

# 鹏华添利交易型货币市场基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 债券回购融资情况.....	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	38
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	40
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	40
7.7 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.....	40
7.8 投资组合报告附注.....	41
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	44
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	46
10.9 其他重大事件.....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>49</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	49

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>50</b>
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华添利交易型货币市场基金	
基金简称	鹏华添利货币	
场内简称	-	
基金主代码	002318	
基金运作方式	交易型开放式	
基金合同生效日	2016 年 1 月 29 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	154,685,153.05 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2016-02-22	
下属分级基金的基金简称:	鹏华添利 A	鹏华添利 B
下属分级基金场内简称:	-	鹏华添利
下属分级基金的交易代码:	002318	511820
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	134,565,736.28 份	20,119,416.77 份

注：本基金场外基金份额（A 类基金份额）简称为“鹏华添利货币”，基金份额净值为 1.00 元；场内基金份额（B 类基金份额）简称为“鹏华添利”，基金份额净值为 100.00 元。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	<p>本基金将综合宏观经济运行状况，货币政策、财政政策等政府宏观经济状况及政策，分析资本市场资金供给状况的变动趋势，预测市场利率水平变动趋势。在此基础上，综合考虑各类投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况，进行积极的投资组合管理。</p> <p>1、久期策略 结合宏观经济运行态势及利率预测分析，本基金将动态确定并调整基金组合平均剩余期限。预测利率将进入下降通道时，适当延长投资品种的平均期限；预测市场利率将进入上升通道时，适当缩短投资品种的平均期限。</p> <p>2、类属配置策略 在保证流动性的前提下，根据各类货币市场工具的市场规模、信用等级、流动性、市场供求、票息及付息频率等确定不同类别资产的具体配置比例。</p> <p>3、套利策略 本基金根据对货币市场变动趋势、各市场和品种之间的风险收益差异的充分研究和论证，适当进行跨市场或跨品种套利操作，力争提高资产收益率，具体策略包括跨市场套利和跨期限套利等。</p> <p>4、现金管理策略</p>

	<p>本基金作为现金管理工具，具有较高的流动性要求，本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测，通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，动态调整并有效分配基金的现金流，在保持充分流动性的基础上争取较高收益。</p> <p>5、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p>	
业绩比较基准	活期存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
	鹏华添利 A	鹏华添利 B
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上	风险收益特征同上

### 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		鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	郭明
	联系电话	0755-82825720	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	易会满

### 2.4 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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构（鹏华）	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳

添利 A)		国际商会中心第 43 层
注册登记机构(鹏华 添利 B)	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号



### § 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	鹏华添利 A	鹏华添利 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 )	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	4,745,047.06	50,035,469.61
本期利润	4,745,047.06	50,035,469.61
本期净值收益率	1.7029%	1.7029%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	134,565,736.28	2,011,941,676.51
期末基金份额净值	1.000	100.00
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	4.0154%	4.0154%

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

鹏华添利 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	0.3006%	0.0002%	0.0288%	0.0000%	0.2718%	0.0002%
过去三个月	0.9207%	0.0014%	0.0873%	0.0000%	0.8334%	0.0014%
过去六个月	1.7029%	0.0020%	0.1736%	0.0000%	1.5293%	0.0020%
过去一年	2.9333%	0.0022%	0.3500%	0.0000%	2.5833%	0.0022%
自基金合同生效起至今	4.0154%	0.0019%	0.4977%	0.0000%	3.5177%	0.0019%

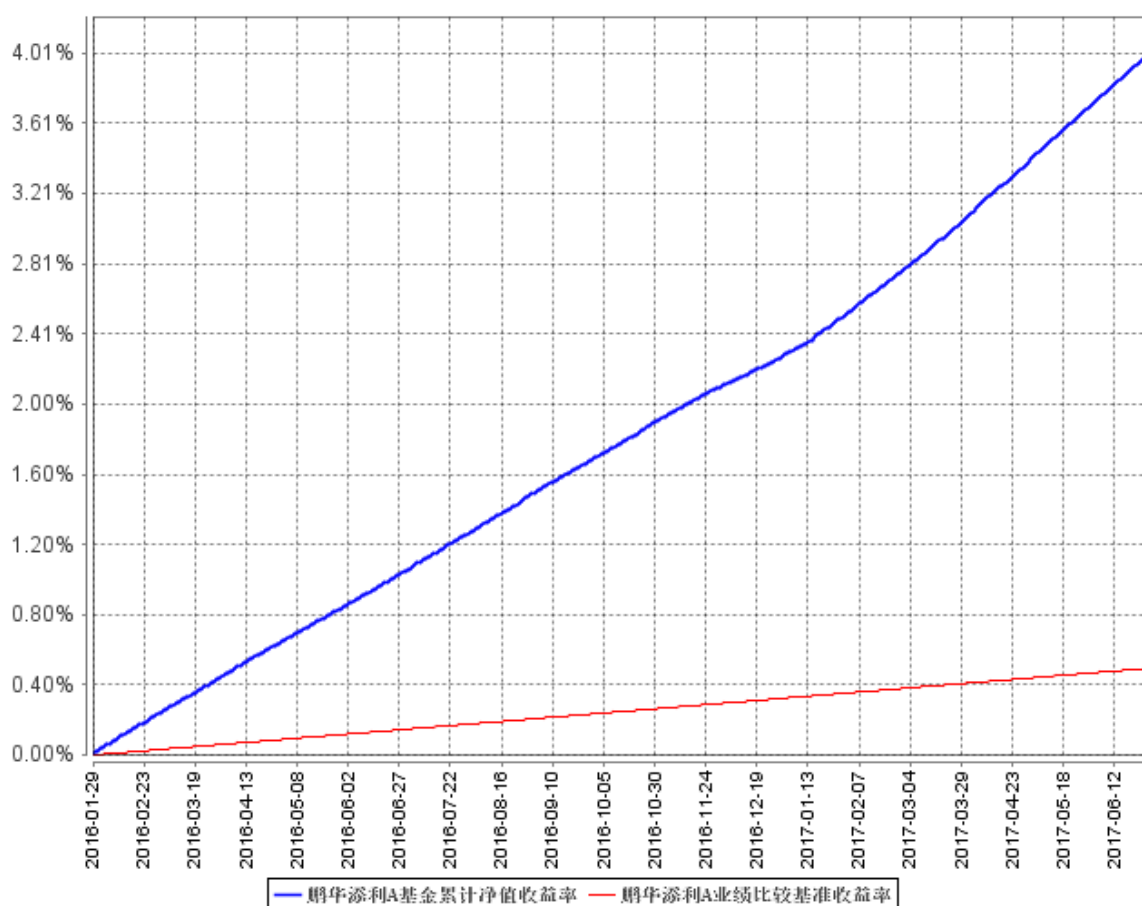
鹏华添利 B

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	0.3006%	0.0002%	0.0288%	0.0000%	0.2718%	0.0002%
过去三个月	0.9207%	0.0014%	0.0873%	0.0000%	0.8334%	0.0014%
过去六个月	1.7029%	0.0020%	0.1736%	0.0000%	1.5293%	0.0020%
过去一年	2.9333%	0.0022%	0.3500%	0.0000%	2.5833%	0.0022%
自基金合同 生效起至今	4.0154%	0.0019%	0.4977%	0.0000%	3.5177%	0.0019%

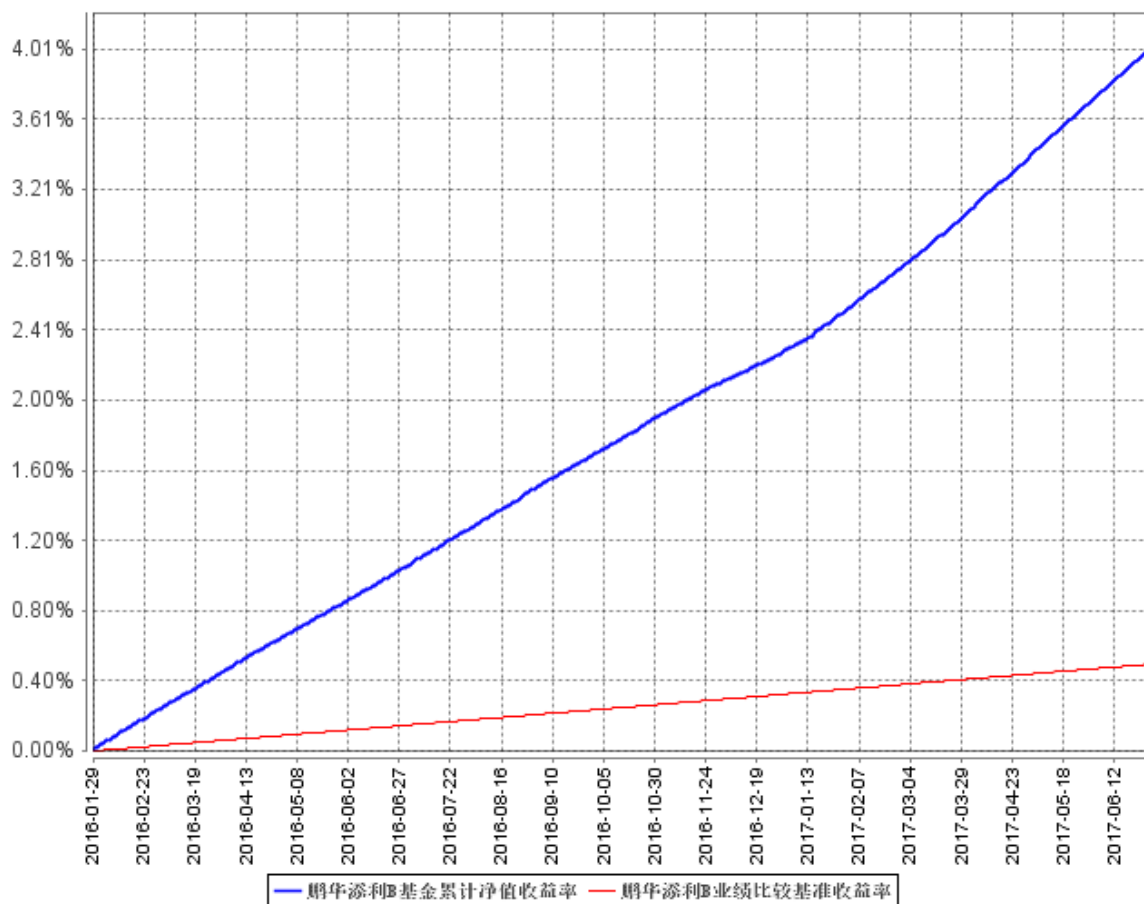
注：业绩比较基准=活期存款税后利率

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华添利A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



鹏华添利B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2016 年 1 月 29 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。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2017 年 6 月，公司管理资产总规模达到 4509.30 亿元，管理 149 只公募基金、10 只全国社保投资组合、2 只基本养老保险投资组合。经过近 19 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。

#### 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		
叶朝明	本基金基金经理	2016 年 1 月 29 日	-	9	叶朝明先生，国籍中国，工商管理硕士，9 年金融证券从业经验。曾任职于招商银行总行，从事本外币资金管理相关工作；2014 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事货币基金管理工作，2014 年 2 月担任鹏华增值宝货币基金基金经理，2015 年 1 月起兼任鹏华安盈宝货币基金基金经理，2015 年 7 月起兼任鹏华添利宝货币基金基金经理，2016 年 1 月起兼任鹏华添利交易型货币基金基金经理，2017 年 5 月起兼任鹏华聚财通货币基金基金经理，2017 年 6 月起兼任鹏华盈余宝货币、鹏华金元宝货币基金基金经理。叶朝明先生具备基金从业资格。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。

#### 4.2 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。

#### 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

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。

##### 4.3.2 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。

#### 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

2017 上半年宏观经济稳中向好，GDP 同比增速回升至 6.9%，工业增加值、固定资产投资以及净出口较 2016 年均出现明显回升；一季度 PPI 持续上升，达到 7.8% 的高点，二季度虽有回落，但整体表现平稳。一季度货币政策更加侧重于金融监管，央行两次提高逆回购操作利率和 MLF 利率，推动货币市场资金利率中枢上升，但随着 4 月监管政策密集出台，央行货币政策调整至稳健中性，资金利率波动性明显降低。

由于监管政策的冲击，上半年债券市场整体收益率明显上升，其中 1 年期国开债收益率上行 68BP 左右，1 年期 AAA 短融收益率上行 54bp 左右。

2017 年上半年，本基金适度拉长了组合的剩余期限，并根据组合流动性特征和资产收益水平对各类资产进行了合理的比例配置。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年上半年本基金的净值增长率为 1.7029%，同期业绩基准增长率为 0.1736%。

#### 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 2017 年下半年，宏观经济预计呈现平稳回落的态势，在低基数和投资惯性影响下，三季

度经济或将继续保持平稳，但四季度随着地产投资的回落以及企业补库存的结束，经济增长将面临一定的压力。CPI 预计继续保持当前水平，而 PPI 大概率继续回落。经济平稳运行情况下，预计货币政策继续保持稳健中性、不紧不松的态势，基础货币的投放更加注重维持流动性平稳，防止出现流动性风险。如果四季度经济增长压力上升，届时货币政策有边际转向的可能。同时，在金融监管和实体去杠杆背景下，同业存单增速可能持续放缓，甚至出现阶段性减少，长期限存单收益率可能有继续回落的空间。

基于以上分析，本组合 2017 年下半年将坚持稳健操作，加强组合的风险控制和管理，确保组合的安全性和流动性。同时努力把握市场波动中的资产配置机会，在确保组合安全的前提下努力提高组合收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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。

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。

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. 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

#### 4.7 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 54,780,516.67 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。

#### 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

无。

## § 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

本报告期内，本基金托管人在对鹏华添利交易型货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，鹏华添利交易型货币市场基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华添利交易型货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华添利交易型货币市场基金 2017 年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。



## § 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：鹏华添利交易型货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	912,808,795.56	2,490,509,821.26
结算备付金		-	1,137,010,900.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	961,737,012.06	948,551,951.45
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		961,737,012.06	948,551,951.45
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	266,038,239.95	1,405,973,908.96
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	7,604,965.13	34,026,427.21
应收股利		-	-
应收申购款		188,100.00	17,006.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,148,377,112.70	6,016,090,014.96
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		20,030.03	-
应付管理人报酬		648,562.94	1,250,530.31
应付托管费		194,568.87	375,159.10
应付销售服务费		540,469.15	1,042,108.59
应付交易费用	6.4.7.7	22,539.61	54,088.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		228,566.91	828,468.52
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	214,962.40	182,000.00
负债合计		1,869,699.91	3,732,355.40
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,146,507,412.79	6,012,357,659.56
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,146,507,412.79	6,012,357,659.56
负债和所有者权益总计		2,148,377,112.70	6,016,090,014.96

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 A 级 1.0000 元，B 级 100.0000 元；基金份额总额 A 级 134,565,736.28 份，B 级 20,119,416.77 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华添利交易型货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 29 日(基金 合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		66,085,898.35	117,124,994.18
1.利息收入		65,885,602.95	116,873,148.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	40,973,700.63	71,034,282.95
债券利息收入		18,095,259.25	42,782,066.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,816,643.07	3,056,798.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		200,295.40	79,328.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	200,295.40	79,328.54
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	172,517.04
<b>减：二、费用</b>		11,305,381.68	30,048,411.00

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,921,636.57	10,539,841.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,476,491.05	3,174,853.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,101,363.86	8,819,038.12
4. 交易费用	6.4.7.19	-	200.00
5. 利息支出		627,074.31	7,296,759.09
其中：卖出回购金融资产支出		627,074.31	7,296,759.09
6. 其他费用	6.4.7.20	178,815.89	217,718.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		54,780,516.67	87,076,583.18
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		54,780,516.67	87,076,583.18

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华添利交易型货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,012,357,659.56	-	6,012,357,659.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	54,780,516.67	54,780,516.67
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）	-3,865,850,246.77	-	-3,865,850,246.77
其中：1. 基金申购款	4,582,807,692.17	-	4,582,807,692.17
2. 基金赎回款	-8,448,657,938.94	-	-8,448,657,938.94
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）	-	-54,780,516.67	-54,780,516.67
五、期末所有者权益（基金净值）	2,146,507,412.79	-	2,146,507,412.79
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,440,648,154.89	-	1,440,648,154.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	87,076,583.18	87,076,583.18
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)	14,089,756,904.68	-	14,089,756,904.68
其中：1. 基金申购款	25,145,858,973.68	-	25,145,858,973.68
2. 基金赎回款	-11,056,102,069.00	-	-11,056,102,069.00
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)	-	-87,076,583.18	-87,076,583.18
五、期末所有者权益(基金净值)	15,530,405,059.57	-	15,530,405,059.57

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：

          邓召明                                          高鹏                                          郝文高            
 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

鹏华添利交易型货币市场基金(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”)证监许可[2015]3046号《关于准予鹏华添利交易型货币市场基金注册的批复》准予,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《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,440,484,999.24元,业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(2016)第105号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》于2016年1月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,440,648,154.89份基金份额,其中认购资金利息折合163,155.65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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金设 A 类和 B 类两类基金份额，A 类为场外基金份额，B 类为场内基金份额。A 类基金份额的登记业务由本公司办理；B 类基金份额的登记业务由中国证券登记结算有限责任公司办理。两类基金份额单独设置基金代码，并分别公布每万份基金净收益、7 日年化收益率和运作期年化收益率。A 类基金份额的申购、赎回净值为每份人民币 1.00 元，B 类基金份额的申购、赎回净值为每份人民币 100.00 元。

根据《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》和《鹏华添利交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司确定基金合同生效日，即 2016 年 1 月 29 日为本基金 B 类基金份额的份额折算日。当日折算前本基金 B 类基金份额总额为 1,005,302,000.00 份，本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司按照 100:1 的比例对 B 类基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由 B 类基金份额的登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2016 年 1 月 29 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证自律监管决定书[2016]29 号核准，本基金 10,053,020.00 基金份额于 2016 年 2 月 22 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券（包括超级短期融资券），一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单等银行存款，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、中期票据以及资产支持证券，期限在一年以内（含一年）的债券回购和中央银行票据以及中国证监会、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。本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

#### **6.4.2 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》、《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2017 年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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和基金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。

### 6.4.5 差错更正的说明

无。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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。对证券投资基金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，对国债、地方政府债以及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，股票的股息、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，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。

### 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	1,808,795.56
定期存款	911,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	207,000,000.00
1 个月以内	170,000,000.00
3 个月至 1 年	534,000,000.00
其他存款	-
合计：	912,808,795.56

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	961,737,012.06	961,967,000.00	229,987.94	0.0107%
	合计	961,737,012.06	961,967,000.00	229,987.94	0.0107%

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。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	266,038,239.95	-
合计	266,038,239.95	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：无。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	455.62
应收定期存款利息	2,706,368.99
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,025.00
应收债券利息	4,850,578.09
应收买入返售证券利息	45,537.43
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	7,604,965.13

**6.4.7.6 其他资产**

注：无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	22,539.61
合计	22,539.61

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	214,962.40
合计	214,962.40



## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华添利 A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	625,792,440.84	625,792,440.84
本期申购	383,249,422.59	383,249,422.59
本期赎回(以“-”号填列)	-874,476,127.15	-874,476,127.15
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	134,565,736.28	134,565,736.28

金额单位：人民币元

鹏华添利 B		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	53,865,652.19	5,386,565,218.72
本期申购	41,995,582.70	4,199,558,269.58
本期赎回(以“-”号填列)	-75,741,818.12	-7,574,181,811.79
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	20,119,416.77	2,011,941,676.51

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鹏华添利 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	4,745,047.06	-	4,745,047.06
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	-4,745,047.06	-	-4,745,047.06
本期末	-	-	-

单位：人民币元

鹏华添利 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	50,035,469.61	-	50,035,469.61
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	-50,035,469.61	-	-50,035,469.61
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	44,604.43
定期存款利息收入	40,496,308.14
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	432,788.06
其他	-
合计	40,973,700.63

注：其他为结算保证金利息收入

#### 6.4.7.12 股票投资收益

注：无。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	200,295.40
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	200,295.40
----	------------

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,522,221,398.91
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,500,035,361.05
减：应收利息总额	21,985,742.46
买卖债券差价收入	200,295.40

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.16 股利收益**

注：无。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

注：无。

**6.4.7.18 其他收入**

注：无。

**6.4.7.19 交易费用**

注：无。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	45,621.05
信息披露费	49,588.57
其他	600.00
账户维护费	18,000.00
上市年费	29,752.78
银行汇划费用	35,253.49
合计	178,815.89

**6.4.7.21 分部报告**

无。

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**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**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

**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
鹏华基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
鹏华资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述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****6.4.10.1.1 股票交易**

注：无。

**6.4.10.1.2 债券交易**

注：无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

注：无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：无。

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

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,921,636.57	10,539,841.27
其中：支付销售机构的客户维护费	544,977.69	879,842.12

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 0.30%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.30%÷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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,476,491.05	3,174,853.74

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为 0.09%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.09%÷当年天数。

#### 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		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华添利 A	鹏华添利 B	合计
中国工商银行	31,344.75	0.00	31,344.75
鹏华基金	324,389.83	904,226.45	1,228,616.28
国信证券	32.43	157,556.34	157,588.77
合计	355,767.01	1,061,782.79	1,417,549.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华添利 A	鹏华添利 B	合计

鹏华基金	1,169,624.43	2,378,522.32	3,548,146.75
国信证券	92.55	148,784.94	148,877.49
中国工商银行	38,886.39	0.00	38,886.39
合计	1,208,603.37	2,527,307.26	3,735,910.63

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。本基金年基金销售服务费率为 0.25%。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% ÷ 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未投资、持有本基金。

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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资及持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月29日(基金合同生效日)至 2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,808,795.56	44,604.43	1,048,279.24	85,774.81

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

鹏华添利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

4,816,948.70	-	-71,901.64	4,745,047.06	-
--------------	---	------------	--------------	---

## 鹏华添利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
50,563,469.58	-	-527,999.97	50,035,469.61	-

**6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：无。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

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，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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工商银行股份有限公司，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。

##### 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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	841,583,908.00	658,542,773.30
未评级	9,995,205.33	290,009,178.15
合计	851,579,113.33	948,551,951.45

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

##### 6.4.13.2.2 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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	110,157,898.73	0.00

合计	110,157,898.73	0.00
----	----------------	------

注：1. 未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。 2. 本基金上年末未持有长期信用评级债券。

### 6.4.13.3 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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

### 6.4.13.4 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”对本基金面临的市场风险进行监控，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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	912,808,795.56	-	-	-	-	912,808,795.56
交易性金融资产	961,737,012.06	-	-	-	-	961,737,012.06
买入返售金融资产	266,038,239.95	-	-	-	-	266,038,239.95
应收利息	-	-	-	-	7,604,965.13	7,604,965.13
应收申购款	-	-	-	-	188,100.00	188,100.00
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,140,584,047.57	-	-	-	7,793,065.13	2,148,377,112.70
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	20,030.03	20,030.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	648,562.94	648,562.94
应付托管费	-	-	-	-	194,568.87	194,568.87
应付销售服务费	-	-	-	-	540,469.15	540,469.15
应付交易费用	-	-	-	-	22,539.61	22,539.61
应付利润	-	-	-	-	228,566.91	228,566.91
其他负债	-	-	-	-	214,962.40	214,962.40
负债总计	-	-	-	-	1,869,699.91	1,869,699.91
利率敏感度缺口	2,140,584,047.57	-	-	-	5,923,365.22	2,146,507,412.79
上年度末 2016 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	2,490,509,821.26	-	-	-	-	2,490,509,821.26
结算备付金	1,137,010,900.00	-	-	-	-	1,137,010,900.00
交易性金融资产	948,551,951.45	-	-	-	-	948,551,951.45
买入返售金融资产	1,405,973,908.96	-	-	-	-	1,405,973,908.96
应收利息	-	-	-	-	34,026,427.21	34,026,427.21
应收申购款	-	-	-	-	17,006.08	17,006.08
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,982,046,581.67	-	-	-	34,043,433.29	6,016,090,014.96

负债						
应付管理人报酬		-	-	-	1,250,530.31	1,250,530.31
应付托管费		-	-	-	375,159.10	375,159.10
应付销售服务费		-	-	-	1,042,108.59	1,042,108.59
应付交易费用		-	-	-	54,088.88	54,088.88
应付利润		-	-	-	828,468.52	828,468.52
其他负债		-	-	-	182,000.00	182,000.00
负债总计		-	-	-	3,732,355.40	3,732,355.40
利率敏感度缺口	5,982,046,581.67		-	-	-30,311,077.89	6,012,357,659.56

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	494,387.86	302,600.18
市场利率上升 25 个基点	-493,767.53	-302,275.03	

注：

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：无。

#### **6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资（2016 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（2016 年 12 月 31 日：同）。

#### **6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

注：无。

#### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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：（1）金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；（2）纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；（3）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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 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	961,737,012.06	44.77
	其中: 债券	961,737,012.06	44.77
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	266,038,239.95	12.38
	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	912,808,795.56	42.49
4	其他各项资产	7,793,065.13	0.36
5	合计	2,148,377,112.70	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	1.26	
	其中: 买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中: 买断式回购融资	-	-

注: 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值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

注: 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	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	64
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	17

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 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比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	27.83	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	7.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	48.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	13.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	2.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.72	-

#### 7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	120,153,104.06	5.60
	其中：政策性金融债	120,153,104.06	5.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	841,583,908.00	39.21
8	其他	-	-
9	合计	961,737,012.06	44.80

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。

### 7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	140220	14 国开 20	1,100,000	110,157,898.73	5.13
2	111796347	17 汉口银行 CD046	1,000,000	99,752,386.52	4.65
3	111697608	16 杭州银行 CD126	1,000,000	98,992,828.44	4.61
4	111710304	17 兴业银行 CD304	1,000,000	98,960,166.94	4.61
5	111780219	17 徽商银行 CD096	1,000,000	98,915,754.51	4.61
6	111780401	17 成都农村商业银行 CD019	800,000	79,154,996.14	3.69
7	111780396	17 西安银行 CD021	800,000	79,122,196.95	3.69
8	111794596	17 重庆农村商业银行 CD064	600,000	59,391,959.35	2.77
9	111780222	17 桂林银行 CD098	500,000	49,832,819.05	2.32
10	111794826	17 天津银行 CD045	500,000	49,466,099.48	2.30

### 7.6 “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	0.0165%
报告期内偏离度的最低值	-0.0198%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0070%

### 7.7 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

注：无。



## 7.8 投资组合报告附注

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

(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。

### 7.8.3 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券中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。

### 7.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	7,604,965.13
4	应收申购款	188,100.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-

8	合计	7,793,065.13
---	----	--------------

### 7.8.5 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。

## § 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
鹏华添利A	14,342	9,382.63	102,014,523.27	75.81%	32,551,213.01	24.19%
鹏华添利B	1,120	17,963.76	8,164,476.44	40.58%	11,954,940.33	59.42%
合计	15,462	10,004.21	110,178,999.71	71.23%	44,506,153.34	28.77%

注：

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华添利 B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	李怡名	944,144.00	4.69%
2	中信建投证券股份有限公司	714,307.00	3.55%
3	顾妩茜	696,798.00	3.46%
4	上海勤远投资管理中心(有限合伙)－勤远同信三号私募投资基金	521,100.00	2.59%
5	杨德凤	509,266.00	2.53%
6	顾杨晟	476,747.00	2.37%
7	顾文明	464,340.00	2.31%
8	梁小红	459,700.00	2.28%
9	赵满龙	447,922.00	2.23%
10	平安资管－工商银行－鑫福 20 号资产管理产品	391,481.00	1.95%

注：持有人为场内持有人。

### 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	鹏华添利 A	362,579.92	0.27%
	鹏华添利 B	0.00	0.00%
	合计	362,579.92	0.23%

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。

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

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

注：（1）截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人投资、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。

（2）本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	鹏华添利 A	鹏华添利 B
基金合同生效日（2016 年 1 月 29 日）基金份额总额	435,346,154.89	1,005,302,000.00
本报告期期初基金份额总额	625,792,440.84	53,865,652.19
本报告期基金总申购份额	383,249,422.59	41,995,582.70
减：本报告期基金总赎回份额	874,476,127.15	75,741,818.12
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	134,565,736.28	20,119,416.77

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. 本基金基金合同生效于 2016 年 1 月 29 日。本基金的场内份额（B 类基金份额）份额折算日为基金合同生效当日。折算后本基金场内份额（B 类基金份额）的份额净值为 100.00 元。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动：

报告期内，经公司董事会审议通过，公司聘任韩亚庆先生担任公司副总经理。韩亚庆先生任职日期自 2017 年 3 月 22 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动：

本报告期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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、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。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
国信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

注：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要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- 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、及时性及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。我公司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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	1,935,800,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期没有发生偏离度绝对值超过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基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月5日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与北京肯特瑞财富投资管理有限公司认\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》	2017年1月10日
3	鹏华基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限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》	2017年1月10日
4	2016年第四季度报告	《上海证券报》	2017年1月19日
5	关于鹏华添利宝货币市场基金2017年春节前调整大额申购、转换转入和定期定额投资业务限额的公告	《上海证券报》	2017年1月23日
6	鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华添利宝货币市场基金基金份额持有人大会的公告	《上海证券报》	2017年2月18日
7	鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华添利宝货币市场基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《上海证券报》	2017年2月21日
8	鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华添利宝货币市场基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《上海证券报》	2017年2月22日
9	鹏华基金管理有限公司关于增加民生证券股份有限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》	2017年3月1日
10	鹏华添利宝货币市场基金更新的招募说明书摘要	《上海证券报》	2017年3月4日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与浙江同花顺基金销售有限公司认\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》	2017年3月20日
12	基金高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月23日

13	鹏华基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限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》	2017年3月30日
14	2016 年年度报告摘要	《上海证券报》	2017年3月30日
15	鹏华基金管理有限公司关于鹏华添利宝货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	《上海证券报》	2017年4月1日
16	2017 年第一季度报告	《上海证券报》	2017年4月24日
17	鹏华基金管理有限公司关于增加平安银行股份有限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》	2017年6月7日
18	鹏华基金管理有限公司关于增加上海挖财金融信息服务有限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》	2017年6月16日
19	鹏华基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问有限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》	2017年6月16日
20	鹏华基金管理有限公司关于网上直销交易系统升级切换及启用新版网上直销交易系统的提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年6月27日



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

#### 11.2 鹏华资产管理有限公司产品持有鹏华添利货币市场基金情况

公司/产品名称	期末持有份额（份）
鹏华资产—招商银行—外贸信托—稳进 5 期博普对冲证券投资集合资金信托计划	107.00
鹏华资产—浦发银行—华宝信托—华宝—银河 10 号集合资金信托计划	9,627.00

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》;
- (二)《鹏华添利交易型货币市场基金托管协议》;
- (三)《鹏华添利交易型货币市场基金 2017 年半年度报告》(原文)。

### 12.2 存放地点

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

北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司

### 12.3 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。

鹏华基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日