

鹏华金元宝货币市场基金 2018 年半年度 报告摘要

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 27 日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华金元宝货币
场内简称	-
基金主代码	004776
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 6 月 16 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
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	24,337,836,073.20 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

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	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。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。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。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。4、现金管理策略 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。
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。

注：无。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	田青
	联系电话	0755-82825720	010-67595096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-82021126	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
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	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 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

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 月 30 日
本期已实现收益	562,555,718.55
本期利润	562,555,718.55
本期净值收益率	2.1399%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 06 月 30 日
期末基金资产净值	24,337,836,073.20
期末基金份额净值	1.0000

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。

3.2 基金净值表现

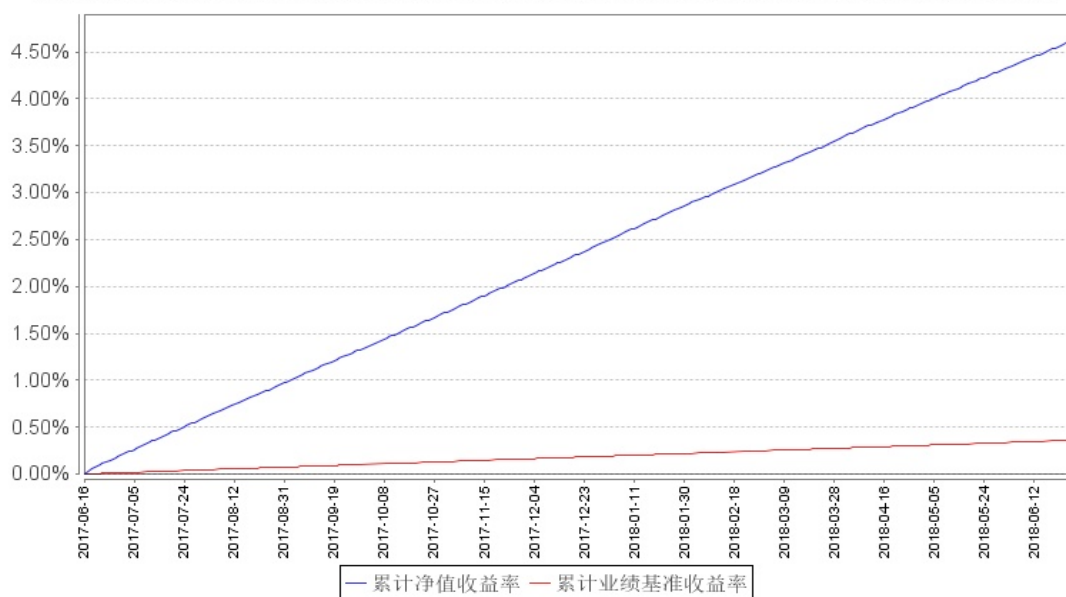
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.3477	0.0011	0.0288	0.0000	0.3189	0.0011
过去三个月	1.0449	0.0008	0.0873	0.0000	0.9576	0.0008
过去六个月	2.1399	0.0009	0.1736	0.0000	1.9663	0.0009
过去一年	4.4621	0.0007	0.3500	0.0000	4.1121	0.0007
自基金成立 起至今	4.6697	0.0007	0.3644	0.0000	4.3053	0.0007

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））

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

鹏华金元宝货币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



§ 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 2018 年 6 月，公司管理资产总规模达到 5,232.30 亿元，管理 152 只公募基金、10 只全国社保投资组合、3 只基本养老保险投资组合。经过近 20 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	2017-06-16	-	10	叶朝明先生，国籍中国，工商管理硕士，10 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 02 月担任鹏华增值宝货币基金基金经理，2015 年 01 月担任鹏华安盈宝货币基金基金经理，2015 年 07 月担任鹏华添利宝货币基金基金经理 2016 年 01 月担任鹏华添利基金基金经理 2017 年 05 月担任鹏华聚财通货币基金基金经理，2017 年 06 月担任鹏华盈余宝货币基金基金经理 2017 年 06 月担任鹏华金元宝货币基金基金经理，现同时担任

					固定收益部副总经理叶朝明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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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,因市场波动等被动原因存在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形,本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整,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

2018 年上半年,国内需求端相对疲软,经济走势略有回落,GDP 同比增速为 6.8%,较上年同期下降 0.1 个百分点。二季度 PPI 同比增速小幅回升,CPI 同比增速维持低位,整体通胀风险可控。中美贸易争端不确定性较大,美国经济增长仍较为强劲,人民币面临贬值压力。金融监管重点从去杠杆逐渐过渡到稳杠杆,货币政策边际放松,流动性保持合理充裕。上半年央行定向降准两次,在 6 月 24 日宣布第三次定向降准的消息,公开市场操作继续“削峰填谷”,资金面整体平稳宽松,资金利率中枢明显下滑。上半年债券市场整体收益率明显下降,其中 1 年期国开债收益率下降 100BP 左右,1 年期 AA+ 短融收益率下降 59bp 左右。

2018 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

2018 年上半年本基金的净值增长率为 2.1399%，同期业绩基准增长率为 0.17%。

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 2018 年下半年，经济基本面仍存在下行压力。上半年随着金融严监管的持续推进，委托贷款、信托贷款等表外非标融资显著收缩，广义社融对经济的支撑力度下降。下半年，社融增速回落的影响将逐渐体现，稳增长的压力上升，货币政策边际转松，财政政策更加积极。中美贸易摩擦带来的不确定性可能长期存在，在美国加息的背景下，人民币汇率仍面临一定的贬值压力。CPI 同比增速整体仍维持低位，PPI 同比增速预计进入回落区间，全年通胀风险依旧可控。在流动性合理充裕的市场环境下，货币市场利率中枢将进一步下行，资金面大概率保持平稳，同业存单增速放缓，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 2018 年下半年将坚持稳健操作，合理安排资产到期时间，确保组合的流动性安全。同时，综合运用好杠杆策略、久期策略和类属配置策略，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. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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 562,555,718.55 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

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：鹏华金元宝货币市场基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产		本期末	上年度末
----	--	-----	------

		2018 年 6 月 30 日	2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		8,588,228,846.61	16,553,027,821.95
结算备付金		20,474,090.91	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		14,980,446,969.29	13,233,791,768.30
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		14,980,446,969.29	13,233,791,768.30
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		1,315,512,683.45	3,758,023,019.62
应收证券清算款		-	-
应收利息		39,122,923.11	130,972,084.11
应收股利		-	-
应收申购款		4,049,777.15	532,226.81
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		24,947,835,290.52	33,676,346,920.79
负债和所有者权益		本期末	上年度末
		2018 年 6 月 30 日	2017 年 12 月 31 日
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		599,378,780.93	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,265,176.97	5,023,111.52
应付托管费		1,088,392.32	1,674,370.52
应付销售服务费		217,678.46	334,874.10
应付交易费用		203,125.55	220,921.12
应交税费		-	-
应付利息		234,841.92	-
应付利润		5,507,157.71	13,686,387.22
递延所得税负债		-	-
其他负债		104,063.46	137,000.00
负债合计		609,999,217.32	21,076,664.48
所有者权益：			
实收基金		24,337,836,073.20	33,655,270,256.31
未分配利润		-	-
所有者权益合计		24,337,836,073.20	33,655,270,256.31

负债和所有者权益总计		24,947,835,290.52	33,676,346,920.79
------------	--	-------------------	-------------------

注：报告截止日 2018 年 06 月 30 日，基金份额净值 1 元，基金份额总额 24,337,836,073.20 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华金元宝货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 06 月 16 日（基 金合同生效日） 至 2017 年 06 月 30 日
一、收入		601,338,426.99	19,267,449.10
1. 利息收入		597,098,716.64	19,267,449.10
其中：存款利息收入		208,607,954.40	19,266,300.06
债券利息收入		287,192,670.45	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		101,298,091.79	1,149.04
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,239,710.35	-
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		4,239,710.35	-
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		38,782,708.44	765,138.70
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	19,762,387.87	533,865.49
2. 托管费	6.4.8.2.2	6,587,462.64	177,955.13

3. 销售服务费	6.4.8.2.3	1,317,492.43	35,591.03
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		10,931,051.35	-
其中：卖出回购金融资产支出		10,931,051.35	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用		184,314.15	17,727.05
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		562,555,718.55	18,502,310.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		562,555,718.55	18,502,310.40

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华金元宝货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 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）	33,655,270,256.31	-	33,655,270,256.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	562,555,718.55	562,555,718.55
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）	-9,317,434,183.11	-	-9,317,434,183.11
其中：1. 基金申购款	26,763,056,727.79	-	26,763,056,727.79
2. 基金赎回款	-36,080,490,910.90	-	-36,080,490,910.90
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）	-	-562,555,718.55	-562,555,718.55
五、期末所有者权益（基金净值）	24,337,836,073.20	-	24,337,836,073.20
项目	上年度可比期间 2017 年 06 月 16 日（基金合同生效日） 至 2017 年 06 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	3,565,183,902.68	-	3,565,183,902.68

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,502,310.40	18,502,310.40
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)	8,631,505,380.72	-	8,631,505,380.72
其中: 1. 基金申购款	8,631,505,380.72	-	8,631,505,380.72
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-18,502,310.40	-18,502,310.40
五、期末所有者权益(基金净值)	12,196,689,283.40	-	12,196,689,283.40

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

苏波

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

鹏华金元宝货币市场基金(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”)《关于准予鹏华金元宝货币市场基金注册的批复》(证监许可[2014]1000号文)批准,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》及其配套规则和《鹏华金元宝货币市场基金基金合同》发售,基金合同于2017年6月16日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为3,565,183,902.68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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称:建设银行)。

本基金于2017年6月6日至2017年9月5日募集,并提前于2017年6月14日募集完毕。募集期间净认购资金人民币3,565,119,513.67元,认购资金在募集期间产生的利息人民币64,389.01元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计3,565,183,902.68份。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了普华永道中天验字

(2017) 第 629 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《鹏华金元宝货币市场基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《鹏华金元宝货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为法律法规允许投资的金融工具，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。未来若法律法规或监管机构允许货币市场基金投资其他货币市场工具的，在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的前提下，本基金可参与投资，不需召开基金份额持有人大会，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他产品，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：活期存款利率（税后）。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

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（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华金元宝货币市场基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 06 月 30 日的财务状况以及 2018 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

本报告期本基金没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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政策的补充通知》、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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注：无。

6.4.8.1.2 债券交易

注：无。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年06月16日（基金合同生效日） 至2017年06月30日	
	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 （%）
国信证券	31,993,700,000.00	100.00	12,000,000.00	100.00

6.4.8.1.4 权证交易

注：无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年06月16日（基金合 同生效日）至2017年 06月30日
----	--------------------------------	---

当期发生的基金应支付的管理费	19,762,387.87	533,865.49
其中：支付销售机构的客户维护费	35,590.75	20.12

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 0.15%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.15%÷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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 06 月 16 日（基金合 同生效日） 至 2017 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,587,462.64	177,955.13

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费年费率为 0.05%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.05%÷当年天数。

6.4.8.2.3 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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	鹏华金元宝货币	
鹏华基金公司	1,309,487.05	
合计	1,309,487.05	
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2017 年 06 月 16 日（基金合同生效日） 至 2017 年 06 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	鹏华金元宝货币	
鹏华基金公司	35,586.03	
合计	35,586.03	

注：支付基金销售机构的销售服务费年费率为 0.01%，逐日计提，按月支付。日销售服务费=前一日基金资产净值×0.01%÷当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日						
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
中国建设银行	-	-	0.00	0.00	1,101,058.00 0.00	466,774. 36

注：上年度可比期间无关联方银行间同业债券交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.8.4.2 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

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
鹏华资产管理 有限公司	11,359,972.02	0.05	51,551,605.03	0.15

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。

6.4.8.5 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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 06 月 16 日（基金合同生效日） 至 2017 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	7,428,846.61	234,489.95	1,795,963.89	72,069.83

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注:无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末,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余额 599,378,780.93 元,是以下如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
130229	13 国开 29	2018-07-05	100.05	442,000	44,222,100.00
150418	15 农发 18	2018-07-05	100.03	400,000	40,012,000.00
170017	17 付息国债 17	2018-07-05	100.02	2,200,000	220,044,000.00
180306	18 进出 06	2018-07-05	99.54	500,000	49,770,000.00
187703	18 贴现国开 03	2018-07-05	99.66	2,041,000	203,406,060.00
189916	18 贴现国债 16	2018-07-05	99.88	634,000	63,323,920.00
合计				6,217,000	620,778,080.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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	固定收益权益投资	14,980,446,969.29	60.05
	其中:债券	14,980,446,969.29	60.05
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	1,315,512,683.45	5.27
	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	8,608,702,937.52	34.51
4	其他各项资产	43,172,700.26	0.17
5	合计	24,947,835,290.52	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	2.35	
	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	599,378,780.93	2.46
	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	65
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	66
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	15

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：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的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	16.20	2.46
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

2	30 天（含）—60 天	4.75	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	—	—
3	60 天（含）—90 天	79.68	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	—	—
4	90 天（含）—120 天	—	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	—	—
5	120 天（含）—397 天（含）	1.70	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	—	—
合计		102.33	2.46

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	559,342,339.24	2.30
2	央行票据	—	—
3	金融债券	778,929,879.83	3.20
	其中：政策性金融债	778,929,879.83	3.20
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	同业存单	13,642,174,750.22	56.05
8	其他	—	—
9	合计	14,980,446,969.29	61.55
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	占基金资产净值比例（%）
1	111810263	18 兴业银行 CD263	16,000,000	1,587,230,301.81	6.52

2	111809181	18 浦发银行 CD181	13,000,000	1,289,208,009.44	5.30
3	111809172	18 浦发银行 CD172	8,000,000	793,720,412.44	3.26
4	111815262	18 民生银行 CD262	8,000,000	793,360,718.10	3.26
5	111811158	18 平安银行 CD158	8,000,000	793,359,714.44	3.26
6	111820110	18 广发银行 CD110	5,000,000	496,952,208.70	2.04
7	111811143	18 平安银行 CD143	5,000,000	496,335,765.75	2.04
8	111810275	18 兴业银行 CD275	5,000,000	495,850,350.47	2.04
9	111714258	17 江苏银行 CD258	5,000,000	495,653,490.06	2.04
10	111899730	18 成都银行 CD169	5,000,000	495,108,715.29	2.03

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	0.1020%
报告期内偏离度的最低值	0.0009%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0313%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 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收到公开谴责、处罚的情形

浦发银行 2018 年 1 月 19 日，上海浦东发展银行股份有限公司成都分行收到中国银行业监督管理委员会四川监管局行政处罚决定书（川银监罚字【2018】2 号），处罚决定如下：对成都分行内控管理严重失效，授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处，执行罚款 46,175 万元人民币。此外，对成都分行原行长、2 名副行长、1 名部门负责人和 1 名支行行长分别给予禁止终身从事银行业工作、取消其高级管理人员任职资格、警告及罚款。

针对成都分行上述违规经营事项，公司高度重视，在监管机构和地方政府的指导和帮助下，及时调整了成都分行经营班子，并对资产状况进行了全面评估，分类施策、强化管理，按照审慎原则计提风险拨备，稳妥有序化解风险。目前，成都分行已按监管要求完成了整改，总体风险可控，客户权益未受影响，经营管理迈入正轨。在此基础上，公司在全行范围内认真开展举一反三教育整改工作，深刻反思，统一思想，吸取教训；端正全行经营理念，更加关注安全性、流动性和效益性的平衡发展，强化统一法人管理；将防范和化解金融风险放在更加突出的位置，强化合规内控体制机制建设，着重提升内控执行力和有效性，确保全行依法合规、稳健发展。公司将认真贯彻落实党的十九大精神和全国金融工作会议、中央经济工作会议要求，积极服务实体经济，有效防控经营风险；坚持“回归本源、突出主业、做精专业、协调发展”，为供给侧结构性改革和广大客户提供更加优质的服务，努力为股东创造更大的价值，以良好的经营成果回报社会各界的关心和支持。

该公告称，上述处罚金额已全额计入 2017 年度公司损益，对公司的业务开展及持续经营无重大不利影响。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司债券的投资价值不产生重大影响。

该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名的其它证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.8.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	39,122,923.11
4	应收申购款	4,049,777.15
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	43,172,700.26

7.8.4 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。其中久期间决策略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

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 (%)
11,099	2,192,795.39	24,185,175,434.66	99.37	152,660,638.54	0.63

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)	占上市总份额比例 (%)
1	银行类机构	3,178,142,521.79	13.06
2	银行类机构	1,556,059,679.59	6.39
3	银行类机构	1,035,739,803.67	4.26

4	保险类机构	1,012,310,341.81	4.16
5	银行类机构	805,321,098.28	3.31
6	银行类机构	538,203,026.49	2.21
7	保险类机构	517,369,944.11	2.13
8	银行类机构	512,511,075.83	2.11
9	银行类机构	508,222,603.73	2.09
10	银行类机构	505,334,690.11	2.08

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,166,110.15	0.0048

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情况

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年6月16日） 基金份额总额	3,565,183,902.68
本报告期期初基金份额总额	33,655,270,256.31
本报告期基金总申购份额	26,763,056,727.79
减：本报告期基金总赎回份额	36,080,490,910.90
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	24,337,836,073.20

注：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。

§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

基金管理人的重大人事变动：基金管理人本报告期内无重大人事变动。

基金托管人的重大人事变动：基金托管人本报告期内无重大人事变动。

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

无。

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	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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	报告期新增
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	报告期新增
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-

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, 最近二年未发生因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

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
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	31,993,700,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注:无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20180125~20180306	6,084,447,881.06	93,694,640.73	3,000,000,000.00	3,178,142,521.79	13.06
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注:1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投;

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

12.2.1 鹏华资产管理有限公司及其产品持有鹏华金元宝货币市场基金情况:

公司/产品名称	期末持有份额 (份)
鹏华资产管理有限公司	11,359,972.02
鹏华资产瑞沅 1 号资产管理计划	1,041,738.97
鹏华资产稳鑫添利 21 号专项资产管理计划	27,023,942.37
鹏华资产稳鑫添利 22 号专项资产管理计划	178,410,000.00

鹏华基金管理有限公司

2018 年 08 月 27 日