

鹏扬现金通利货币市场基金

2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 30 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 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 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 | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 15 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 15 |
| 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 | 16 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 17 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 19 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 19 |
| 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 | 19 |
| § 5 托管人报告 | 19 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 19 |
| 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 | 19 |
| 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 | 20 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 20 |
| 6.1 资产负债表 | 20 |
| 6.2 利润表 | 21 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 23 |
| 6.4 报表附注 | 24 |
| § 7 投资组合报告 | 45 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 45 |
| 7.2 债券回购融资情况 | 45 |

| | |
|---|-----------|
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限 | 45 |
| 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 | 46 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 46 |
| 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 | 46 |
| 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 | 47 |
| 7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细 | 47 |
| 7.9 投资组合报告附注 | 47 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 48 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 48 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 | 49 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 49 |
| 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 | 49 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 50 |
| § 10 重大事件揭示 | 50 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 50 |
| 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 | 50 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 51 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 51 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 51 |
| 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 | 51 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 51 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 | 53 |
| 10.9 其他重大事件 | 53 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 54 |
| 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 | 54 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 54 |
| § 12 备查文件目录 | 54 |
| 12.1 备查文件目录 | 54 |
| 12.2 存放地点 | 54 |
| 12.3 查阅方式 | 54 |

§ 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 | 6,883,134,348.35 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 | 120,217,009.88 份 | 4,836,879,687.20 份 | 1,777,535,125.63 份 | 148,502,525.64 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 增设日至 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 增设日至 2022 年 4 月 5 日期间无份额。

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 | 王小飞 |
| | 联系电话 | 010-68105888 | 021-60637103 |

| | | |
|--------|----------------------------------|------------------------|
| 电子邮箱 | service@pyamc.com | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | 400-968-6688 | 021-60637228 |
| 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 号西城金茂中心 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 号西城金茂中心 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) | 报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) | 报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) | 报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 1,082,736.38 | 41,550,124.87 | 15,962,477.09 | 1,315,949.18 |
| 本期利润 | 1,082,736.38 | 41,550,124.87 | 15,962,477.09 | 1,315,949.18 |
| 本期净值收益率 | 0.9570% | 1.0572% | 0.9365% | 1.0572% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) | | | |
| 期末基金资产净值 | 120,217,009.88 | 4,836,879,687.20 | 1,777,535,125.63 | 148,502,525.64 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) | | | |

| | | | | |
|---------|----------|----------|---------|---------|
| 累计净值收益率 | 15.0532% | 16.4158% | 3.6110% | 2.4069% |
|---------|----------|----------|---------|---------|

注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金对所持有的交易性金融资产按照实际利率法估算并采用影子定价和偏离度控制确定其公允价值，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。

(2)本基金收益分配是按日结转份额。

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 | 0.1485% | 0.0009% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0375% | 0.0009% |
| 过去三个月 | 0.4812% | 0.0010% | 0.3366% | 0.0000% | 0.1446% | 0.0010% |
| 过去六个月 | 0.9570% | 0.0017% | 0.6695% | 0.0000% | 0.2875% | 0.0017% |
| 过去一年 | 1.7351% | 0.0021% | 1.3500% | 0.0000% | 0.3851% | 0.0021% |
| 过去三年 | 5.7862% | 0.0018% | 4.0481% | 0.0000% | 1.7381% | 0.0018% |
| 自基金合同生效起至今 | 15.0532% | 0.0030% | 7.9521% | 0.0000% | 7.1011% | 0.0030% |

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 | 0.1649% | 0.0008% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0539% | 0.0008% |
| 过去三个月 | 0.5314% | 0.0010% | 0.3366% | 0.0000% | 0.1948% | 0.0010% |
| 过去六个月 | 1.0572% | 0.0017% | 0.6695% | 0.0000% | 0.3877% | 0.0017% |
| 过去一年 | 1.9387% | 0.0021% | 1.3500% | 0.0000% | 0.5887% | 0.0021% |
| 过去三年 | 6.4228% | 0.0018% | 4.0481% | 0.0000% | 2.3747% | 0.0018% |
| 自基金合同生效起至今 | 16.4158% | 0.0030% | 7.9521% | 0.0000% | 8.4637% | 0.0030% |

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 |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.1449% | 0.0008% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0339% | 0.0008% |
| 过去三个月 | 0.4712% | 0.0010% | 0.3366% | 0.0000% | 0.1346% | 0.0010% |
| 过去六个月 | 0.9365% | 0.0017% | 0.6695% | 0.0000% | 0.2670% | 0.0017% |
| 过去一年 | 1.7101% | 0.0022% | 1.3500% | 0.0000% | 0.3601% | 0.0022% |

| | | | | | | |
|------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 自基金合同生效起至今 | 3.6110% | 0.0019% | 2.7111% | 0.0000% | 0.8999% | 0.0019% |
|------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|

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 增设日至 2021 年 6 月 27 日期间无份额。

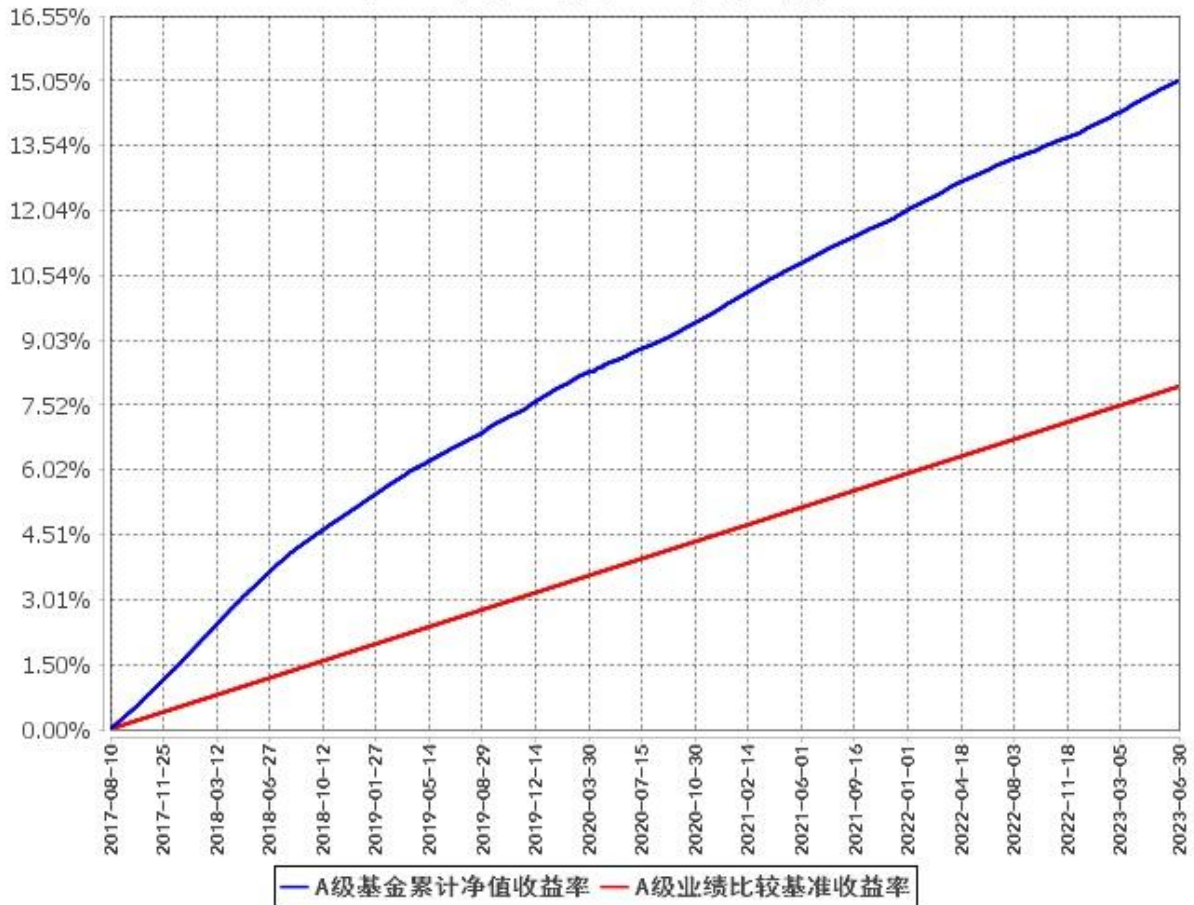
鹏扬通利货币 E

| 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 | 0.1649% | 0.0008% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0539% | 0.0008% |
| 过去三个月 | 0.5314% | 0.0010% | 0.3366% | 0.0000% | 0.1948% | 0.0010% |
| 过去六个月 | 1.0572% | 0.0017% | 0.6695% | 0.0000% | 0.3877% | 0.0017% |
| 过去一年 | 1.9432% | 0.0021% | 1.3500% | 0.0000% | 0.5932% | 0.0021% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.4069% | 0.0020% | 1.6681% | 0.0000% | 0.7388% | 0.0020% |

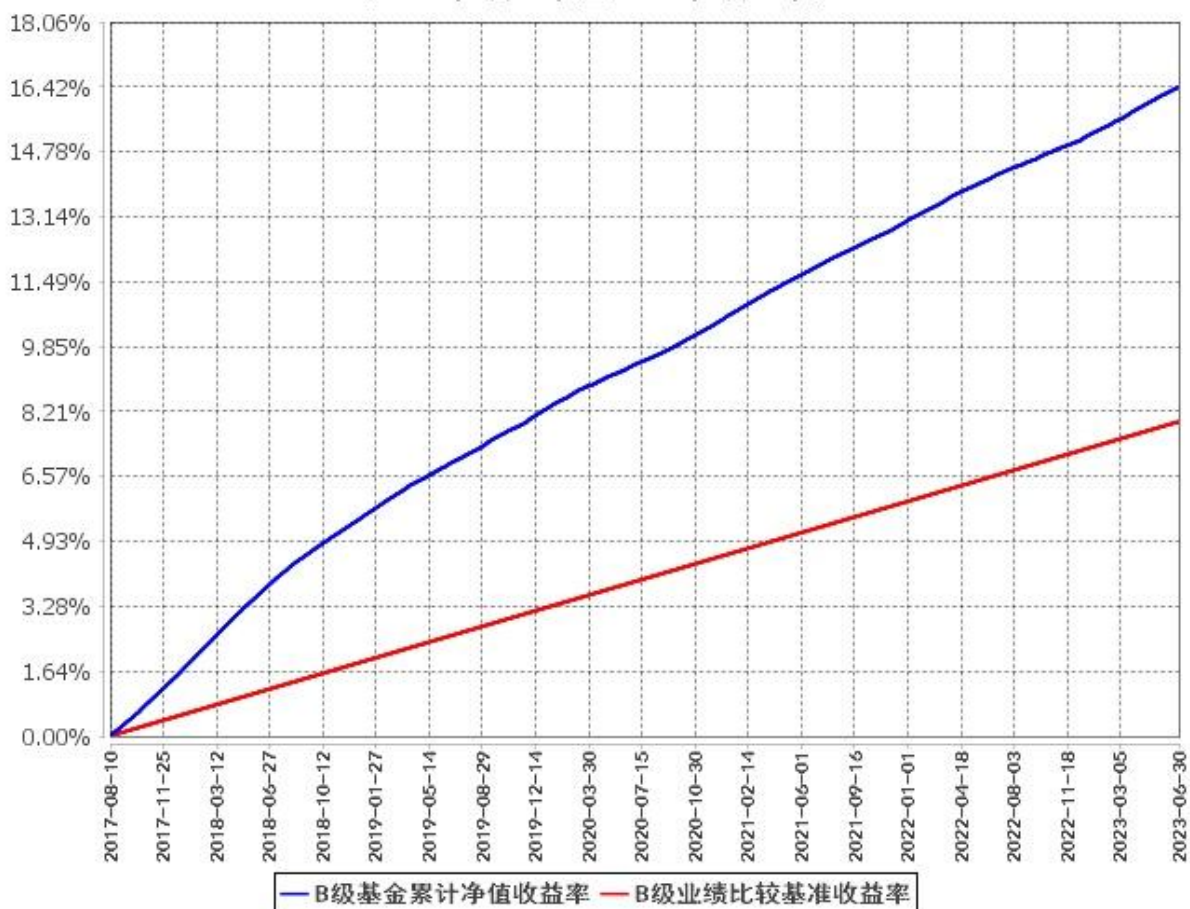
注：本基金自 2020 年 8 月 27 日起增设 E 类份额，鹏扬通利货币 E 增设日至 2022 年 4 月 5 日期间无份额。

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

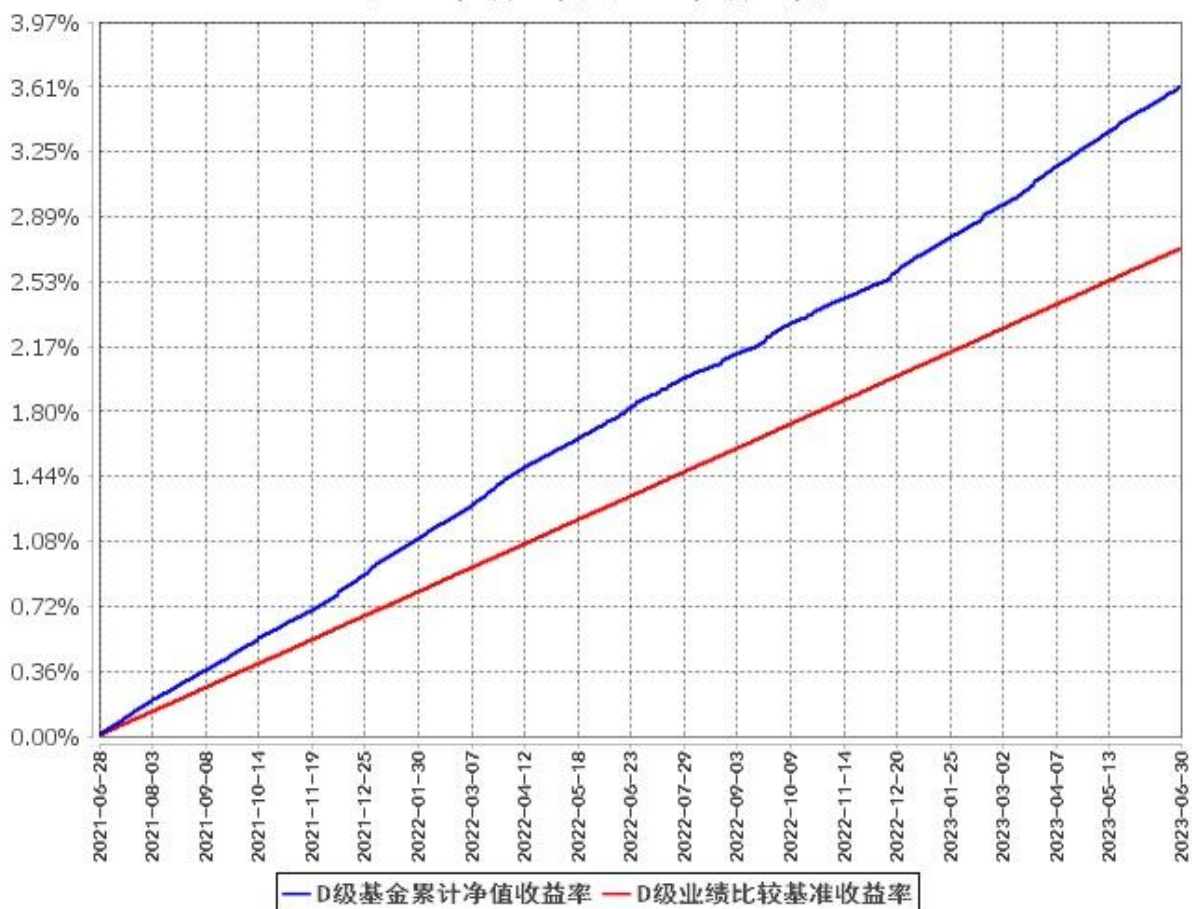
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年8月10日至2023年6月30日)



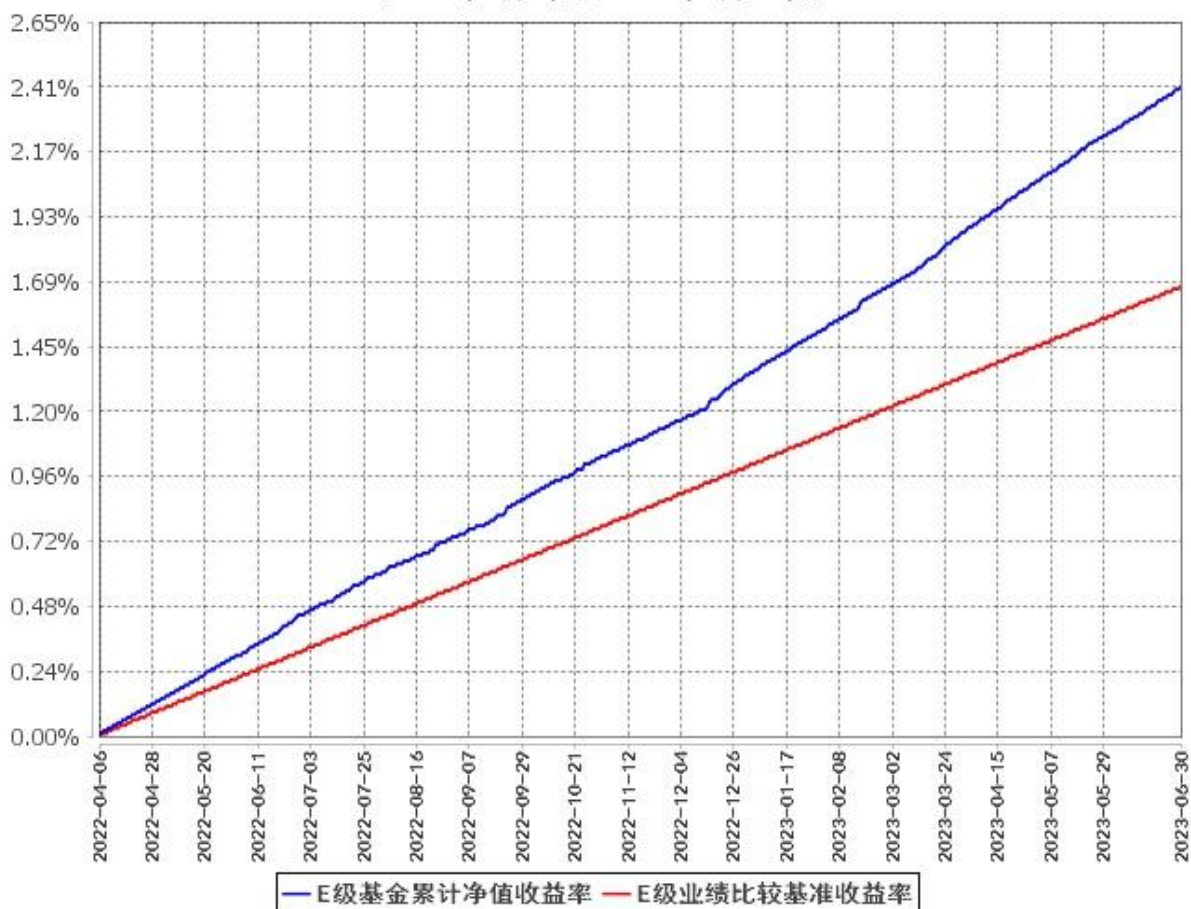
B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年8月10日至2023年6月30日)



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2023年6月30日)



E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
(2022年4月6日至2023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 增设日至 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 增设日至 2022 年 4 月 5 日期间无份额。

§ 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，总部位于北京。

公司坚持特色化经营，逐渐形成主动股票、特色指数、多资产 FOF 和传统强项固收业务齐头并进的多元化格局。

公司践行高质量发展。在公司治理和人才战略方面，公司充分发挥专业人士控股的治理结构优势，汇聚海内外优秀人才，致力于打造一支将服务投资者作为长期事业的人才队伍。公司核心投资

人员均具有 10 年以上知名金融机构工作经历。公司持续开展“鲲鹏人才培养计划”，为应届毕业生提供就业岗位，充实投研与金融科技人才梯队。

公司致力于打造平台化、团队化、一体化的投研体系，实现“宏观、策略、行业、公司”的全维度研究覆盖，为客户提供“全天候”的资产管理解决方案。其中，固收团队持续提升宏观研究与资产配置、利率交易、信用研究、转债增强等核心投资能力，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，遵循基本面理念严选个股，同时充分保留基金经理自身风格特点；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。

公司高度注重风险管理，并以科技赋能业务。公司从文化上树立全员风险防范意识；从制度上实现风险管理对投前、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”正式上线运行，实现研究、投资、交易、风控的一体化，大幅提升资管全流程的运作效率，提升风险管理的有效性。

凭借优异的投资业绩和出色的风险管理能力，公司旗下产品鹏扬利泽于 2023 年在证券时报社主办的第十八届中国基金业明星基金奖中荣获“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。银河证券《公募基金管理人长期主动股票投资管理能力和榜单》显示，截至 2023 年 6 月 30 日，鹏扬基金近三年的股票投资主动管理收益率为 23.29%，在 125 家参评公募基金管理人中排名第 12。

公募基金行业高质量发展需要创新驱动。鹏扬基金长期关注客户所需，坚持守正创新。在中国公募基金行业成立 25 周年之际，公司旗下的鹏扬利泽和鹏扬数字经济 ETF 凭借创新性和优秀的持续表现，分别作为国内首只中短债基金和首只数字经济 ETF，入选《中国基金报》五年一度的“行业创新范例”（固收类、指数类）。2023 年 6 月，鹏扬基金发行的国内首只 30 年期国债 ETF 正式上市，不仅为投资者配置超长期限国债，管理久期风险提供了全新的工具，而且提升了国债二级市场流动性，助力国债市场高质量发展。

鹏扬基金作为一家有理想、有担当的公募基金公司，全面履行社会责任，持续开展投资者教育和公益慈善活动。作为中国基金业协会投教专委会委员单位，公司积极联合各类媒体平台和行业机构力量，开展投资者教育工作。在中国基金业协会的指导下，公司深入三四线城市和校园，开展多层次的投教活动，内容涵盖基金投资基础知识和进阶经济金融专业讲座。2023 年 3 月，包括公司总经理在内的 6 位投研负责人开启了为期一年的线上实盘定投，并定期提供投教与陪伴，与投资者共赴长期投资、价值投资之约。在我国国债期货合约上市 10 周年以及 30 年国债期货上市之年，公司在中国基金业协会、中国金融期货交易所的指导下，举行多场面向专业投资者的投教活动，助力行

业稳步推进金融衍生品投资，提升资本市场长期稳定性。在 2023 年“7.1”前夕，公司在延安市延长县初级中学捐助的“金鹏电教室”落地，为乡村振兴和教育事业贡献力量。

鹏扬基金以“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。公司的长远目标是成为中国资本市场上有影响力的、能持续为客户创造价值的资产管理公司。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，寻求服务投资者的最佳方案，在大资管行业迈向高阶发展的进程中行稳致远。

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总监 | 2018 年 8 月 24 日 | - | 7 | 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 日任鹏扬利泮短债债券型证券投资基金基金经理；2019 年 11 月 18 日至 2022 年 7 月 18 日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 2022 年 7 月 18 日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 2023 年 6 月 13 日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 2022 年 7 月 18 日任鹏扬景源一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2022 年 12 月 6 日至今任鹏扬中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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公司旗下管理的所有投资组合，在本报告期内不同时间窗口下(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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现涉及本基金的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的 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

2023 年上半年，全球经济动能呈现超预期的韧性。1 季度，在前期金融条件走松的背景下，美国 1、2 月非农就业数据大超预期，制造业 PMI 见底回升，服务业 PMI 以及消费数据持续较强；进入 3 月，美国与欧洲陆续出现银行风波，可能到来的信贷条件紧缩效应使得美联储加息必要性显著下降。2 季度，随着 4、5 月份经济数据持续超预期，前期硅谷银行风波引发的信贷条件收紧的担忧得到缓释。与此同时，美国核心通胀下行仍然缓慢，劳动力市场依旧紧俏，市场重新修正美国政策利率预期。

2023 年上半年，中国经济动能脉冲式修复后回落。1 季度，随着疫情防控政策放松以及房地产政策松绑，生产、消费与投资活动全面回暖。进入 2 季度，国内总量政策主动收缩，产业政策保持积极，经济动能有所放缓，消费、投资均回归正常节奏。而外需压力重新显现，出口增速出现明显回落。随着逆周期政策加码以及经济自调节因子回升，经济环比动能企稳。通货膨胀方面，由于中国地产投资承压、美国商品消费回落、海外供应链压力缓解，上半年 PPI 同比持续下滑。在国内劳动力供给充足、能源供给回升、房价低迷的背景下，上半年核心 CPI 下滑压力加大。流动性方面，2 月份资金面受贷款投放强劲、超储率较低等因素影响波动较大。但是进入 3 月，人民银行意外下调存款准备金率 25bp，降准叠加 MLF 超量续作呵护资金面预期。4 月资金面较为均衡，利率中枢在政策利率附近。进入 5 月后，信贷投放以及经济内生动能偏弱，资金面较为充裕，利率中枢回落到政策利率以下。6 月中旬人民银行提前下调政策利率，MLF 持续超量续作。信用扩张方面，1 季度社融超预期走强，企业端整体融资需求强劲，企业债券融资受前期冲击后出现企稳回升的迹象。居民端短期融资需求回暖，中长期信贷仍偏弱，政府端财政依然靠前发力。2 季度，社融同比增速转弱，有去年同期基数效应的原因，也有 1 季度超量投放之后，信贷投放节奏强调稳定和可持续的原因。当前资金活化程度仍较低，随着经济进一步回暖以及库存去化，后续大概率会出现改善。

2023 年上半年，债券市场利率先上后下，总体回落。中债综合全价指数上涨 1.22%。1 季度，在经济复苏、信贷不弱和资金面等因素影响下，利率中枢总体上移。2 季度，在经济内生动能走弱、融资趋于平稳可持续以及资金面宽裕的背景下，利率中枢总体下行，收益率曲线趋于陡峭。信用利差方面，2023 年上半年信用利差整体呈现 N 型走势。1 季度信用利差持续收窄，其中中短期品种低等级信用利差明显缩窄，市场风险偏好持续抬升。2 季度信用利差走势分化，2 年期以上中高等级产业债利差小幅走扩，2 年内信用债受到热捧，低等级城投债利差持续压缩。可转债方面，2023 年上半年中证转债指数上涨 3.37%。其中，1 季度转债市场保持平稳上行，中证转债指数上涨 3.53%。2 季度，转债市场呈现震荡走势，中证转债指数下跌 0.15%，同期正股下跌 2.48%，估值再度提升。

操作方面，本基金本报告期内继续强化资产与负债联动管理，有效控制前十大客户集中度指标，增强组合弹性。2023 年上半年资金面先紧后松，资产收益先升后降。久期策略方面，年初久期水平较低，2-3 月份随着市场利率回调，组合在负债端配合下逐步增加资产端配置。2 季度久期中性，并增加波段操作以提升组合收益。

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 0.9570%，本报告期鹏扬通利货币 B 的基金份额净值收益率为 1.0572%，本报告期鹏扬通利货币 D 的基金份额净值收益率为 0.9365%，本报告期鹏扬通利货币 E 的基金份额净值收益率为 1.0572%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，海外经济一方面面临一些中期压力，主要是货币财政条件持续性紧缩正在逐步发挥作用，以及前期大幅宽松产生的居民部门盈余也在逐步消耗。另一方面其下行的进度较慢，低于市场预期，主要是硅谷银行危机等问题，美联储一段时间内重新扩表，使得金融条件阶段性恢复；以及逆全球化使得西方国家需求大于供给，劳动力供给偏低等原因。综合来看西方经济形势可能继续表现出一定的“韧性”，向着“软着陆”的方向发展。上半年美国 CPI 在经济企稳的背景下出现快速回落，全球风险资产迎来一段甜蜜期。然而，当 CPI 回落到 4%后，继续下探到 2%的难度则较大，尤其是核心通胀将持续表现出很强的“粘性”，通胀的压力将导致海外央行紧缩预期再次抬升，当前市场已经不再预期下半年美联储转向降息。

展望 2023 年下半年，国内经济虽然仍存在很多周期性的问题和结构性的挑战，但也具备很多有利因素，随着政策的精准发力，我们认为下半年经济增长环比增速将逐步改善，全年预计能达成 5% 以上的增长目标。一方面，由于名义产出不足，居民、企业、地方政府三个部门都存在收入压力，在没有外力介入的前提下缺乏需求扩张潜力。另一方面，我们也看到很多有利的因素正在出现，并逐步发挥效用。首先，国内资产价格并未出现明显的泡沫，房地产市场过去 10 年的累计涨幅明显低于日本在泡沫期间的涨幅，而股票市场在过去两年已经下跌了 30%，目前风险溢价较高，估值相对合理，因此不太可能出现部分市场参与者担心的资产价格暴跌，进而引发资产负债表衰退的风险。其次，人民币有效汇率相较 2022 年初的高点下行了 10%，这对出口将形成约 5% 的支撑，海外需求高于预期也使得今年的外需总体并不差。同时，我们应看到，中国在全球的出口份额已经占到了非常高的比例，在相当长的时间内，中国在全球产业链的地位难以被替代。东南亚等国家的发展在取代低端制造业的同时，也形成了新的中高端工业品、消费品需求，对中国出口并非完全是坏事，也是潜在需求方的来源。综合来看，中国未来的出口形势总体还是不错的。房地产市场上，我们注意到，

地产销售在大幅下行之后，长期看有望维持在 11 亿平方米左右的面积上，而当前新开工已经下降到 9 亿平方米以下，从供给需求匹配的角度看，逻辑上未来新开工应逐步恢复到 10 亿-11 亿平方米左右，当前的新开工水平大概率已经见底。有利因素还包括居民部门消费在疫后恢复的潜力，当前消费对 GDP 的拉动只有 3%，这相对于中国强大的内需潜力而言是一个较低的比例，未来有较大的提升空间。最后，从货币信贷端来看，当前融资环境已经显著宽松，各部门融资利率在持续下降，当前信贷供给充沛，如果后续能够逐步解决存量房贷利率和中小企业融资利率的结构性问题，将会逐步改变融资需求疲弱的问题。

综合来看，我们认为，虽然中国经济在短期内面临一定周期性的压力，但长期有利因素依然存在。随着国内经济政策的逐步发力，如果后续能够精准解决当前的几个关键性问题：居民存量房贷利率倒挂、民营企业信心不足、短期需求主体不足，那么我们有理由对下半年的经济走势更加乐观一些。

当前通胀压力较小，我们尚未看到 2023 年下半年有明显的通胀压力。核心原因是能源保供以及经济处于复苏早期，出行与消费恢复只有在中期后才会给服务通胀带来潜在上涨压力。尤其是居民部门收入尚未完全恢复，消费意愿较为疲弱，核心 CPI 依然维持在较低的位置，近 3 个月环比折年率只在 0%附近，未来一段时间核心 CPI 大概率也会偏弱运行。预计到今年年底，中国 CPI 同比将小幅恢复到 1%左右。PPI 方面，受到汇率贬值、海外需求好于预期等因素影响，大宗商品价格已经开始上涨，2023 年 6 月 PPI 同比数大概率已经见底。全年看，今年的 GDP 平减指数可能落在 0%附近。

具体到金融市场上，当前市场对政策的预期总体偏低，利率曲线水平总体合理，权益风险溢价已经到偏高位置。信贷条件已经显著宽松，融资利率持续下行，居民、企业部门的融资增速有所恢复，但政府部门融资的力度显著弱于去年同期，使得信贷脉冲依然偏弱。后续发展则取决于政策能否实现如下几个核心调整：降低实际利率，对居民部门降低房贷利率尤其是存量房贷利率，对企业部门降低中小企业融资成本；中央债务置换地方债务或直接增加中央政府支出，恢复政府部门扩张，增加新的需求，直到价格回升，各部门走出负向循环；重建信心，进一步推动支持民营经济、支持消费的有力政策落地，减缓企业部门和居民部门的收缩行为。

展望 2023 年下半年债券市场，短期仍然以窄幅震荡为主，除非政策出现明显失误或遭受重大内外部风险冲击，导致经济复苏进程进一步放缓，否则利率水平很难突破前期低点。另一方面，我们认为随着经济、通胀实际数据的逐步披露，市场悲观预期可能逐步减弱，叠加年底机构止盈操作和监管政策出台等因素，债市也面临一定调整风险。信用风险方面，民企地产债在房地产市场恢复偏弱背景下的违约风险仍有待释放，受土地出让收入减少和地方政府财力不足影响，弱地区弱资质的城投债仍存在利差上行或潜在的违约风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值，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、风险管理部、监察稽核部、交易管理部、基金运营部等部门负责人及相关业务骨干，估值委员会成员中不包括基金经理)。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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，本基金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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,458,567,976.31 | 1,612,432,458.59 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 5,540.53 | 45,875.38 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 4,389,564,070.09 | 3,424,657,857.88 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 4,389,564,070.09 | 3,424,657,857.88 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 1,134,920,958.01 | 660,912,734.90 |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 57,596,997.87 | 5,416,789.72 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 7,040,655,542.81 | 5,703,465,716.47 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 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 | | 154,045,153.01 | 281,045,781.04 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 655,118.46 | 35,389.00 |
| 应付管理人报酬 | | 1,264,516.90 | 663,067.60 |
| 应付托管费 | | 316,129.24 | 165,766.90 |
| 应付销售服务费 | | 490,936.30 | 340,842.47 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 23,553.92 | 11,638.99 |
| 应付利润 | | 360,411.73 | 609,684.71 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 365,374.90 | 324,543.75 |
| 负债合计 | | 157,521,194.46 | 283,196,714.46 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 6,883,134,348.35 | 5,420,269,002.01 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | - | - |
| 净资产合计 | | 6,883,134,348.35 | 5,420,269,002.01 |
| 负债和净资产总计 | | 7,040,655,542.81 | 5,703,465,716.47 |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 6,883,134,348.35 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 120,217,009.88 份；鹏扬通利货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 4,836,879,687.20 份；鹏扬通利货币 D 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,777,535,125.63 份；鹏扬通利货币 E 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 148,502,525.64 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏扬现金通利货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------|---------------------------------|---------------------------------|
| | | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 一、营业总收入 | | 71,459,981.97 | 17,736,766.17 |
| 1. 利息收入 | | 29,561,284.88 | 6,914,443.42 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 16,910,556.08 | 2,808,535.86 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资 | | 12,650,728.80 | 4,105,907.56 |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 产收入 | | | |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 41,898,697.09 | 10,822,322.75 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 41,898,697.09 | 10,822,322.75 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | - | - |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 11,548,694.45 | 2,882,749.06 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 5,877,989.09 | 1,559,459.02 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,469,497.27 | 411,335.14 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 2,474,869.04 | 144,140.38 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 1,540,241.57 | 605,759.28 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,540,241.57 | 605,759.28 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 8,651.64 | 5,417.21 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.19 | 177,445.84 | 156,638.03 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 59,911,287.52 | 14,854,017.11 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 59,911,287.52 | 14,854,017.11 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 59,911,287.52 | 14,854,017.11 |

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | |
|--|--|--------|----------------|--------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 5,420,269,002.01 | - | - | 5,420,269,002.01 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 5,420,269,002.01 | - | - | 5,420,269,002.01 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 1,462,865,346.34 | - | - | 1,462,865,346.34 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 59,911,287.52 | 59,911,287.52 |
| （二）、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） | 1,462,865,346.34 | - | - | 1,462,865,346.34 |
| 其中：1. 基金申购款 | 21,764,820,766.51 | - | - | 21,764,820,766.51 |
| 2. 基金赎回款 | -20,301,955,420.17 | - | - | -20,301,955,420.17 |
| （三）、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） | - | - | -59,911,287.52 | -59,911,287.52 |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 6,883,134,348.35 | - | - | 6,883,134,348.35 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |

| | | | | |
|--|-------------------|---|----------------|-------------------|
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 1,058,342,486.49 | - | - | 1,058,342,486.49 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 1,058,342,486.49 | - | - | 1,058,342,486.49 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 2,375,251,517.04 | - | - | 2,375,251,517.04 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 14,854,017.11 | 14,854,017.11 |
| （二）、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） | 2,375,251,517.04 | - | - | 2,375,251,517.04 |
| 其中：1. 基金申购款 | 7,224,043,592.62 | - | - | 7,224,043,592.62 |
| 2. 基金赎回款 | -4,848,792,075.58 | - | - | -4,848,792,075.58 |
| （三）、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） | - | - | -14,854,017.11 | -14,854,017.11 |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 3,433,594,003.53 | - | - | 3,433,594,003.53 |

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，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。

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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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征增值税试点的通知》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 2023 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款 | 1,304,253.43 |
| 等于：本金 | 1,303,837.46 |
| 加：应计利息 | 415.97 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | 1,457,263,722.88 |

| | |
|----------------|------------------|
| 等于：本金 | 1,450,000,000.00 |
| 加：应计利息 | 7,263,722.88 |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | 501,215,722.31 |
| 存款期限 3 个月以上 | 956,048,000.57 |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 1,458,567,976.31 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | |
|----|--------|------------------------|------------------|------------|----------|
| | | 按实际利率计算的账面价值 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 |
| 债券 | 交易所市场 | 100,024,000.00 | 100,004,000.00 | -20,000.00 | -0.0003% |
| | 银行间市场 | 4,289,540,070.09 | 4,289,924,691.76 | 384,621.67 | 0.0056% |
| | 合计 | 4,389,564,070.09 | 4,389,928,691.76 | 364,621.67 | 0.0053% |
| | 资产支持证券 | - | - | - | - |
| | 合计 | 4,389,564,070.09 | 4,389,928,691.76 | 364,621.67 | 0.0053% |

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 2023 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 | 1,134,920,958.01 | - |
| 合计 | 1,134,920,958.01 | - |

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 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023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 | - |
| 应付交易费用 | 142,019.56 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 142,019.56 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 223,355.34 |
| 合计 | 365,374.90 |

6.4.7.7 实收基金

单位：人民币元

| 鹏扬通利货币 A | | |
|---------------|-----------------------------|-----------------|
| 项目 | 本期 2023年1月1日至 2023年6月30日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 110,303,470.92 | 110,303,470.92 |
| 本期申购 | 279,612,608.62 | 279,612,608.62 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -269,699,069.66 | -269,699,069.66 |
| 本期末 | 120,217,009.88 | 120,217,009.88 |

单位：人民币元

| 鹏扬通利货币 B | | |
|---------------|-----------------------------|--------------------|
| 项目 | 本期 2023年1月1日至 2023年6月30日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,854,451,749.91 | 2,854,451,749.91 |
| 本期申购 | 12,877,614,485.33 | 12,877,614,485.33 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -10,895,186,548.04 | -10,895,186,548.04 |

| | | |
|-----|------------------|------------------|
| 本期末 | 4,836,879,687.20 | 4,836,879,687.20 |
|-----|------------------|------------------|

单位：人民币元

| 鹏扬通利货币 D | | |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,454,873,610.68 | 2,454,873,610.68 |
| 本期申购 | 7,925,783,539.95 | 7,925,783,539.95 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -8,603,122,025.00 | -8,603,122,025.00 |
| 本期末 | 1,777,535,125.63 | 1,777,535,125.63 |

单位：人民币元

| 鹏扬通利货币 E | | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 640,170.50 | 640,170.50 |
| 本期申购 | 681,810,132.61 | 681,810,132.61 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -533,947,777.47 | -533,947,777.47 |
| 本期末 | 148,502,525.64 | 148,502,525.64 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额、货币基金升级等；总赎回份额含转换出份额、货币基金降级等。

6.4.7.8 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 | 1,082,736.38 | - | 1,082,736.38 |
| 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 | -1,082,736.38 | - | -1,082,736.38 |
| 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 | 41,550,124.87 | - | 41,550,124.87 |
| 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 | -41,550,124.87 | - | -41,550,124.87 |
| 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 | 15,962,477.09 | - | 15,962,477.09 |
| 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 | -15,962,477.09 | - | -15,962,477.09 |
| 本期末 | - | - | - |

单位：人民币元

| 鹏扬通利货币 E | | | |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 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 | 1,315,949.18 | - | 1,315,949.18 |
| 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 | -1,315,949.18 | - | -1,315,949.18 |
| 本期末 | - | - | - |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 4,948.71 |
| 定期存款利息收入 | 16,896,889.93 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 8,612.97 |
| 其他 | 104.47 |
| 合计 | 16,910,556.08 |

6.4.7.10 股票投资收益

无。

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

| 项目 | 本期 |
|----------------------------------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 40,608,033.47 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入 | 1,290,663.62 |
| 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 | 41,898,697.09 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 11,032,356,355.98 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 11,002,808,701.71 |
| 减：应计利息总额 | 28,256,990.65 |
| 减：交易费用 | - |
| 买卖债券差价收入 | 1,290,663.62 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

无。

6.4.7.16 公允价值变动收益

无。

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 审计费用 | 54,547.97 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费 | 18,600.00 |
| 银行费用 | 44,790.50 |
| 合计 | 177,445.84 |

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、基金代销机构 |
| 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 2023年1月1日 至2023年6月30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日 至2022年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,877,989.09 | 1,559,459.02 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,260,947.48 | 73,371.53 |

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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 2023年1月1日 至2023年6月30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日 至2022年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,469,497.27 | 411,335.14 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 | 66,415.45 | 118,548.84 | - | 543.46 | 185,507.75 |
| 建设银行 | 10,375.37 | 27.96 | - | - | 10,403.33 |
| 合计 | 76,790.82 | 118,576.80 | - | 543.46 | 195,911.08 |
| 获得销售服务费 的各关联方名称 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 | 53,503.72 | 56,590.19 | - | 0.85 | 110,094.76 |
| 建设银行 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 53,503.72 | 56,590.19 | - | 0.85 | 110,094.76 |

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。销售服务费的计算方法如下：

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

H 为每日该类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

(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 在 2020 年 8 月 27 日至 2022 年 4 月 5 日期间无份额。

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 |
|----|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 | - | 26,265,050.44 | - | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | 118,525,704.45 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | 139,645,456.96 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | - | 5,145,297.93 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 0.07% | - | - |

| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 | - | 84,007,422.77 | - | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 3,762,576.45 | 183,997,029.78 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | 268,004,452.55 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 3,762,576.45 | - | - | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.11% | - | - | - |

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 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 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 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的 |
| | | | | |

| | | 比例 | | 比例 |
|-----|-----------|-------|--------------|-------|
| 杨爱斌 | 11,605.39 | 0.00% | 4,161,554.50 | 0.08% |

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 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 | 1,304,253.43 | 4,948.71 | 1,384,696.41 | 2,416.33 |

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 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 1,088,767.17 | - | -6,030.79 | 1,082,736.38 | - |

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 |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 41,627,140.14 | - | -77,015.27 | 41,550,124.87 | - |

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 |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 16,136,671.27 | - | -174,194.18 | 15,962,477.09 | - |

鹏扬通利货币 E

| 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 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 1,307,981.92 | - | 7,967.26 | 1,315,949.18 | - |

6.4.12 期末（2023 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

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 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 154,045,153.01 元，是以如下债券作为质押：

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 |
|--------|----------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 220306 | 22 进出 06 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.54 | 1,588,000 | 161,237,908.38 |
| 合计 | | | | 1,588,000 | 161,237,908.38 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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、风险管理部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同责任，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。

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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 890,736,470.58 | 522,911,575.70 |
| 合计 | 890,736,470.58 | 522,911,575.70 |

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。

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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 3,498,827,599.51 | 2,804,343,210.63 |
| 合计 | 3,498,827,599.51 | 2,804,343,210.63 |

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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | - | 97,403,071.55 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | - | 97,403,071.55 |

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。

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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 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。

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。

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 2023 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------------|------------------|-------|-------|---------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 1,458,567,976.31 | - | - | - | 1,458,567,976.31 |
| 存出保证金 | 5,540.53 | - | - | - | 5,540.53 |
| 交易性金融资产 | 4,389,564,070.09 | - | - | - | 4,389,564,070.09 |
| 买入返售金融资产 | 1,134,920,958.01 | - | - | - | 1,134,920,958.01 |
| 应收申购款 | - | - | - | 57,596,997.87 | 57,596,997.87 |
| 资产总计 | 6,983,058,544.94 | - | - | 57,596,997.87 | 7,040,655,542.81 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 154,045,153.01 | - | - | - | 154,045,153.01 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 655,118.46 | 655,118.46 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,264,516.90 | 1,264,516.90 |
| 应付托管费 | - | - | - | 316,129.24 | 316,129.24 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 490,936.30 | 490,936.30 |
| 应交税费 | - | - | - | 23,553.92 | 23,553.92 |
| 应付利润 | - | - | - | 360,411.73 | 360,411.73 |
| 其他负债 | - | - | - | 365,374.90 | 365,374.90 |
| 负债总计 | 154,045,153.01 | - | - | 3,476,041.45 | 157,521,194.46 |
| 利率敏感度缺口 | 6,829,013,391.93 | - | - | 54,120,956.42 | 6,883,134,348.35 |
| 上年度末 2022 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 | 1,612,432,458.59 | - | - | - | 1,612,432,458.59 |
| 存出保证金 | 45,875.38 | - | - | - | 45,875.38 |
| 交易性金融资产 | 3,424,657,857.88 | - | - | - | 3,424,657,857.88 |

| | | | | | |
|-----------|------------------|---|---|--------------|------------------|
| 买入返售金融资产 | 660,912,734.90 | - | - | - | 660,912,734.90 |
| 应收申购款 | - | - | - | 5,416,789.72 | 5,416,789.72 |
| 资产总计 | 5,698,048,926.75 | - | - | 5,416,789.72 | 5,703,465,716.47 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 281,045,781.04 | - | - | - | 281,045,781.04 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 35,389.00 | 35,389.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 663,067.60 | 663,067.60 |
| 应付托管费 | - | - | - | 165,766.90 | 165,766.90 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 340,842.47 | 340,842.47 |
| 应交税费 | - | - | - | 11,638.99 | 11,638.99 |
| 应付利润 | - | - | - | 609,684.71 | 609,684.71 |
| 其他负债 | - | - | - | 324,543.75 | 324,543.75 |
| 负债总计 | 281,045,781.04 | - | - | 2,150,933.42 | 283,196,714.46 |
| 利率敏感度缺口 | 5,417,003,145.71 | - | - | 3,265,856.30 | 5,420,269,002.01 |

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。

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

本基金本报告期末未持有外币计价的资产和负债，因此无重大外汇风险。

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

本基金主要投资于固定收益类品种，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 4,389,564,070.09 | 3,424,657,857.88 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 4,389,564,070.09 | 3,424,657,857.88 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券，若不存在活跃市场未经调整的报价(包括重大事项、新发未上市等原因所致)，本基金不会将此类证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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 | 4,389,564,070.09 | 62.35 |
| | 其中：债券 | 4,389,564,070.09 | 62.35 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,134,920,958.01 | 16.12 |
| | 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 | 1,458,567,976.31 | 20.72 |
| 4 | 其他各项资产 | 57,602,538.40 | 0.82 |
| 5 | 合计 | 7,040,655,542.81 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例 (%) | |
|----|--------------|----------------|----------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | | 3.01 |
| | 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 | 154,045,153.01 | 2.24 |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例取报告期内每交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

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 | 72 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 77 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 29 |

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 | 30.45 | 2.24 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 11.04 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 31.13 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 10.87 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 17.70 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 101.20 | 2.24 |

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 | 按实际利率计算账面价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|------------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 49,964,096.03 | 0.73 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 336,008,685.00 | 4.88 |
| | 其中：政策性金融债 | 336,008,685.00 | 4.88 |
| 4 | 企业债券 | 100,024,000.00 | 1.45 |
| 5 | 企业短期融资券 | 404,739,689.55 | 5.88 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 3,498,827,599.51 | 50.83 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 4,389,564,070.09 | 63.77 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

7.6 期末按实际利率计算账面价值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） | 按实际利率计算 账面价值 | 占基金资产净 值比例（%） |
|----|-----------|-----------------|-----------|-----------------|------------------|
| 1 | 112214097 | 22 江苏银行 CD097 | 3,000,000 | 299,821,415.17 | 4.36 |
| 2 | 112311089 | 23 平安银行 CD089 | 3,000,000 | 298,493,576.86 | 4.34 |
| 3 | 112313111 | 23 浙商银行 CD111 | 2,000,000 | 199,212,347.88 | 2.89 |
| 4 | 112303125 | 23 农业银行 CD125 | 2,000,000 | 199,042,320.45 | 2.89 |
| 5 | 112303127 | 23 农业银行 CD127 | 2,000,000 | 198,995,576.11 | 2.89 |
| 6 | 112303134 | 23 农业银行 CD134 | 2,000,000 | 198,941,279.15 | 2.89 |
| 7 | 112310085 | 23 兴业银行 CD085 | 2,000,000 | 198,183,516.07 | 2.88 |
| 8 | 112380416 | 23 北京农商银行 CD140 | 2,000,000 | 198,096,941.28 | 2.88 |
| 9 | 220306 | 22 进出 06 | 1,600,000 | 162,456,330.86 | 2.36 |
| 10 | 012283907 | 22 首钢 SCP006 | 1,000,000 | 101,162,560.73 | 1.47 |

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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 | 0.0336% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0101% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0185% |

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 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

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

本基金对所持有的交易性金融资产按照实际利率法估算并采用影子定价和偏离度控制确定其公允价值，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，并于每一估值日以“影子定价”和偏离度控制确定金融资产的公允价值。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，江苏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、兴业银行股份有限公司、北京农村商业银行股份有限公司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。江苏银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会或其派出机构的处罚。江苏银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会的处罚。

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。

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 | 5,540.53 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 57,596,997.87 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 57,602,538.40 |

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 | 4,712 | 25,512.95 | 51,963,578.52 | 43.22% | 68,253,431.36 | 56.78% |

| | | | | | | |
|----------|---------|---------------|------------------|--------|------------------|---------|
| 利货币 A | | | | | | |
| 鹏扬通利货币 B | 82 | 58,986,337.65 | 4,831,502,967.67 | 99.89% | 5,376,719.53 | 0.11% |
| 鹏扬通利货币 D | 296,812 | 5,988.76 | 139.17 | 0.00% | 1,777,534,986.46 | 100.00% |
| 鹏扬通利货币 E | 19,066 | 7,788.87 | 3,453,611.22 | 2.33% | 145,048,914.42 | 97.67% |
| 合计 | 320,672 | 21,464.72 | 4,886,920,296.58 | 71.00% | 1,996,214,051.77 | 29.00% |

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 | 601,473,956.11 | 8.74% |
| 2 | 银行类机构 | 301,083,172.81 | 4.37% |
| 3 | 银行类机构 | 203,589,474.63 | 2.96% |
| 4 | 券商类机构 | 202,110,174.84 | 2.94% |
| 5 | 券商类机构 | 200,245,431.27 | 2.91% |
| 6 | 基金类机构 | 200,114,601.38 | 2.91% |
| 7 | 银行类机构 | 200,037,520.59 | 2.91% |
| 8 | 基金类机构 | 200,026,033.60 | 2.91% |
| 9 | 保险类机构 | 140,000,000.00 | 2.03% |
| 10 | 银行类机构 | 102,217,713.46 | 1.49% |

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 | 7,400,952.90 | 6.1563% |
| | 鹏扬通利货币 B | - | - |
| | 鹏扬通利货币 D | 5,536.46 | 0.0003% |
| | 鹏扬通利货币 E | 3,340,809.24 | 2.2497% |
| | 合计 | 10,747,298.60 | 0.1561% |

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、基金投资和研发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 |
| | 鹏扬通利货币 B | 0 |
| | 鹏扬通利货币 D | 0 |
| | 鹏扬通利货币 E | 0~10 |
| | 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 | 110,303,470.92 | 2,854,451,749.91 | 2,454,873,610.68 | 640,170.50 |
| 本报告期基金总申购份额 | 279,612,608.62 | 12,877,614,485.33 | 7,925,783,539.95 | 681,810,132.61 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 269,699,069.66 | 10,895,186,548.04 | 8,603,122,025.00 | 533,947,777.47 |
| 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 | 120,217,009.88 | 4,836,879,687.20 | 1,777,535,125.63 | 148,502,525.64 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额、货币基金升级等；总赎回份额含转换出份额、货币基金降级等。

§ 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

10.6.1 管理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。

10.6.2 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，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 | |
| 财通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 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，安信证券和财通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 | | 基金交易 | |
|------|---------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | 49,999,900.00 | 100.00% | 1,000,000.00 | 0.56% | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | 100,000,000.00 | 56.50% | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | 76,000,000.00 | 42.94% | - | - | - | - |

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 | 鹏扬现金通利货币市场基金暂停及恢复大额申购(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 | 2023 年 1 月 17 日 |
| 2 | 鹏扬现金通利货币市场基金 2022 年第 4 季度报告 | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2023 年 1 月 20 日 |
| 3 | 鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与天天基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2023 年 2 月 8 日 |
| 4 | 鹏扬基金管理有限公司关于开展直销电子交易平台货币基金转换优惠费率率的公告 | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2023 年 2 月 13 日 |
| 5 | 鹏扬基金管理有限公司关于在直销电子交易平台新增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 | 2023 年 3 月 23 日 |
| 6 | 鹏扬现金通利货币市场基金 2022 年年度报告 | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2023 年 3 月 29 日 |
| 7 | 鹏扬现金通利货币市场基金 2023 年第 1 季度报告 | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2023 年 4 月 22 日 |
| 8 | 鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万得基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2023 年 4 月 25 日 |
| 9 | 鹏扬现金通利货币市场基金暂停及恢复大额申购(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 | 2023 年 4 月 25 日 |
| 10 | 鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2023 年 6 月 9 日 |
| 11 | 鹏扬现金通利货币市场基金暂停及恢复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 | 2023 年 6 月 16 日 |
| 12 | 鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2023 年 6 月 28 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准鹏扬现金通利货币市场基金募集的文件；
2. 《鹏扬现金通利货币市场基金基金合同》；
3. 《鹏扬现金通利货币市场基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
6. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

鹏扬基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日