

2016 年度鹏华货币基金半年度报告

公告日期：2016-08-29

流水号：FB02201608260570

目录全部展开 目录全部收拢

重要提示

基金产品概况

基金基本情况

基金产品说明

基金管理人和基金托管人

信息披露方式

其他相关资料

主要财务指标、基金净值表现

主要会计数据和财务指标

基金净值表现

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

管理人报告

基金管理人及基金经理情况

基金管理人及其管理基金的经验

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

公平交易制度的执行情况

公平交易制度和控制方法

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

异常交易行为的专项说明

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金的业绩表现

报告期内基金投资策略和运作分析

管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

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

托管人报告

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

半年度财务会计报告（未经审计）

资产负债表

利润表

所有者权益（基金净值）变动表
报表附注
基金基本情况
会计报表的编制基础
遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
重要会计政策和会计估计
会计年度
记账本位币
金融资产和金融负债的分类
金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认
金融资产和金融负债的估值原则
金融资产和金融负债的抵销
实收基金
损益平准金
收入/(损失)的确认和计量
费用的确认和计量
基金的收益分配政策
其他重要的会计政策和会计估计
会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
会计政策变更的说明
会计估计变更的说明
差错更正的说明
税项
重要财务报表项目的说明
银行存款
交易性金融资产
衍生金融资产/负债
买入返售金融资产
各项买入返售金融资产期末余额
期末买断式逆回购交易中取得的债券
应收利息
其他资产
应付交易费用
其他负债
实收基金
未分配利润
存款利息收入
股票投资收益
股票投资收益项目构成
股票投资收益——买卖股票差价收入
股票投资收益——赎回差价收入
股票投资收益——申购差价收入
基金投资收益
债券投资收益

债券投资收益项目构成
债券投资收益——买卖债券差价收入
债券投资收益——赎回差价收入
债券投资收益——申购差价收入
资产支持证券投资收益
贵金属投资收益
贵金属投资收益项目构成
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入
贵金属投资收益——赎回差价收入
衍生工具收益
衍生工具收益——买卖权证差价收入
衍生工具收益——其他投资收益
股利收益
公允价值变动收益
其他收入
交易费用
其他费用
分部报告
或有事项、资产负债表日后事项的说明
或有事项
资产负债表日后事项
关联方关系
本报告期及上年度可比期间的关联方交易
通过关联方交易单元进行的交易
股票交易
权证交易
应支付关联方的佣金
关联方报酬
基金管理费
基金托管费
销售服务费
与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
各关联方投资本基金的情况
报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
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
由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
其他关联交易事项的说明
利润分配情况
利润分配情况——货币市场基金
期末本基金持有的流通受限证券
因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
期末持有的暂时停牌等流通受限股票
期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购
交易所市场债券正回购
金融工具风险及管理
风险管理政策和组织架构
信用风险
按短期信用评级列示的债券投资
按长期信用评级列示的债券投资
流动性风险
金融资产和金融负债的到期期限分析
市场风险
利率风险
利率风险敞口
利率风险的敏感性分析
外汇风险
外汇风险敞口
外汇风险的敏感性分析
其他价格风险
其他价格风险敞口
其他价格风险的敏感性分析
采用风险价值法管理风险
有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
投资组合报告
期末基金资产组合情况
债券回购融资情况
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明
基金投资组合平均剩余期限
投资组合平均剩余期限基本情况
报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明
期末投资组合平均剩余期限分布比例
期末按债券品种分类的债券投资组合
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
“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
投资组合报告附注
基金计价方法说明
受到调查以及处罚情况
期末其他各项资产构成
投资组合报告附注的其他文字描述部分
基金份额持有人信息
期末基金份额持有人户数及持有人结构
期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
开放式基金份额变动
重大事件揭示
基金份额持有人大会决议

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
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
基金投资策略的改变
为基金进行审计的会计师事务所情况
管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
基金租用证券公司交易单元的有关情况
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
偏离度绝对值超过 0.5%的情况
其他重大事件
发起式基金发起资金持有份额情况
影响投资者决策的其他重要信息
备查文件目录

重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金名称

鹏华货币市场证券投资基金

基金简称

鹏华货币

场内简称

-

基金主代码

160606

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2005-04-12

基金管理人

鹏华基金管理有限公司

基金托管人

中国农业银行股份有限公司

报告期末基金份额总额

57,646,430,920.61

基金合同存续期

不定期

下属 2 级基金的基金简称

鹏华货币 A

鹏华货币 B

下属 2 级基金的场内简称

-

-

下属 2 级基金的交易代码

160606

160609

报告期末下属 2 级基金的份额总额

490514602.98

57155916317.63

基金产品说明

投资目标

在保证资产安全与资产充分流动性的前提下，为投资者追求稳定的现金收益。

投资策略

在战略资产配置上，主要采取利率预期与组合久期控制相结合的策略，在战术资产操作上，主要采取滚动投资、关键时期的时机抉择策略，并结合市场环境适时进行回购套利等操作。

业绩比较基准

活期存款税后利率（即活期存款利率×（1-利息税率））

风险收益特征

本基金属于货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种；长期平均的风险和预期收益低于成长型基金、价值型基金、指数型基金、纯债券基金。

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

鹏华基金管理有限公司

中国农业银行股份有限公司

信息披露负责人

姓名

张戈

林葛

联系电话

0755-82825720

010-66060069

电子邮箱

zhangge@phfund.com.cn

tgxxpl@abchina.com

客户服务电话

4006788999

95599

传真

0755-82021126

010-68121816

注册地址

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码

518048

100031

法定代表人

何如

周慕冰

信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称

《中国证券报》、《上海证券报》、《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.phfund.com>

基金年度报告备置地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 中国农业银行股份有限公司

其他相关资料

项目

名称

办公地址

注册登记机构

中国证券登记结算有限责任公司

北京市西城区太平桥大街 17 号

主要会计数据和财务指标

金额单位：

期间数据和指标

报告期（2016-01-01 至 2016-06-30）

鹏华货币

鹏华货币 A

鹏华货币 B

本期已实现收益

-

6,753,308.22

635,041,783.52

本期利润

-

6,753,308.22

635,041,783.52

加权平均基金份额本期利润

-

-

-

本期加权平均净值利润率

-%

-%

-%

本期基金份额净值增长率

-%

-%

-%

本期净值收益率

-%

1.2163%

1.3376%

期末数据和指标

报告期末（2016-06-30）

鹏华货币

鹏华货币 A

鹏华货币 B

期末可供分配利润

-

-

-

期末可供分配基金份额利润

-

-

-

期末基金资产净值

-

490,514,602.98

57,155,916,317.63

期末基金份额净值

-

1.0000

1.0000

累计期末指标

报告期末（2016-06-30）

鹏华货币
 鹏华货币 A
 鹏华货币 B
 基金份额累计净值增长率
 -%
 -%
 -%
 累计净值收益率
 -%
 39.5957%
 42.9095%
 期末还原后基金份额累计净值

-
 -
 -

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；

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

（3）表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日；

（4）基金收益分配按月结转份额。

基金净值表现

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 A
 阶段

净值收益率①

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

0.1942%

0.0006%

0.0288%

0.0000%

0.1654%

0.0006%

过去三个月

0.5902%

0.0006%

0.0873%

0.0000%

0.5029%

0.0006%

过去六个月

1.2163%

0.0005%

0.1745%

0.0000%

1.0418%

0.0005%

过去一年

2.5913%

0.0013%

0.3510%

0.0000%

2.2403%

0.0013%

过去三年

11.6106%

0.0046%

1.0510%

0.0000%

10.5596%

0.0046%

自基金合同生效起至今

39.5957%

0.0051%

8.9010%

0.0020%

30.6947%

0.0031%

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 B
阶段

净值收益率①

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

0.2138%

0.0006%

0.0288%

0.0000%

0.1850%

0.0006%

过去三个月

0.6501%

0.0006%

0.0873%

0.0000%

0.5628%

0.0006%

过去六个月

1.3376%

0.0005%

0.1745%

0.0000%

1.1631%

0.0005%

过去一年

2.8380%

0.0013%

0.3510%

0.0000%

2.4870%

0.0013%

过去三年

12.4155%

0.0046%

1.0510%

0.0000%

11.3645%

0.0046%

自基金合同生效起至今

42.9095%

0.0052%

8.9010%

0.0020%

34.0085%

0.0032%

注：业绩比较基准=活期存款税后利率（即活期存款利率×（1-利息税率））

自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较 A

自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较 B

注：1、本基金合同于 2005 年 4 月 12 日生效。

2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

基金管理人及基金经理情况

基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本 8,000 万元人民币，后于 2001 年 9 月完成增资扩股，增至 15,000 万元人民币。截止 2016 年 6 月，公司管理资产总规模达到 3609.67 亿元，管理 99 只公募基金、10 只全国社保投资组合。经过近 18 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

基金经理（或基金经理小组）简介

姓名

职务

任本基金的基金经理期限

证券从业年限

说明

任职日期

离任日期

刘建岩

本基金基金经理

2014-05-27

-

10

刘建岩先生，国籍中国，经济学硕士，10 年证券从业经验。历任第一创业证券有限责任公司资管部投资经理；2009 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券研究分析工作，担任固定收益部债券研究员，2011 年 4 月起担任鹏华信用增利债券基金基金经理，2013 年 2 月至 2014 年 3 月担任鹏华产业债债券基金基金经理，2013 年 3 月至 2016 年 5 月兼任鹏华国企债债券基金基金经理，2013 年 11 月至 2016 年 5 月兼任鹏华丰融定期开放债券基金基金经理，2014 年 5 月起兼任鹏华货币基金基金经理，2015 年 3 月起兼任鹏华双债增利债券基金基金经理。刘建岩先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

公平交易制度和控制方法

-
本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-
异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与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的 5%的情况。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

-
报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年货币市场整体保持宽松,仅在季末及半年末时点受 MPA 考核和缴税等因素影响出现短期波动。上半年央行没有调整存、贷款基准利率,仅将法定存款准备金率下调 0.5 个百分点。从中短期债券市场情况看,一季度整体较为稳定,4 月投资者对内、外部政策的预期有所变化,推动收益率出现一定上升,但随后市场预期趋于稳定,在流动性宽松的带动下债券收益率再次下行。

从货币市场变化情况看,公开市场操作是央行最重要的货币调控手段,主要利用短期政策工具调节市场流动性。但是从公开市场利率情况看,上半年央行并没有下调短期回购利率,公开市场 7 天逆回购利率一直在 2.25%保持稳定。与 2015 年末相比较,上半年银行间 3 个月 Shibor 利率下降约 12bp 至 2.97%,6 个月 Shibor 利率下降约 21bp 至 2.99%。

本报告期内货币基金以配置存款类资产为主,组合久期保持中等水平。

报告期内基金的业绩表现

2016 年上半年本基金 A 类份额净值增长率为 1.2163%,B 类份额净值增长率为 1.3376%,同期业绩基准增长率为 0.1745%。

管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

基金的估值由基金会计负责,基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体,独立建账、独立核算,保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理;每日按时接收成交数据及权益数据,进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式,每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对;每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外,还设有基金会计复核岗位,负责基金会计核算的日常事后复核工作,确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格,在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验,熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

4.6.3 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在本报告期累计分配收益 641,887,086.71 元,利润分配金额、方式等符合相关法规和本基金基金合同的规定。

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

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
无。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管鹏华货币证券投资基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《鹏华货币证券投资基金基金合同》、《鹏华货币证券投资基金托管协议》的约定,对鹏华货币证券投资基金管理人—鹏华基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,除 2016 年 2 月 1 日至 3 日以及 2016 年 2 月 26 日,鹏华货币证券投资基金,其现金、国债、中央银行票据、政策性金融债占基金资产净值的比例低于 5%,违反了 2 月 1 日起实施的《货币市场基金监督管理办法》关于现金、国债、中央银行票据、政策性金融债占基金资产净值的比例合计不得低于 5%的规定。鹏华基金管理有限公司在鹏华货币证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,鹏华基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的鹏华货币证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

资产负债表

会计主体:鹏华货币市场证券投资基金

报告截止日:2016-06-30

单位:

资产

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

资产:

银行存款

42,975,049,446.68

27,375,107,827.97

结算备付金

-

476,190.48

存出保证金

-

-

交易性金融资产

13,149,151,117.54

8,466,869,579.61

其中：股票投资

-

-

基金投资

-

-

债券投资

13,149,151,117.54

8,466,869,579.61

资产支持证券投资

-

-

贵金属投资

-

-

衍生金融资产

-

-

买入返售金融资产

1,000,000,500.00

16,471,323,023.37

应收证券清算款

200,047,465.39

-

应收利息

276,481,997.06

232,544,405.08

应收股利

-

-

应收申购款

290,913,957.40

622,519,790.54

递延所得税资产

-

-

其他资产

-

-

资产总计

57,891,644,484.07

53,168,840,817.05

负债和所有者权益

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

负债：

短期借款

-

-

交易性金融负债

-

-

衍生金融负债

-

-

卖出回购金融资产款

-

-

应付证券清算款

151,599,197.82

1,500,000,000.00

应付赎回款

1,255,580.49

1,392,374.88

应付管理人报酬

13,108,203.70

8,703,204.05

应付托管费

3,972,182.92

2,637,334.55

应付销售服务费

487,782.04

412,379.19

应付交易费用

124,536.31

104,484.40

应交税费

66,600.00

66,600.00

应付利息

-

-

应付利润

74,485,015.45

62,432,862.02

递延所得税负债

-
-
其他负债
114,464.73
225,504.92
负债合计
245,213,563.46
1,575,974,744.01
所有者权益：
实收基金
57,646,430,920.61
51,592,866,073.04
未分配利润

-
-
所有者权益合计
57,646,430,920.61
51,592,866,073.04
负债和所有者权益总计
57,891,644,484.07
53,168,840,817.05

注：注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 57,646,430,920.61 份。基金份额净值 A 级 1.0000 元，B 级 1.0000 元；基金份额总额 A 级 490,514,602.98 份，B 级 57,155,916,317.63 份。

利润表

会计主体：鹏华货币市场证券投资基金

本报告期：2016-01-01 至 2016-06-30

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

一、收入

750,998,996.10

207,321,662.08

1.利息收入

748,989,926.35

204,936,827.97

其中：存款利息收入

561,478,251.76

107,032,317.08

 债券利息收入

150,489,227.40

60,827,273.57
 资产支持证券利息收入
-
-
 买入返售金融资产收入
37,022,447.19
37,077,237.32
 其他利息收入
-
-
2.投资收益（损失以“-”填列）
2,009,069.75
2,384,834.11
其中：股票投资收益
-
-
 基金投资收益
-
-
 债券投资收益
2,009,069.75
2,384,834.11
 资产支持证券投资收益
-
-
 贵金属投资收益
-
-
 衍生工具收益
-
-
 股利收益
-
-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）
-
-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）
-
-
5.其他收入（损失以“-”号填列）
-
-
减：二、费用

109,203,904.36
22,161,505.02
1. 管理人报酬
79,217,955.66
15,045,517.01
2. 托管费
24,005,441.01
4,559,247.61
3. 销售服务费
3,068,717.39
1,836,275.24
4. 交易费用
294.00
-
5. 利息支出
2,658,878.98
483,881.57
其中：卖出回购金融资产支出
2,658,878.98
483,881.57
6. 其他费用
252,617.32
236,583.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）
641,795,091.74
185,160,157.06
减：所得税费用
-
-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）
641,795,091.74
185,160,157.06
所有者权益（基金净值）变动表
会计主体：鹏华货币市场证券投资基金
本报告期：2016-01-01 至 2016-06-30
单位：
项目
本期
2016-01-01 至 2016-06-30
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）
51,592,866,073.04

-

51,592,866,073.04

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）

-

641,795,091.74

641,795,091.74

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）

6,053,564,847.57

-

6,053,564,847.57

其中：1.基金申购款

131,240,570,051.96

-

131,240,570,051.96

 2.基金赎回款

-125,187,005,204.39

-

-125,187,005,204.39

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）

-

-641,795,091.74

-641,795,091.74

五、期末所有者权益（基金净值）

57,646,430,920.61

0.00

57,646,430,920.61

项目

上年度可比期间

至

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）

12,182,547,251.22

-

12,182,547,251.22

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）

-

185,160,157.06

185,160,157.06

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）

-5,912,096,881.17

-

-5,912,096,881.17

其中：1.基金申购款

37,607,175,287.03

-

37,607,175,287.03

2.基金赎回款

-43,519,272,168.20

-

-43,519,272,168.20

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）

-

-185,160,157.06

-185,160,157.06

五、期末所有者权益（基金净值）

6,270,450,370.05

0.00

6,270,450,370.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告第 6.1 页至第 6.4 页财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：邓召明

主管会计工作负责人：高鹏

会计机构负责人：

郝文高

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注

基金基本情况

鹏华货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]第 26 号《关于同意鹏华货币市场证券投资基金募集的批复》核准，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,353,255,243.01 元，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2005)第 41 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》于 2005 年 4 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,353,743,565.06 份基金份额，其中认购资金利息折合 488,322.05 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。根据《货币市场基金管理暂行规定》和《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行的、具有良好流动性的金融工具，主要包括现金、期限在一年以内(含一年)的债券回购、央行票据、银行定期存款、大额存单，剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券，以及中国证监会、中国人民银行认可的具有良好流动性的货币市场工具。本基金投资于短期金融市场投资品种的比例，不低于本基金非现金资产总值的 80%。本基金的业绩比较基准为活期存款税后利率。

根据《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》和《鹏华货币市场证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，自 2006 年 9 月 15 日起，本基金根据单个基金账户内基金份额余额，将基金份额分为不同的级别，并依据不同级别的基金份额收取不同的销售服务费。在基金存续期内的任何一个开放日，单个基金账户内保留的本基金份额超过 500 万份(包含 500 万份)时，本基金的注册登记机构自动将其单个基金账户内持有的可用基金份额升级为 B 级基金份

额,并于升级当日适用 B 级的相关费率。单个基金账户内保留的本基金份额低于 500 万份(不含 500 万份),本基金的注册登记机构自动将其单个基金账户内持有的可用基金份额降级为 A 级基金份额,并于降级当日适用 A 级的相关费率。由于基金费用的不同,本基金 A 级基金份额和 B 级基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该级别基金份额总数。

会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 上半年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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

重要会计政策和会计估计

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。

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。

记账本位币

本基金以人民币为记账本位币,除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

金融资产和金融负债的分类

6.4.4.3.1 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、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公允价值变动计入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应收款项,包括银行存款和各类应收款项等。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。

6.4.4.3.2 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。本基金目前暂无金融负债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。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。

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量,即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息,按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价;同时于每一计价日计算影子价格,以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。在资产持有期间所取得的利息以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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，以及因类别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

损益平准金

-

收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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也可按直线法计算。

基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有申请申购当日的分红权益，而赎回的

基金份额享有申请赎回当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益，基金管理人正式运作基金财产不满一个月的，不进行集中支付。基金投资当期亏损时，采用缩减基金份额持有人持有份额的方式，将基金份额净值维持在单位面值 1.00 元。基金的收益分配政策，适用于鹏华货币基金的 A、B 级所有份额。A、B 两级基金份额收取的销售服务费率不同，可能导致基金收益分配不同。

其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明

本基金本报告期没有发生会计政策变更。

会计估计变更的说明

本基金本报告期没有发生会计估计变更。

差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于 CEF]/财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》[适用于 OEF]、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入

应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：

项目

本期末

2016-06-30

活期存款

365,049,446.68

定期存款

42,610,000,000.00

其中：存款期限 1-3 个月

2,000,000,000.00

存款期限 3 个月以上

33,810,000,000.00

存款期限 1 个月以内

6,800,000,000.00

其他存款

0.00

合计

42,975,049,446.68

交易性金融资产

单位：

项目

本期末

2016-06-30

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

13,149,151,117.54

13,155,202,000.00

6,050,882.46
0.0105%
合计
13,149,151,117.54
13,155,202,000.00
6,050,882.46
0.0105%

注 (1) 偏离金额=影子定价-摊余成本;

(2) 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

衍生金融资产/负债

单位:

项目

本期末

2016-06-30

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

买入返售金融资产

各项买入返售金融资产期末余额

单位：

项目

本期末

2016-06-30

账面余额

其中：买断式逆回购

买入返售证券

800,000,000.00

-

买入返售证券_银行间

200,000,500.00

-

合计

1,000,000,500.00

-

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：元

项目

本期末

2016-06-30

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

注：截止本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

应收利息

单位：

项目

本期末

2016-06-30

应收活期存款利息

7,403.34

应收定期存款利息

168,829,486.88

应收其他存款利息

-

应收结算备付金利息

-

应收债券利息
106,559,863.13
应收买入返售证券利息
1,085,243.71
应收申购款利息
-
应收黄金合约拆借孳息
-

其他
0.00
合计
276,481,997.06

其他资产
单位：
项目
本期末
2016-06-30
其他应收款

-
待摊费用

-
合计

-
注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

应付交易费用
单位：
项目
本期末
2016-06-30
交易所市场应付交易费用

-
银行间市场应付交易费用
124,536.31

合计
124,536.31

其他负债
单位：
项目
本期末
2016-06-30

应付券商交易单元保证金

-
应付赎回费
5,066.35

预提费用	
109,398.38	
合计	
114,464.73	
实收基金	
单位：	
项目	
本期末	
2016-06-30	
鹏华货币 A	
鹏华货币 B	
基金份额（份）	
账面金额	
基金份额（份）	
账面金额	
上年度末	
1,315,628,729.93	
1,315,628,729.93	
50,277,237,343.11	
50,277,237,343.11	
本期申购	
1,063,852,198.11	
1,063,852,198.11	
130,176,717,853.85	
130,176,717,853.85	
本期赎回（以“-”号填列）	
-1,888,966,325.06	
-1,888,966,325.06	
-123,298,038,879.33	
-123,298,038,879.33	
基金拆分/份额折算前	
-	
-	
-	
-	
基金拆分/份额折算调整	
-	
-	
本期申购	
-	
-	
-	
-	
本期赎回（以“-”号填列）	

-

-

-

-

本期末

490,514,602.98

490,514,602.98

57,155,916,317.63

57,155,916,317.63

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

未分配利润

单位：

项目

鹏华货币 A

鹏华货币 B

已实现部分

未实现部分

未分配利润合计

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

6,753,308.22

-

6,753,308.22

635,041,783.52

-

635,041,783.52

本期基金份额交易产生的变动数

-

-

-

-

-

-

其中：基金申购款

-

-

-

-

-

-

基金赎回款

-

-

-

-

-

-

本期已分配利润

-6,753,308.22

-

-6,753,308.22

-635,041,783.52

-

-635,041,783.52

本期末

-

-

-

-

-

-

存款利息收入

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

活期存款利息收入

951,457.30

定期存款利息收入

560,474,995.30

其他存款利息收入

-

结算备付金利息收入

51,799.16

其他

-

合计

561,478,251.76

股票投资收益

股票投资收益项目构成

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

股票投资收益——买卖股票差价收入

-

股票投资收益——赎回差价收入

-

股票投资收益——申购差价收入

-

合计

-

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出股票成交总额

-

减：卖出股票成本总额

-

买卖股票差价收入

-

注：无。

股票投资收益——赎回差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

赎回基金份额对价总额

-

减：现金支付赎回款总额

-

减：赎回股票成本总额

-

赎回差价收入

-

股票投资收益——申购差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

申购基金份额总额

-

减：现金支付申购款总额

-

减：申购股票成本总额

-

申购差价收入

-

基金投资收益

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出/赎回基金成交总额

-

减：卖出/赎回基金成本总额

-

基金投资收益

-

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入

2,009,069.75

-

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

2,009,069.75

2,384,834.11

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额

9,834,981,446.16

-

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额

9,825,024,423.48

-

减：应收利息总额

7,947,952.93

-

买卖债券差价收入

2,009,069.75

-

债券投资收益——赎回差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

赎回基金份额对价总额

-

-

减：现金支付赎回款总额

-

-

减：赎回债券成本总额

-

-

减：赎回债券应收利息总额

-

-

赎回差价收入

-

-

债券投资收益——申购差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

申购基金份额对价总额

-

-

减：现金支付申购款总额

-

-

减：申购债券成本总额

-

-

减：申购债券应收利息总额

-

-

申购差价收入

-

-

资产支持证券投资收益

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出资产支持证券成交总额

-

减：卖出资产支持证券成本总额

-

减：应收利息总额

-

资产支持证券投资收益

-

贵金属投资收益

贵金属投资收益项目构成

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

-

贵金属投资收益——赎回差价收入

-

贵金属投资收益——申购差价收入

合计

-

贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出贵金属成交总额

-
减：卖出贵金属成本总额
-
买卖贵金属差价收入
-
贵金属投资收益——赎回差价收入
单位：
项目
本期
2016-01-01 至 2016-06-30
赎回贵金属份额对价总额
-
减：现金支付赎回款总额
-
减：赎回贵金属成本总额
-
赎回差价收入
-
贵金属投资收益——申购差价收入
单位：
项目
本期
2016-01-01 至 2016-06-30
申购贵金属份额总额
-
减：现金支付申购款总额
-
减：申购贵金属成本总额
-
申购差价收入
衍生工具收益
衍生工具收益——买卖权证差价收入
单位：
项目
本期
2016-01-01 至 2016-06-30
卖出权证成交总额
-
减：卖出权证成本总额
-
买卖权证差价收入
-
衍生工具收益——其他投资收益
项目

本期收益金额

2016-01-01 至 2016-06-30

权证投资收益

-

股指期货-投资收益

-

注：无。

股利收益

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

股票投资产生的股利收益

-

基金投资产生的股利收益

-

合计

-

注：无。

公允价值变动收益

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

1.交易性金融资产

-

——股票投资

-

——债券投资

-

——资产支持证券投资

-

——基金投资

-

——贵金属投资

-

——其他

-

2.衍生工具

-

——权证投资

-

3.其他

-

合计

-

注：无。

其他收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

基金赎回费收入

-

合计

-

注：无。

交易费用

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

交易所市场交易费用

-

银行间市场交易费用

294.00

合计

294.00

其他费用

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

审计费用

59,672.34

信息披露费

49,726.04

其他

1,000.00

账户维护费

39,799.90

银行汇划费用

102,419.04

合计

252,617.32

注：其他为上交所数字证书费用。

分部报告

-

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

无。

资产负债表日后事项

本基金管理人于 2016 年 7 月 1 日、2016 年 8 月 2 日分别宣告本基金 2016 年第 7 号收益支付公告与 2016 年第 8 号收益支付公告，对本基金所属期间的累计收益进行集中支付，并按基金份额面值 1.00 元直接结转为基金份额，不进行现金支付。

关联方关系

关联方名称

与本基金的关系

鹏华基金管理有限公司

基金管理人、基金销售机构

中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)

基金托管人、基金销售机构

国信证券股份有限公司(“国信证券”)

基金管理人的股东、基金销售机构

鹏华资产管理(深圳)有限公司

基金管理人的子公司

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生股票交易、权证交易、债券交易、债券回购交易，也没有发生应支付关联方的佣金业务。

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：元

关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：无。

债券交易

单位：元

关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

成交金额

占当期债券成交总额的比例

成交金额

占当期债券成交总额的比例

注：无。

债券回购交易

单位：元

关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

成交金额

占当期债券回购成交总额的比例

成交金额

占当期债券回购成交总额的比例

注：无。

基金交易

单位：元

关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

成交金额

占当期基金成交总额的比例

成交金额

占当期基金成交总额的比例

注：无。

权证交易

单位：元

关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：无。

应支付关联方的佣金

单位：元

关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

当期佣金
占当期佣金总量的比例
期末应付佣金余额
占期末应付佣金总额的比例
关联方名称
上年度可比期间
至
当期佣金
占当期佣金总量的比例
期末应付佣金余额
占期末应付佣金总额的比例

注：无。

关联方报酬

基金管理费

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

当期发生的基金应支付的管理费

79,217,955.66

15,045,517.01

其中：支付销售机构的客户维护费

457,677.60

1,003,963.12

注：（1）支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为 0.33%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.33%÷当年天数。

（2）根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

基金托管费

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

当期发生的基金应支付的管理费

24,005,441.01

4,559,247.61

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费年费率为 0.10%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

销售服务费

单位:

获得销售服务费的各关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

当期应支付的销售服务费

鹏华货币 A

鹏华货币 B

合计

鹏华基金公司

128,410.98

2,355,567.59

2,483,978.57

国信证券

883.44

16.38

899.82

农业银行

121,906.26

1,471.47

123,377.73

合计

251,200.68

2,357,055.44

2,608,256.12

获得销售服务费的各关联方名称

上年度可比期间

至

当期应支付的销售服务费

鹏华货币 A

鹏华货币 B

合计

鹏华基金公司

131,977.34

369,589.13

501,566.47

国信证券

1,110.39

-

1,110.39

农业银行

394,961.47

6,033.48

400,994.95

合计

528,049.20

375,622.61

903,671.81

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。自 2006 年 9 月 15 日实行基金份额分级起，A 级基金份额持有人和 B 级基金份额持有人约定的年基金销售服务费率分别为 0.25%和 0.01%。其计算公式为：
计算日基金销售服务费=计算日前一日基金资产净值×0.25%（或 0.01%）约定年费率÷当年天数。

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

银行间市场交易的各关联方名称

债券交易金额

基金逆回购

基金正回购

基金买入

基金卖出

交易金额

利息收入

交易金额

利息支出

中国农业银行

301,081,057.92

-

-

-

499,800,000.00

26,701.64

上年度可比期间

至

银行间市场交易的各关联方名称

债券交易金额

基金逆回购

基金正回购

基金买入

基金卖出

交易金额

利息收入

交易金额

利息支出

中国农业银行

31,044,628.36

-

-
-
-
-

注：与关联方之间通过银行间市场进行的债券(含回购)交易，该类交易是在正常业务中按照一般商业条款而订立。

各关联方投资本基金的情况

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

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

份额级别

鹏华货币 A

鹏华货币 B

鹏华货币 A

鹏华货币 B

基金合同生效日（2005-04-12）持有的基金份额

-
-
-
-

期初持有的基金份额

-

479,443,566.62

-

235,606,877.47

期间申购/买入总份额

-

5,366,384.61

-

129,124,981.78

期间因拆分增加的份额

-

-

-

-

减：期间赎回/卖出总份额

-

484,809,951.23

-

240,000,000.00

期末持有的基金份额

-

-

-

124,731,859.25

期末持有的基金份额占基金总份额比例

-

-

-

-

注：注：（1）本基金管理人于 2016 年 4 月 25 日赎回本基金份额 100,000,000 份。

（2）本基金管理人于 2016 年 5 月 20 日赎回本基金份额 384,809,951.23 份。

（3）本报告期内红利再投本基金份额 5,366,384.61 份。

（4）本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致

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

项目

鹏华货币 A

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

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

项目

鹏华货币 B

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

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

鹏华资产管理（深圳）有限公司

-

0.000000

14,124,067.57

0.000274

国信证券

-

-

1,500,000,000.00

0.029074

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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：

关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

期末余额

当期利息收入

期末余额

当期利息收入

中国农业银行

365,049,446.68

951,457.30

626,604,134.57

514,493.19

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：元

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

上年度可比期间

至

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

注：本基金本报告期与上年度可比期间没有参与关联方承销的证券。

其他关联交易事项的说明

-

利润分配情况

利润分配情况——货币市场基金 A

单位：元

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

6,245,440.11

1,094,627.11

-525,729.66

6,814,337.56

-

利润分配情况——货币市场基金 B

单位：元

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

491,079,035.06

131,415,831.00

12,577,883.09

635,072,749.15

-

期末（2016-06-30）本基金持有的流通受限证券
因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
金额单位：元

受限证券类别：股票

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

受限证券类别：债券

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位： 股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

注：截至本报告期末，本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限的股票，也没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证。

期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：元

股票代码

股票名称

停牌日期

停牌原因

期末估值单价

复牌日期

复牌开盘单价

数量（股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

注：截至本报告期末，本基金没有持有暂时停牌等流通受限的股票。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

-

金额单位：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

注：截至本报告期末，本基金没有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。

交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

金融工具风险及管理

-

风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场型证券投资基金，属于低风险合理稳定收益品种。本基金投资的金融工具主要为债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收

益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

按短期信用评级列示的债券投资

单位：元

短期信用评级

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

A-1

800,922,436.22

853,958,157.00

A-1 以下

9,675,182,279.32

5,513,970,771.31

未评级

2,150,178,904.39

1,691,964,547.47

合计

12,626,283,619.93

8,059,893,475.78

注：注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

按长期信用评级列示的债券投资

单位：元
 长期信用评级
 本期末
 2016-06-30
 上年度末
 2015-12-31
 AAA
 0.00
 14,978,348.54
 AAA 以下
 0.00
 0.00
 未评级
 522,867,497.61
 391,997,755.29
 合计
 522,867,497.61
 406,976,103.83

注：注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：元
 本期末
 2016-06-30
 合计
 资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额

-

上年度末

2015-12-31

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额

-

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。

利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的利率风险进行监控，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。

利率风险敞口

单位：元

本期末

2016-06-30

6个月以内

6个月-1年

不计息

合计

资产

银行存款

30,605,049,446.68

12,370,000,000.00

-

42,975,049,446.68

交易性金融资产

11,249,157,344.63

1,899,993,772.91

-

13,149,151,117.54

买入返售金融资产

1,000,000,500.00

-

-

1,000,000,500.00

应收证券清算款

-

-

200,047,465.39

200,047,465.39

应收利息

-

-

276,481,997.06

276,481,997.06

应收申购款

-

-

290,913,957.40

290,913,957.40

其他资产

-

-

-

-

资产总计

42,854,207,291.31

14,269,993,772.91

767,443,419.85

57,891,644,484.07

应付证券清算款

-

-

151,599,197.82

151,599,197.82

应付赎回款

-

-

1,255,580.49

1,255,580.49

应付管理人报酬

-

-

13,108,203.70

13,108,203.70

应付托管费

-

-

3,972,182.92

3,972,182.92

应付销售服务费

-

-

487,782.04

487,782.04

应付交易费用

-

-

124,536.31

124,536.31

应交税费

-

-

66,600.00

66,600.00

应付利润

-

-

74,485,015.45

74,485,015.45

其他负债

-

-

114,464.73

114,464.73

负债总计

-

-

245,213,563.46

245,213,563.46

利率敏感度缺口

42,854,207,291.31

14,269,993,772.91

522,229,856.39

57,646,430,920.61

上年度末

2015-12-31

6个月以内

6个月-1年

不计息

合计

资产

银行存款

22,175,107,827.97

5,200,000,000.00

-

27,375,107,827.97

结算备付金

476,190.48

-

-

476,190.48

交易性金融资产

7,285,950,239.44

1,180,919,340.17

-

8,466,869,579.61

买入返售金融资产

16,471,323,023.37

-

-

16,471,323,023.37

应收利息

-

-

232,544,405.08

232,544,405.08

应收申购款

-

-

622,519,790.54

622,519,790.54

其他资产

-

-

-

-

资产总计

45,932,857,281.26

6,380,919,340.17

855,064,195.62

53,168,840,817.05

应付证券清算款

-

-

1,500,000,000.00

1,500,000,000.00

应付赎回款

-

-

1,392,374.88

1,392,374.88

应付管理人报酬

-

-

8,703,204.05

8,703,204.05

应付托管费

-

-

2,637,334.55

2,637,334.55

应付销售服务费

-

-

412,379.19

412,379.19

应付交易费用

-

-

104,484.40

104,484.40

应交税费

-

-

66,600.00

66,600.00

应付利润

-

-

62,432,862.02

62,432,862.02

其他负债
 -
 -
 225,504.92
 225,504.92
 负债总计
 -
 -
 1,575,974,744.01
 1,575,974,744.01
 利率敏感度缺口
 45,932,857,281.26
 6,380,919,340.17
 -720,910,548.39
 51,592,866,073.04

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

利率风险的敏感性分析

假设

该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。

假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。

此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

市场利率下降 25 个基点

10,100,641.35

6,659,688.58

市场利率上升 25 个基点

-10,039,743.78

-6,646,784.93

外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

外汇风险敞口

单位：元

项目

本期末

2016-06-30

美元折合人民币
港币折合人民币
其他币种折合人民币
合计

以外币计价的资产
资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债
负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-

项目

上年度末

2015-12-31

美元折合人民币
港币折合人民币
其他币种折合人民币
合计

以外币计价的资产
资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债
负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-
外汇风险的敏感性分析
假设
-
分析
相关风险变量的变动
对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）

本期末
2016-06-30

上年度末

2015-12-31

其他价格风险

-
其他价格风险敞口

金额单位：元

项目

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

公允价值

占基金资产净值比例（%）

公允价值

占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资

-

-

-

-

交易性金融资产—基金投资

-

-

-

-

交易性金融资产—债券投资

13,155,202,000.00

22.82

8,479,417,500.00

16.44

交易性金融资产—贵金属投资

-

-

-

-

衍生金融资产—权证投资

-

-

-

-

其他

-

-

-

-

合计

13,155,202,000.00

22.82

8,479,417,500.00

16.44

注：本基金本期末和上年度末均未持有的交易性权益类投资。

其他价格风险的敏感性分析

假设

-

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

其他价格风险的敏感性分析 A

假设

-

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

其他价格风险的敏感性分析 B

假设

-

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

注：于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资（2015 年 12 月 31 日：未持有）因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

采用风险价值法管理风险

-

假设

-

-

分析

风险价值（金额单位：元）

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号

项目

金额（元）

占基金总资产的比例（%）

1

固定收益投资

13,149,151,117.54

22.71

其中：债券

13,149,151,117.54

22.71

资产支持证券

-

-

2

买入返售金融资产

1,000,000,500.00

1.73

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

42,975,049,446.68

74.23

4

其他各项资产

767,443,419.85

1.33

5

合计

57,891,644,484.07

100.00

债券回购融资情况

金额单位：元

序号

项目

金额（元）

占基金总资产的比例（%）

1

报告期内债券回购融资余额

0.58

其中：买断式回购融资

-

2

报告期末债券回购融资余额

-

-

其中：买断式回购融资

-

-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占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

金额单位：元

序号

发生日期

融资余额占基金资产净值的比例（%）

原因

调整期

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

基金投资组合平均剩余期限

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

80

报告期内投资组合平均剩余期限最高值

90

报告期内投资组合平均剩余期限最低值

50

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号

发生日期

平均剩余期限

原因

调整期

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号

平均剩余期限

各期限资产占基金资产净值的比例（%）

各期限负债占基金资产净值的比例（%）

1

30 天以内

30.44

0.26

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

2

30 天(含)—60 天

14.15

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

3

60 天(含)—90 天

21.94

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

4

90 天(含)—120 天

4.53

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

5

120 天(含)—397 天 (含)

27.52

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

合计

98.57

0.26

报告期内投资组合平均剩余期限超过 240 天情况说明

序号

发生日期

平均剩余期限

原因

调整期

期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：元

序号

债券品种

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

1

国家债券

-

-

2

央行票据

-

-

3

金融债券

2,673,046,402.00

4.64

其中：政策性金融债

2,673,046,402.00

4.64

4

企业债券

-

-

5

企业短期融资券

5,459,733,956.67

9.47

6	
中期票据	
-	
-	
7	
同业存单	
5,016,370,758.87	
8.70	
8	
其他	
-	
-	
9	
合计	
13,149,151,117.54	
22.81	

10	
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	
-	
-	

注：上表中，付息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

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：元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	---------	---------	--------------

1	150419	15 农发 19	4,500,000	450,149,171.01	0.78
---	--------	----------	-----------	----------------	------

2	150416	15 农发 16	4,200,000	420,074,860.83	0.73
---	--------	----------	-----------	----------------	------

3	160401				
---	--------	--	--	--	--

16 农发 01
3,500,000
349,884,187.18
0.61
4
150318
15 进出 18
3,000,000
300,308,618.24
0.52
5
111691217
16 中德住房储蓄银行 CD004
3,000,000
298,340,445.09
0.52
6
011537014
15 中建材 SCP014
2,500,000
250,138,236.31
0.43
7
150215
15 国开 15
2,500,000
250,014,865.11
0.43
8
150222
15 国开 22
2,000,000
200,058,183.34
0.35
9
011699622
16 中建材 SCP003
2,000,000
200,022,604.51
0.35
10
111690110
16 青岛银行 CD005
2,000,000

199,779,844.16

0.35

“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目

偏离情况

报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数

-

报告期内偏离度的最高值

0.0378%

报告期内偏离度的最低值

0.0090%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值

0.0235%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

序号

发生日期

偏离度

原因

调整期

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

序号

发生日期

偏离度

原因

调整期

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：元

序号

证券代码

证券名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

投资组合报告附注

基金计价方法说明

- 1、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、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；
- 3、基金持有的付息债券、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；
- 4、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，实际持有的相关资产

按其性质进行估值；

5、基金持有的资产支持证券视同债券，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。

7.8.2 若本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，应声明本报告期内是否存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况

本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本不存在超过当日基金资产净值的 20% 的情况。

受到调查以及处罚情况

本基金投资的前十名证券中本期没有出现发行主体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。

期末其他各项资产构成

单位：元

序号

名称

金额（元）

1

存出保证金

-

2

应收证券清算款

200,047,465.39

3

应收股利

-

4

应收利息

276,481,997.06

5

应收申购款

290,913,957.40

6

其他应收款

-

7

其他

-

8

合计

767,443,419.85

投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、本基金的投资决策流程主要包括：久期决策、期限结构策略、类属配置策略和个券选择策略。其中久期区间决策由投资决策委员会负责制定，基金经理在设定的区间内根据市场情

况自行调整；期限结构配置和类属配置决策由固定收益小组讨论确定，由基金经理实施该决策并选择相应的个券进行投资。

2、由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动：

报告期内，因股东方更换董事代表，原董事 Alessandro Varaldo 先生不再担任公司董事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐，并经本公司股东会审议通过，同意由 Andrea Vismara 先生担任本公司董事，Alessandro Varaldo 先生不再担任本公司董事职务。Andrea Vismara 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

报告期内，原监事 Andrea Vismara 先生辞去公司监事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐，并经本公司股东会审议通过，同意由 Sandro Vesprini 先生担任本公司监事，Andrea Vismara 先生不再担任本公司监事职务。Sandro Vesprini 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动：

基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

改聘会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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：元

券商名称

交易单元数量

股票交易

基金交易

债券交易

债券回购交易

权证交易

应支付该券商的佣金

备注

成交金额

占当期比例

成交金额

占当期比例
成交金额
占当期比例
成交金额
占当期比例
成交金额
占当期比例
成交金额
占当期比例
申万宏源
1
-
- %
-
- %
-
- %
7,740,000,000.00
100.00 %
-
- %
-
- %
-

注：1、本基金本报告期内没有通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付。

2、交易单元选择的标准和程序

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本报告期内并未发生变更交易单元的情况。

根据本基金管理人与申银万国证券股份有限公司签订的《证券交易席位租用协议》的规定，我管理的鹏华货币市场基金在该交易单元上发生的交易不计佣金，因交易产生的证券经

手费和证管费等投资交易费用，均列入当期基金费用。

偏离度绝对值超过 0.5%的情况

项目

发生日期

偏离度

法定披露报刊

法定披露日期

报告期内偏离度绝对值在 0.5%（含）以上

-

-

-

-

注：本基金本报告期没有发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

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

鹏华货币市场证券投资基金收益支付公告

《中国证券报》

2016-01-04

2

鹏华基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告

《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

2016-01-06

3

2015 年第四季度报告

《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

2016-01-21

4

鹏华货币市场证券投资基金收益支付公告

《中国证券报》

2016-02-01

5

关于鹏华货币市场证券投资基金 2016 年春节假期前暂停申购、定期定额投资和转换转入业务的公告

《中国证券报》

2016-02-03

6

鹏华货币市场证券投资基金收益支付公告

《中国证券报》

2016-03-01

7

2015 年年度报告摘要

《中国证券报》

2016-03-30

8

鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告

《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

2016-03-30

9

鹏华货币市场证券投资基金收益支付公告

《中国证券报》

2016-04-01

10

鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海陆金所资产管理有限公司基金申购费率优惠活动的公告

《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

2016-04-18

11

2016 年第一季度报告

《中国证券报》

2016-04-20

12

鹏华基金管理有限公司关于增加江苏江南农村商业银行股份有限公司为旗下部分开放式基金销售机构的公告

《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

2016-04-20

13

鹏华货币市场证券投资基金收益支付公告

《中国证券报》

2016-05-03

14

鹏华货币市场证券投资基金更新的招募说明书摘要

《中国证券报》

2016-05-20

15

鹏华基金管理有限公司关于增加中国民族证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告

《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

2016-05-30

16

鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国民生银行股份有限公司开通定投业务的公告

《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

2016-05-31

17

鹏华货币市场证券投资基金收益支付公告

《中国证券报》

2016-06-01

18

鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户的证件类型公告

《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

2016-06-18

19

鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购手续费率优惠活动的公告

《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

2016-06-30

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

鹏华货币 A

68,738

7,136

85,895,753.83

17.51%

404,618,849.15

82.49%

鹏华货币 B

226

252,902,284.59

57,090,336,831.7

99.89%

65,579,485.93

0.11%

合计

68,964

835,891.64

57,176,232,585.53

99.18%

470,198,335.08

0.82%

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

鹏华货币 A

1,400,606.73

0.2855%

鹏华货币 B

-

-%

合计

1,400,606.73

0.0024%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

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

鹏华货币 A

-

鹏华货币 B

-

合计

-

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

鹏华货币 A

-

鹏华货币 B

-

合计

-

注（1）本公司高级管理人员、基金研究部门负责人本报告期末未持有本基金份额。

（2）本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

开放式基金份额变动（仅适用于开放式基金）

单位：份

项目

鹏华货币 A

鹏华货币 B

基金合同生效日的基金份额总额

3,353,743,565.06

-

本报告期期初基金份额总额

1,315,628,729.93

50,277,237,343.11

本报告期基金总申购份额

1,063,852,198.11

130,176,717,853.85

减：本报告期基金总赎回份额

1,888,966,325.06

123,298,038,879.33

本报告期期末基金份额总额

490,514,602.98

57,155,916,317.63

注（1）总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额；

（2）本基金从 2006 年 9 月 15 日分为 A、B 两级。

发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-

-%

-

-%

-

基金管理人高级管理人员

-

-%

-

-%

-

基金经理等人员

-

-%

-

-%

-

基金管理人股东

-

-%

-

-%

-

其他

-

-%

-

-%

-

合计

-

-%

-

-%

-

影响投资者决策的其他重要信息

11.1 鹏华资产管理（深圳）有限公司及其产品持有鹏华货币市场证券投资基金情况

公司/产品名称 期末持有份额（份）

鹏华货币 A 鹏华货币 B

鹏华资产管理（深圳）有限公司 - 10,000,000.00

鹏华资产昊天定增资产管理计划 - 18,173,953.26

备查文件目录

（一）《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》；

（二）《鹏华货币市场证券投资基金托管协议》；

（三）《鹏华货币市场证券投资基金 2016 年半年度报告》（原文）。

存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 中国农业银行股份有限公司

查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。