”，同时强劲出口增长可能受海外供给恢复和政策收紧等因素影响回落，上游原材料价格逐步回落将有利于中下游工业生产活动的逐步恢复。第二，需求方面，我们认为造成 2021 年需求收缩的主要原因是财政后置“紧财政”和房地产、地方政府融资平台“去杠杆”导致的“紧信用”。但在 2022 年，财政政策要在 1 季度形成实物工作量，适度前置，“紧财政”转为“宽财政”；房地产要保障居民部门的合理购房需求，“紧信用”转为“稳信用”，围绕“碳减排”方面的绿色能源“加杠杆”，宏观杠杆率预计将由 2021 年明显收缩转为企稳回升。第三，预期转弱方面，2021 年围绕“共同富裕”和“防止资本无序扩张”等长期目标，政策部门出台加强教育、医疗、互联网平台经济等一系列行业监管政策对私人部门的投资信心造成较大冲击。但在 21 年年底中央经济工作会议上明确指出，共同富裕“首先要通过全国人民共同奋斗把蛋糕做大做好，然后通过合理的制度安排把蛋糕切好分好”。中央的表态如果结合实质性的纠偏政策出台，相信市场信心也会逐步回升。

通货膨胀方面，我们认为中美通胀水平可能会出现较大差异。美国通胀压力较大，主要原因是商品与服务涨价压力扩散、单位劳动成本上升、通胀预期升温，工资-物价螺旋上升的风险不断增加。随着国内双碳政策纠偏、美国货币财政收紧、欧美国家力图控制通胀，大宗商品的涨势将遭遇逆风，预计 PPI 同比将逐步回落。由于能繁母猪产能充足、耐用消费品涨价压力减弱，服务业成本中的房租与农民工工资上涨乏力，预计 CPI 同比回升幅度将较温和，PPI 与 CPI 剪刀差将收窄。全年 CPI 同比高点预计在 3 季度达到 3% 左右，全年平均 CPI 预计仍保持在 2% 左右的温和水平，通货膨胀风险不大。

流动性方面，我们认为 2022 年货币政策总体基调是“宽货币和宽信用”，为稳定经济增长和对冲房地产企业的流动性压力，央行将继续通过公开市场操作、降息降准等政策工具保持流动性合理充裕，降低实际融资成本，提升信贷需求。信用扩张方面，我们认为上半年随着政策全面转向稳增长，预计社会融资总量增速将回升到 10.5% 以上，全年宏观杠杆率有望上升 7% 左右。值得注意的是，由于房地产销售和投资仍面临政策限制和长期拐点等制约，本轮稳增长周期的信用扩张程度预计将较为温和。考虑到 2022 年名义 GDP 同比增速较上年明显回落，但广义货币供应在“宽财政和宽信用”支持下逐步回升，这意味以 M2-名义 GDP 衡量的金融市场流动性将较 2021 年宽松，总体对资本市场

是向有利方向演变。流动性方面主要的风险是外部美元超预期加息或缩表导致的海外流动性冲击。我们认为由于疫情后中国商品出口高增长和服务贸易逆差减少，经常项目积累巨大的外汇收入，这部分外汇中有相当部分以美元存款存放于商业银行并未结汇，这在一定程度上能缓解美元加息、资本外流的流动性冲击风险。此外，中国作为全球少数具备较大的财政和货币政策空间的大型经济体，中国资本市场与海外资本市场的弱相关性导致极端情况下，中国资本市场可能反而受益于海外央行激进紧缩政策造成的金融市场短期剧烈波动。

展望 2022 年债券市场，我们认为机会不大、风险有限，收益率水平预计维持窄幅震荡。机会不大的主要原因是我们认为目前 10 年期国债 2.75% 左右利率水平基本反应了经济放缓的现实，利率进一步下行空间主要取决于央行后续降息操作空间。考虑到西方主要央行处于加息周期，国内通货膨胀水平下半年将温和回升，工业品价格虽然趋势回落但绝对水平偏高且疫情反复和地缘政治等供给冲击风险仍未消除，我们认为降息政策空间有限。从经济基本面来看，如果 2 季度稳增长政策效果逐步显现，利率水平也存在震荡上行可能，但上升空间也有限，预计未来 2.8% 的利率中枢可能是新常态，10 年国债利率回到 3% 以上将具备很好的长线配置价值。主要原因是考虑到中国人口老龄化和新出生人口的快速下降以及房地产市场的长期拐点基本确立，我们认为中国经济长期潜在增速下行趋势确立，那么在通胀处于合理区间的条件下，国债收益率每轮周期的高点低于前高的概率较大。此外，我们认为本轮稳增长政策基调是“跨周期和逆周期宏观调控政策要有机结合”，信用扩张程度将大概率弱于 2009 年、2012 年、2016 年、2020 年这四轮稳增长周期的扩张程度，更可能类似于 2019 年的稳杠杆，因此，利率回升空间预计有限。如果利率出现超预期的回升，我们认为最大可能是疫情全面缓解，叠加国内房地产政策全面转向，内需全面回升，同时海外需求在通货膨胀压力下继续增长，总需求超预期的恢复将导致利率水平超预期的回升。信用利差方面，目前信用债券利差水平偏低，但在宽信用的政策环境和银行理财产品刚性配置需求支持下，预计信用利差仍将难以回升，如果因为流动性冲击或股票市场风险偏好回升导致信用利差回升，我们认为应该积极抓住配置窗口期。考虑到房地产政策和市场形势仍有一定不确定性，信用利差大幅上升的民营地产债和弱资质的地方政府融资平台债券的投资机会仍有较大的不确定性。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控内幕交易和坚守“三条底线”，进一步完善公司内控，持续强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，有效保证了旗下基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门传达最新法规和监管要求，并对公司业务的影响进行解读，将各项要求落实到具体责任部门，使得公司从业人员知法、守法。二是建立覆盖业务全环节的合规监控体系，严格事前、事中、事后的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、投资交易管理、基金信息披露、基金运营、IT 保障以及反洗钱等业务环节。不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为，完善信息隔离和利益冲突管理制度机制。三是开展合规宣导和合规培训，建立合规风控考评机制，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过定期向员工传递合规简报，开展对新员工的入职合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员、销售人员等的专题合规培训，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和风险的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部得到有效落实。

监察稽核方面，一是定期对本基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况，向董事会报送监察稽核季报。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的投研、交易、运营专项稽核工作。二是持续完善制度流程和监控机制，采用系统监控结合日常定期抽查等有效手段，监督投资管理者的个人行为，防范出现违反监管法规或公司规章的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性，依据最新监管要求和公司业务开展情况，梳理相关业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

监管报备及信息披露方面，严格按照监管法规要求完成管理人层面、基金层面的监管报备及信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完整和及时，充分保障持有人的合法权益。

#### 4.7 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历。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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：1,308,179.10 元，向 B 级份额持有人分配利润：14,767,734.35 元，向 D 级份额持有人分配利润：3,222.89 元。

#### 5.3 托管人对本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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2022)审字第 61290365_A04 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏扬现金通利货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了鹏扬现金通利货币市场基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的鹏扬现金通利货币市场基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了鹏扬现金通利货币市场基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于鹏扬现金通利货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>鹏扬现金通利货币市场基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估鹏扬现金通利货币市场基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非管理层计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督鹏扬现金通利货币市场基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是</p>

	<p>高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对导致对鹏扬现金通利货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致鹏扬现金通利货币市场基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计事务名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	王珊珊 王海彦
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
审计报告日期	2022年3月25日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
----	-----	--------------------	---------------------

<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	300,371,611.18	230,399,525.98
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	564,618,319.35	657,485,993.46
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		564,618,319.35	657,485,993.46
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	210,340,635.51	244,040,872.06
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,678,572.02	6,416,285.40
应收股利		-	-
应收申购款		111,254.17	2,037,810.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,077,120,392.23	1,140,380,487.62
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		17,999,871.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		161,677.27	15,700.51
应付管理人报酬		200,108.35	324,460.31
应付托管费		59,291.35	97,338.13
应付销售服务费		18,825.90	23,530.62
应付交易费用	7.4.7.7	30,229.94	29,920.68
应交税费		11,248.91	12,772.47
应付利息		1,265.13	-
应付利润		80,602.53	82,318.56
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	214,785.36	224,300.00
负债合计		18,777,905.74	810,341.28
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,058,342,486.49	1,139,570,146.34
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,058,342,486.49	1,139,570,146.34
负债和所有者权益总计		1,077,120,392.23	1,140,380,487.62

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,058,342,486.49 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 64,228,852.65 份；鹏扬通利货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 993,989,854.70 份；鹏扬通利货币 D 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 123,779.14 份；鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		19,630,914.72	40,211,099.76
1. 利息收入		19,154,234.95	37,735,059.24
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,363,613.08	3,121,429.79
债券利息收入		11,641,771.33	24,555,928.87
资产支持证券利息收入		-	299,188.78
买入返售金融资产收入		4,148,850.54	9,758,511.80
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		476,679.77	2,476,040.52
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	476,679.77	2,151,634.24
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	324,406.28
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		3,551,778.38	6,883,332.99
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,053,104.90	4,670,663.68
2. 托管费	7.4.10.2.2	610,133.78	1,401,199.09
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	206,974.12	301,099.08
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		365,451.09	152,262.30

其中：卖出回购金融资产支出		365,451.09	152,262.30
6. 税金及附加		7,665.11	36,043.22
7. 其他费用	7.4.7.20	308,449.38	322,065.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		16,079,136.34	33,327,766.77
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		16,079,136.34	33,327,766.77

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	-	16,079,136.34	16,079,136.34
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）	-81,227,659.85	-	-81,227,659.85
其中：1. 基金申购款	5,010,539,812.46	-	5,010,539,812.46
2. 基金赎回款	-5,091,767,472.31	-	-5,091,767,472.31
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）	-	-16,079,136.34	-16,079,136.34
五、期末所有者权益（基金净值）	1,058,342,486.49	-	1,058,342,486.49
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	-	33,327,766.77	33,327,766.77
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）	1,936,720,688.88	-	-1,936,720,688.88
其中：1. 基金申购款	6,783,326,196.21	-	6,783,326,196.21

2. 基金赎回款	- 8,720,046,885.09	-	-8,720,046,885.09
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）	-	-33,327,766.77	-33,327,766.77
五、期末所有者权益（基金净值）	1,139,570,146.34	-	1,139,570,146.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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,基金合同生效日的基金份额总额为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。

## 7.4.2 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2号<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编制。

## 7.4.3 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。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为贷款和应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类



应收款项等。贷款和应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，该等利息应作为债券投资成本；卖出银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (2) 回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购)，以成本列示，按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

##### (1) 银行存款

本基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

##### (2) 债券投资

本基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

##### (3) 回购协议

1) 本基金持有的回购协议(封闭式回购)，以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

2) 本基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

##### (4) 其他

1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资

产净值更能公允地反映基金资产价值；

3) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为人民币 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

无。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第 120 号《货币市场基金监督管理办法》的规定，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用自有资金予以弥补；

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益/损失于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) “每日分配、按日支付”。本基金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。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额按份额进行再次分配，直到分完为止）；

(4) 本基金每日进行收益计算并分配，若投资人在每日收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额；其累计收益为零，则投资人的基金份额不变；其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回全部基金份额时，其对应收益将立即结清；若累计收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；

(5) 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 7.4.6 税项

### 7.4.6.1 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；对国债、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》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。

#### 7.4.6.2 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。

#### 7.4.6.3 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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	371,611.18	399,525.98
定期存款	300,000,000.00	230,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	100,000,000.00	150,000,000.00
存款期限 3 个月以上	200,000,000.00	80,000,000.00
其他存款	-	-
合计	300,371,611.18	230,399,525.98

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	564,618,319.35	564,889,500.00	271,180.65 0.0256%

	合计	564,618,319.35	564,889,500.00	271,180.65	0.0256%
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	564,618,319.35	564,889,500.00	271,180.65	0.0256%
	项目	上年度末 2020 年 12 月 31 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	657,485,993.46	658,267,000.00	781,006.54	0.0685%
	合计	657,485,993.46	658,267,000.00	781,006.54	0.0685%
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	657,485,993.46	658,267,000.00	781,006.54	0.0685%

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	210,340,635.51	-
合计	210,340,635.51	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	244,040,872.06	-
合计	244,040,872.06	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	55.76	88.24
应收定期存款利息	857,110.95	1,155,899.42
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	675,355.18	5,191,739.96
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	146,050.13	68,557.78
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	1,678,572.02	6,416,285.40

## 7.4.7.6 其他资产

无。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	30,229.94	29,920.68
合计	30,229.94	29,920.68

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	485.36	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	214,300.00	224,300.00
合计	214,785.36	224,300.00



## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鹏扬通利货币 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	504,304,882.69	504,304,882.69
本期赎回(以“-”号填列)	-504,922,392.22	-504,922,392.22
本期末	64,228,852.65	64,228,852.65

金额单位：人民币元

鹏扬通利货币 B		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	4,503,505,091.80	4,503,505,091.80
本期赎回(以“-”号填列)	-4,584,239,021.26	-4,584,239,021.26
本期末	993,989,854.70	993,989,854.70

金额单位：人民币元

鹏扬通利货币 D		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	2,729,837.97	2,729,837.97
本期赎回(以“-”号填列)	-2,606,058.83	-2,606,058.83
本期末	123,779.14	123,779.14

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。

## 7.4.7.10 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	1,308,179.10	-	1,308,179.10
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	-1,308,179.10	-	-1,308,179.10
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	14,767,734.35	-	14,767,734.35
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	-14,767,734.35	-	-14,767,734.35
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	3,222.89	-	3,222.89
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	-3,222.89	-	-3,222.89
本期末	-	-	-

注：鹏扬通利货币 E 增设至今无份额。

## 7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	3,242.27	10,951.33
定期存款利息收入	3,345,511.51	3,110,460.54
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	14,859.30	-
其他	-	17.92
合计	3,363,613.08	3,121,429.79

## 7.4.7.12 股票投资收益

无。

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,482,602,608.24	8,733,750,790.08
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,463,038,576.68	8,678,881,109.69
减：应收利息总额	19,087,351.79	52,718,046.15
买卖债券差价收入	476,679.77	2,151,634.24

## 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	-	30,720,154.22
减：卖出资产支持证券成本总额	-	30,000,000.00
减：应收利息总额	-	395,747.94
资产支持证券投资收益	-	324,406.28

## 7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

无。

## 7.4.7.16 股利收益

无。

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

无。

#### 7.4.7.18 其他收入

无。

#### 7.4.7.19 交易费用

无。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
审计费用	85,000.00	95,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	37,200.00	37,200.00
银行汇划费	66,249.38	69,865.62
合计	308,449.38	322,065.62

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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
上海华石投资有限公司	基金管理人股东
宏实资本管理有限公司	基金管理人股东
上海济通企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
上海璞识企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
上海润京企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
上海泓至企业管理中心(有限合伙)	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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,053,104.90	4,670,663.68
其中：支付销售机构的客户维护费	54,036.74	125,038.08

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

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	610,133.78	1,401,199.09

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

###### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	鹏扬通利货币	鹏扬通利货币	鹏扬通利货币	鹏扬通利货币	合计

	A	B	D	E	
鹏扬基金	102,862.19	62,207.87	-	-	165,070.06
合计	102,862.19	62,207.87	-	-	165,070.06
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 12 月 31 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	94,162.35	142,022.71	-	-	236,185.06
合计	94,162.35	142,022.71	-	-	236,185.06

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

#### 7.4.10.4 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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 12 月 31 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	-	-
报告期内申购/买入总份额	445.47	347,200,891.43	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-	-
减:报告期内赎回/卖出总份额	50,993.23	335,235,101.31	-	-
报告期末持有的基金份额	-	84,007,422.77	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	7.94%	-	-

项目	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31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	-	-
报告期内申购/买入总份额	80,930.64	215,257,521.59	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-	-
减:报告期内赎回/卖出总份额	30,382.88	153,295,818.17	-	-
报告期末持有的基金份额	50,547.76	72,041,632.65	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	6.32%	-	-

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。

#### 7.4.10.5.2 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 12 月 31 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	3,018,548.78	0.29%	-	-

份额单位：份

鹏扬通利货币 B				
关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	371,611.18	3,242.27	399,525.98	10,951.33

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 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 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
1,307,987.47	-	191.63	1,308,179.10	-

##### 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
14,769,650.65	-	-1,916.30	14,767,734.35	-

## 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
3,214.25	-	8.64	3,222.89	-

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。

## 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 17,999,871.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
219960	21 贴现国债 60	2022 年 1 月 4 日	99.59	200,000	19,917,846.49
合计				200,000	19,917,846.49

## 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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。

### 7.4.13.2 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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。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。

#### 7.4.13.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	70,261,972.36
A-1 以下	-	-
未评级	167,499,825.02	274,020,408.72
合计	167,499,825.02	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) 未评级债券包括国债、政策性金融债、央票、地方政府债、短期融资券、公司债等。

(3) 债券投资以全价列示。

#### 7.4.13.2.2 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。

#### 7.4.13.2.3 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	397,793,849.51	297,860,358.18
合计	397,793,849.51	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。

#### 7.4.13.2.4 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	20,534,994.16
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	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) 未评级债券包括国债、政策性金融债、央票、地方政府债、中期票据、公司债等。

(3) 债券投资以全价列示。

#### 7.4.13.2.5 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。

#### 7.4.13.2.6 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

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。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

##### 7.4.13.3.2 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。基金管理人对于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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	300,371,611.18	-	-	-	300,371,611.18
交易性金融资产	564,618,319.35	-	-	-	564,618,319.35
买入返售金融资产	210,340,635.51	-	-	-	210,340,635.51
应收利息	-	-	-	1,678,572.02	1,678,572.02
应收申购款	-	-	-	111,254.17	111,254.17
资产总计	1,075,330,566.04	-	-	1,789,826.19	1,077,120,392.23
负债					
卖出回购金融资产款	17,999,871.00	-	-	-	17,999,871.00
应付赎回款	-	-	-	161,677.27	161,677.27

应付管理人报酬	-	-	-	200,108.35	200,108.35
应付托管费	-	-	-	59,291.35	59,291.35
应付销售服务费	-	-	-	18,825.90	18,825.90
应付交易费用	-	-	-	30,229.94	30,229.94
应付利息	-	-	-	1,265.13	1,265.13
应交税费	-	-	-	11,248.91	11,248.91
应付利润	-	-	-	80,602.53	80,602.53
其他负债	-	-	-	214,785.36	214,785.36
负债总计	17,999,871.00	-	-	778,034.74	18,777,905.74
利率敏感度缺口	1,057,330,695.04	-	-	1,011,791.45	1,058,342,486.49
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	230,399,525.98	-	-	-	230,399,525.98
交易性金融资产	657,485,993.46	-	-	-	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	1,131,926,391.50	-	-	8,454,096.12	1,140,380,487.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,700.51	15,700.51
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	1,131,926,391.50	-	-	7,643,754.84	1,139,570,146.34

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

### 7.4.13.4.3 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。

### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 7.4.14.1 公允价值

#### 7.4.14.1.1 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。

#### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 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 564,618,319.35 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)。

##### 7.4.14.1.2.2 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。

##### 7.4.14.1.2.3 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。

### 7.4.14.2 承诺事项

无。

### 7.4.14.3 其他事项

无。

### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	564,618,319.35	52.42
	其中：债券	564,618,319.35	52.42
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	210,340,635.51	19.53
	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	300,371,611.18	27.89
4	其他各项资产	1,789,826.19	0.17
5	合计	1,077,120,392.23	100.00

### 8.2 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		2.33
	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	17,999,871.00	1.70
	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%。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 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	55
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	21



### 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。

#### 8.3.2 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	32.19	1.70
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	4.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	59.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.72	-
	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	101.61	1.70

#### 8.4 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。

#### 8.5 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	49,794,616.22	4.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,950,310.61	2.83
	其中：政策性金融债	29,950,310.61	2.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	87,079,543.01	8.23
6	中期票据	-	-
7	同业存单	397,793,849.51	37.59
8	其他	-	-
9	合计	564,618,319.35	53.35
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

## 8.6 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	112103031	21 农业银行 CD031	1,000,000	99,412,919.14	9.39
2	112104012	21 中国银行 CD012	500,000	49,795,166.82	4.71
3	219960	21 贴现国债 60	500,000	49,794,616.22	4.70
4	112111087	21 平安银行 CD087	500,000	49,759,684.98	4.70
5	112103030	21 农业银行 CD030	500,000	49,733,775.23	4.70
6	112115086	21 民生银行 CD086	500,000	49,722,827.90	4.70
7	112111275	21 平安银行 CD275	500,000	49,688,834.84	4.69
8	112117068	21 光大银行 CD068	500,000	49,680,640.60	4.69
9	2103689	21 进出 689	300,000	29,950,310.61	2.83
10	012102333	21 京能洁能 SCP004	200,000	20,040,809.22	1.89

## 8.7 “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	-0.0065%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0289%

## 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。

## 8.8 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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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。

### 8.9.2 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、中国进出口银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚。中国银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局或其派出机构的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

### 8.9.3 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	1,678,572.02
4	应收申购款	111,254.17
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,789,826.19

### 8.9.4 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	2,591	24,789.21	26,948,699.89	41.96%	37,280,152.76	58.04%
鹏扬通利货币 B	30	33,132,995.16	993,989,854.70	100.00%	-	-
鹏扬通利货币 D	37	3,345.38	-	-	123,779.14	100.00%
鹏扬通利货币 E	-	-	-	-	-	-
合计	2,658	398,172.49	1,020,938,554.59	96.47%	37,403,931.90	3.53%

### 9.2 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	保险类机构	100,141,334.59	9.46%
2	银行类机构	100,095,039.69	9.46%
3	保险类机构	100,016,182.73	9.45%
4	基金类机构	73,859,110.50	6.98%
5	保险类机构	70,395,674.63	6.65%
6	基金类机构	60,014,482.06	5.67%
7	基金类机构	50,034,028.92	4.73%
8	银行类机构	50,000,000.00	4.72%
8	基金类机构	50,000,000.00	4.72%
10	基金类机构	31,086,320.32	2.94%

### 9.3 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	6,695,396.33	10.4243%
	鹏扬通利货币 B	-	-
	鹏扬通利货币 D	10,911.63	8.8154%
	鹏扬通利货币 E	-	-
	合计	6,706,307.96	0.6337%

## 9.4 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	>100
	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	>100
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

## § 10 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	504,304,882.69	4,503,505,091.80	2,729,837.97	-
减：本报告期基金总赎回份额	504,922,392.22	4,584,239,021.26	2,606,058.83	-
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	64,228,852.65	993,989,854.70	123,779.14	-

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。

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 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。

## 11.2 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 2021 年 7 月 10 日发布《鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告》，李刚先生自 2021 年 7 月 9 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。

### 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。

## 11.3 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。

## 11.4 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。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 85,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-

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，恒泰证券、西部证券的交易单元，申万宏源的部分交易单元为本基金本报告期内新增的交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金未使用所租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 11.8 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。

### 11.9 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 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
9	鹏扬现金通利货币市场基金(鹏扬通利	证监会指定报刊及网	2021 年 3 月 12 日

	货币 E 份额) 基金产品资料概要(更新)	站、公司官网	
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 1 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
24	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
25	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
26	鹏扬基金管理有限公司关于新增基金	证监会指定报刊及网	2021 年 7 月 8 日



	合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	站、公司官网	
27	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在北京蛋卷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 7 月 13 日
28	鹏扬现金通利货币市场基金 2021 年第 2 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 7 月 21 日
29	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 7 月 23 日
30	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 7 月 28 日
31	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 8 月 3 日
32	鹏扬现金通利货币市场基金 2021 年中期报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 8 月 31 日
33	鹏扬基金管理有限公司关于旗下开放式基金在上海华夏财富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 9 月 10 日
34	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 9 月 16 日
35	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 9 月 18 日
36	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 9 月 18 日
37	鹏扬现金通利货币市场基金更新的招募说明书(2021 年 2 号)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 9 月 18 日
38	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 9 月 18 日
39	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 9 月 18 日
40	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 9 月 23 日
41	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 9 月 27 日
42	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 10 月 19 日

43	鹏扬现金通利货币市场基金 2021 年第 3 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 10 月 27 日
44	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 11 月 25 日
45	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 12 月 7 日
46	鹏扬基金管理有限公司关于调整鹏扬现金通利货币市场基金最低申购金额限制的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 12 月 15 日
47	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 12 月 29 日
48	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 12 月 29 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	-	301,812,804.80	301,812,804.80	-	-
	2	2021 年 4 月 23 日-2021 年 6 月 2 日	-	245,734,347.46	245,734,347.46	-	-
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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 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。

### 13.3 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

2022 年 3 月 29 日