

# 鹏华货币市场证券投资基金 2018 年半年度 报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 27 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。

基金托管人中国农业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。

## 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>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 债券回购融资情况.....	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	37
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	39
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	39
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.....	39

7.8 投资组合报告附注.....	39
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	42
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	45
10.9 其他重大事件.....	45
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>46</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.....	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华货币市场证券投资基金
基金简称	鹏华货币
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 年 4 月 12 日
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	4,798,559,798.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华货币 A	鹏华货币 B
下属分级基金的交易代码	160606	160609
报告期末下属分级基金的 份额总额	303,921,030.42 份	4,494,638,768.02 份

## 2.2 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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负 责人	姓名	张戈
	联系电话	0755-82825720
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn
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 楼	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 楼	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

## 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	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

## §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	报告期（2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 月 30 日）	
	鹏华货币 A	鹏华货币 B
本期已实现收 益	5,795,130.73	147,265,892.95
本期利润	5,795,130.73	147,265,892.95
本期净值收 益 率	1.9136%	2.0350%
3.1.2 期 末 数 据 和 指 标	报告期末（2018 年 06 月 30 日）	
期末基金资产 净值	303,921,030.42	4,494,638,768.02
期末基金份额 净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累 计 期 末 指 标	报告期末（2018 年 06 月 30 日）	
累计净值收 益 率	49.3254%	53.6153%

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。

### 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

鹏华货币 A

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.3194%	0.0007%	0.0288%	0.0000%	0.2906%	0.0007%
过去三个月	0.9413%	0.0010%	0.0873%	0.0000%	0.8540%	0.0010%
过去六个月	1.9136%	0.0008%	0.1736%	0.0000%	1.7400%	0.0008%
过去一年	3.8790%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	3.5290%	0.0008%
过去三年	9.6929%	0.0019%	1.0510%	0.0000%	8.6419%	0.0019%
自基金成立	49.3254%	0.0048%	9.6010%	0.0019%	39.7244%	0.0029%

鹏华货币 B

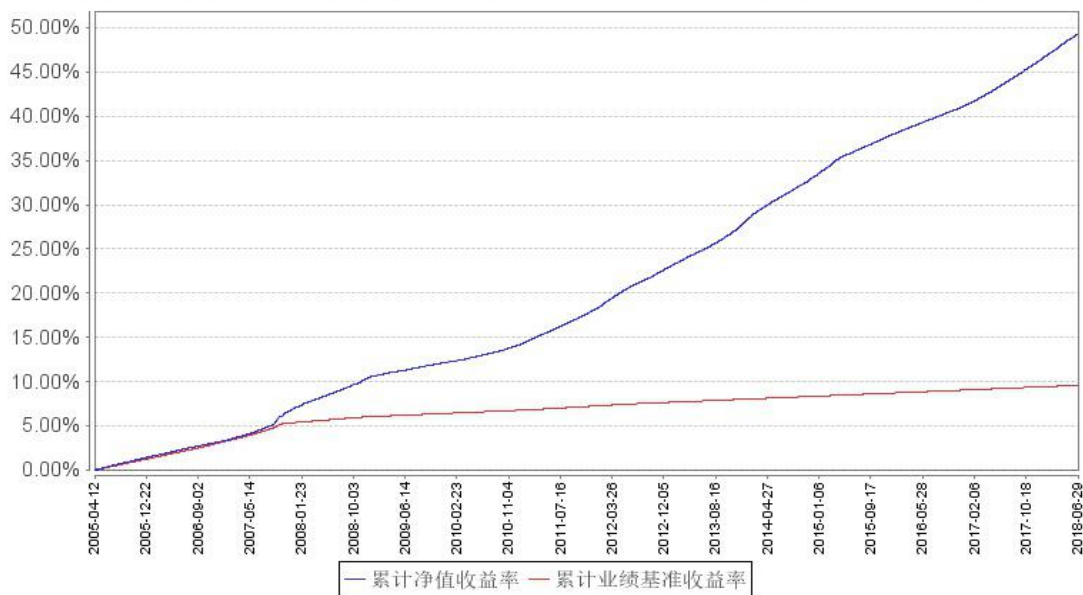
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.3392%	0.0007%	0.0288%	0.0000%	0.3104%	0.0007%
过去三个月	1.0017%	0.0010%	0.0873%	0.0000%	0.9144%	0.0010%
过去六个月	2.0350%	0.0008%	0.1736%	0.0000%	1.8614%	0.0008%
过去一年	4.1287%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	3.7787%	0.0008%
过去三年	10.4863%	0.0019%	1.0510%	0.0000%	9.4353%	0.0019%
自基金成立	53.6153%	0.0048%	9.6010%	0.0019%	44.0143%	0.0029%

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））

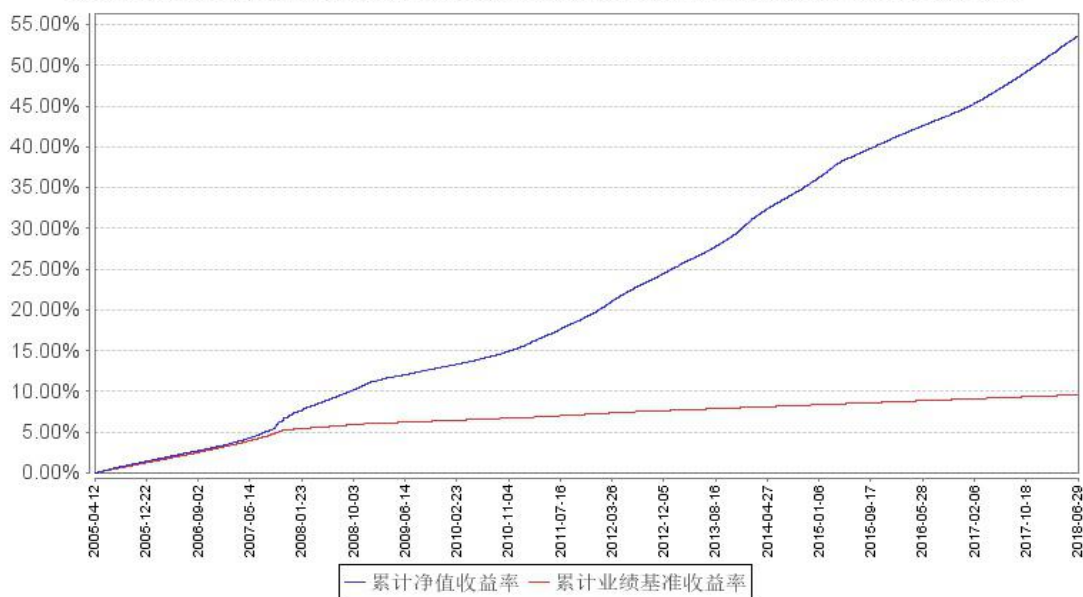
基金收益分配按月结转份额

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

鹏华货币A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



鹏华货币B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		
刘建岩	本基金基金 经理	2014-05-27	-	12	刘建岩先生，国籍中国，经济学硕士，12 年金融证券从业经验。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 04 月担任鹏华信用增利债券基金基金经理，2013 年 02 月至 2014 年 03 月担任鹏华产业债基金基金经理，2013 年 03 月至 2016 年 05 月担任鹏华国企债基金基金经理，2013 年 11 月至 2016 年 05 月担任鹏华丰融定期开放债券基金基金经理，2014 年 05 月担任鹏华货币基金基金经理，2015 年 03 月担任鹏华双债增利债券基金基金经理，2017 年 05 月至 2017 年 12 月担任鹏华丰嘉债券基金基金经理，2017 年 06 月担任鹏华聚财通货币基金基金经理，2017 年 07 月担任鹏华兴鑫宝货币基金基金经理，2017 年 08 月担任鹏华盈余宝货币基

					金基金经理，现同时担任固定收益部副总经理。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。

#### 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,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 年上半年我国货币政策由中性逐渐偏向宽松。一季度央行仍然立足于金融去杠杆,对政策力度的把握继续保持中性。但是进入二季度后受中美贸易摩擦爆发并加剧,以及国内社融、信贷数据偏弱等因素影响,央行开始偏向宽松。二季度央行两次宣布降准,同时没有跟随美联储加息而调整公开市场利率,二季度公开市场整体净投放约 8000 亿,资金面持续宽松。上半年人民币兑美元汇率先升后贬,中美贸易战爆发是 6 月人民币快速贬值的重要原因。

从市场情况看,上半年货币市场利率经历了较大波动,特别是二季度受货币政策调整影响,

短期利率出现明显下行。4月初至5月上旬受准备金率调整等因素推动短期利率出现一波快速下行，5月中旬至6月中旬再次趋升，但是6月的资金面情况大幅好于预期，因此6月下旬短期利率快速回落。与2017年末相比较，2018年半年末银行间3个月 Shibor 利率大幅下降 76bp 至 4.16%，6个月 Shibor 利率下降 66bp 至 4.22%。

本报告期内货币基金以配置存款、存单类资产为主，组合久期保持中性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018年上半年本基金A类份额净值增长率为1.9136%，B类份额净值增长率为2.0350%，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年下半年国内经济，内外部均面临较大的不确定性。从外部情况看，虽然从理性角度分析贸易战继续升级的概率不大，但是短期内摩擦无法调和，很可能对我国外需增长带来较大压力。从内部情况看，5、6两月的社融信贷数据下降幅度较大，央行也随即展开政策调整，促信贷、稳增长再次成为当前的重心之一。如果下半年持续采取偏宽松的货币政策和较为积极财政政策，经济很可能保持稳定，相应的代价是去杠杆进程必然有所反复，且人民币汇率将面临贬值压力。

从央行目前的货币政策基调来看，预计2018年下半年我国的流动性环境会整体较上半年宽松，货币市场利率的平均水平也很可能低于上半年。但政策调控的重心是推动资金进入实体经济，因此商业银行负债压力短期快速缓解带来的货币市场“资产荒”应不是常态，随着信贷投放增长和商业银行资产负债调整，预计四季度市场短期利率将有回升。

基于以上分析，2018年下半年鹏华货币基金将选择中性久期，密切跟踪市场变化，适时调整各类资产投资比重，在平衡资产安全性和流动性的前提下争取更好回报。

#### 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 153,061,023.68 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

在托管本基金的过程中，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基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—鹏华基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 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。

### 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

本托管人认为，鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、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。

### 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本基金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，未发现有害

基金持有人利益的行为。

## §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：鹏华货币市场证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,420,948,773.73	413,329,965.91
结算备付金		15,444,545.45	7,727,727.27
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,213,478,871.65	5,438,570,052.36
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,213,478,871.65	5,438,570,052.36
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	618,109,452.17	2,002,398,486.85
应收证券清算款		-	166,575.34
应收利息	6.4.7.5	14,915,061.79	33,564,868.55
应收股利		-	-
应收申购款		11,377,006.31	895,061.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,294,273,711.10	7,896,652,737.42
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 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		480,109,439.94	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		185,503.58	151,289,057.15
应付管理人报酬		820,332.36	1,653,829.71
应付托管费		256,353.85	516,821.77
应付销售服务费		107,753.21	172,478.90

应付交易费用	6.4.7.7	70,681.52	105,725.04
应交税费		71,831.18	66,600.00
应付利息		88,831.64	-
应付利润		13,875,330.06	24,185,754.05
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	127,855.32	220,293.29
负债合计		495,713,912.66	178,210,559.91
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	4,798,559,798.44	7,718,442,177.51
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		4,798,559,798.44	7,718,442,177.51
负债和所有者权益总计		5,294,273,711.10	7,896,652,737.42

注：报告截止日 2018 年 06 月 30 日，基金份额总额 4,798,559,798.44 份，其中鹏华货币 A 基金份额的份额总额为 303,921,030.42 份，份额净值 1.0000 元，鹏华货币 B 基金份额的份额总额为 4,494,638,768.02 份，份额净值 1.0000 元

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华货币市场证券投资基金

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 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		163,101,151.67	394,029,003.96
1. 利息收入		163,101,151.67	393,836,564.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	57,236,905.34	217,650,025.57
债券利息收入		70,836,701.85	121,929,232.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		35,027,544.48	54,257,306.36
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-	192,439.78
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	-	192,439.78
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	-	-
减：二、费用		10,040,127.99	46,018,280.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,065,563.04	32,219,702.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,895,488.52	9,763,546.50
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	742,982.72	1,542,765.06
4. 交易费用	6.4.7.19	835.55	41.28
5. 利息支出		1,129,837.45	2,270,016.85
其中：卖出回购金融资产支出		1,129,837.45	2,270,016.85
6. 税金及附加		2,727.81	-
7. 其他费用	6.4.7.20	202,692.90	222,207.33
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		153,061,023.68	348,010,723.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		153,061,023.68	348,010,723.96

### 6.3 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：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）	7,718,442,177.51	-	7,718,442,177.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	153,061,023.68	153,061,023.68
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）	-2,919,882,379.07	-	-2,919,882,379.07
其中：1. 基金申购款	16,331,047,327.90	-	16,331,047,327.90
2. 基金赎回款	-19,250,929,706.97	-	-19,250,929,706.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-153,061,023.68	-153,061,023.68

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	4,798,559,798.44	-	4,798,559,798.44
项目	上年度可比期间 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）	34,220,688,563.16	-	34,220,688,563.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	348,010,723.96	348,010,723.96
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）	-21,244,371,344.32	-	-21,244,371,344.32
其中：1. 基金申购款	63,286,656,597.49	-	63,286,656,597.49
2. 基金赎回款	-84,531,027,941.81	-	-84,531,027,941.81
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）	-	-348,010,723.96	-348,010,723.96
五、期末所有者权益（基金净值）	12,976,317,218.84	-	12,976,317,218.84

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] 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人民币3,353,255,243.01元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(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《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%。根据基金管理人 2017 年 7 月 6 日发布的《鹏华基金管理有限公司关于鹏华货币市场证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》及修改后的《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》，本基金的投资范围修改为：本基金的投资范围为法律法规允许投资的金融工具，包括现金，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（国债、金融债、公司债、企业债、次级债等）、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。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类别，并依据不同类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 类基金份额，并于升级当日适用 B 类的相关费率。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 类基金份额，并于降级当日适用 A 类的相关费率。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 B 类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类别基金份额总数。

#### 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》、《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》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

本基金本报告期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 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 2018年6月30日
活期存款	10,148,773.73
定期存款	1,410,800,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	188,500,000.00
存款期限3个月及以上	1,222,300,000.00
其他存款	-
合计	1,420,948,773.73

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018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	3,213,478,871.65	3,217,825,000.00	4,346,128.35	0.0906
	合计	3,213,478,871.65	3,217,825,000.00	4,346,128.35	0.0906
资产支持证券	-	-	-	-	
合计	3,213,478,871.65	3,217,825,000.00	4,346,128.35	0.0906	

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 2018年6月30日
----	-------------------

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	50,000,000.00	-
银行间市场	568,109,452.17	-
-	-	-
-	-	-
合计	618,109,452.17	-

#### 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 2018年6月30日
应收活期存款利息	4,069.39
应收定期存款利息	4,999,846.51
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	6,255.00
应收债券利息	8,630,254.79
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,274,636.10
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	14,915,061.79

#### 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 2018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	70,681.52
合计	70,681.52

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	905.54

预提费用	126,949.78
合计	127,855.32

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 鹏华货币 A

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	333,033,539.71	333,033,539.71
本期申购	280,233,489.65	280,233,489.65
本期赎回（以“-”号填列）	-309,345,998.94	-309,345,998.94
-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	303,921,030.42	303,921,030.42

##### 鹏华货币 B

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,385,408,637.80	7,385,408,637.80
本期申购	16,050,813,838.25	16,050,813,838.25
本期赎回（以“-”号填列）	-18,941,583,708.03	-18,941,583,708.03
-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	4,494,638,768.02	4,494,638,768.02

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

鹏华货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	5,795,130.73	-	5,795,130.73
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	-5,795,130.73	-	-5,795,130.73
本期末	-	-	-
鹏华货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	147,265,892.95	-	147,265,892.95
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	-147,265,892.95	-	-147,265,892.95
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	222,491.16
定期存款利息收入	56,936,091.24
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	78,322.94
其他	-
合计	57,236,905.34

#### 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

注：无。

##### 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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,725,552,230.00

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,685,000,000.00
减：应收利息总额	40,552,230.00
买卖债券差价收入	-

#### 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

单位:人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	835.55
合计	835.55

#### 6.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	49,588.57
银行汇划费用	57,113.12
账户维护费	35,883.84
其他	600.00
合计	202,692.90

注:其他为上交所数字证书费用。

#### 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

本基金管理人于2018年7月2日、2018年8月1日分别宣告本基金2018年第7号收益支付公告与2018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。

### 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（“鹏华基金公司”）	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

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
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,065,563.04	32,219,702.98
其中：支付销售机构的客户维护费	150,658.98	395,054.82

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。

#### 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
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,895,488.52	9,763,546.50

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。

#### 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		
	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		
	鹏华货币 A	鹏华货币 B	合计
国信证券	181.97	0.00	181.97
中国农业银行	53,177.14	2,410.80	55,587.94
鹏华基金公司	90,276.25	355,646.26	445,922.51
合计	143,635.36	358,057.06	501,692.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	鹏华货币 A	鹏华货币 B	合计
国信证券	332.72	1,248.52	1,581.24
中国农业银行	187,540.31	3,740.57	191,280.88
鹏华基金公司	112,912.90	933,415.16	1,046,328.06
合计	300,785.93	938,404.25	1,239,190.18

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，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。

#### 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

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
中国农业银 行	-	-	-	-	200,000,000.00	131,678.08
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 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
中国农业银 行	155,414,667.12	-	695,800,0 00.00	520,420 .27	499,550,000.00	38,087.11

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。

#### 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

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	鹏华货币 A	鹏华货币 B
基金合同生效日（2005 年 4 月 12 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	900,234,142.10
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-900,234,142.10
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-

占基金总份额比例		
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日	
	鹏华货币 A	鹏华货币 B
基金合同生效日（2005 年 4 月 12 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	130,172,891.47
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-130,172,891.47
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：（1）本基金管理人本报告期申购本基金份额 896,000,000 份，本期报告红利转投份额 4234142.10 份。（2）本基金管理人本报告期赎回本基金份额 900234142.10 份（包含红利转投份额 2305996.85 份）。（3）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。

#### 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没有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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 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
中国农业银行	10,148,773.73	222,491.16	24,698,482.72	534,759.14

#### 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：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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

鹏华货币 A
--------

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
5,621,094.69	350,017.98	-175,981.94	5,795,130.73	-
鹏华货币 B				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
124,199,594.42	33,200,740.58	-10,134,442.05	147,265,892.95	-

#### 6.4.12 期末(2018年06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

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 480,109,439.94 元, 是以如下债券作为抵押:

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
111899824	18 重庆银行 CD105	2018-07-02	98.97	1,856,000	183,681,693.89
150418	15 农发 18	2018-07-02	99.99	322,000	32,196,371.33
170017	17 付息国债 17	2018-07-02	100.04	900,000	90,035,107.99
170207	17 国开 07	2018-07-02	99.99	200,000	19,998,417.01
170410	17 农发 10	2018-07-02	100.00	500,000	50,000,274.62
189916	18 贴现国债 16	2018-07-02	99.89	1,100,000	109,880,830.18
合计				4,878,000	485,792,695.02

###### 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。

##### 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 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-

A-1 以下	50,000,759.41	-
未评级	289,801,082.14	454,840,371.31
合计	339,801,841.55	454,840,371.31

注:1. 未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债; A-1 以下包含未评级的超短期融资券。 2. 本基金上年末未持有短期信用评级债券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注:1. A-1 以下包含发行期限小于 1 年的资产支持证券。 2. 本基金上年末未持有短期信用评级资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位: 人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 06 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	2,803,681,537.76	4,573,696,554.91
未评级	-	-
合计	2,803,681,537.76	4,573,696,554.91

注:A-1 以下包含发行期限小于 1 年的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位: 人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	69,995,492.34	410,033,126.14
合计	69,995,492.34	410,033,126.14

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。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注:本基金上年末未持有长期信用评级资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注:1. AAA 以下包含发行期限大于 1 年的同业存单。 2. 本基金上年末未持有长期信用评级同业存单。

#### 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公司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。除卖出回购金融资产款余额 480,109,439.94 元将在一个月内到期且计息外，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。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。



#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种（企业债或短期融资券），并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，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，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50% 时，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 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2018 年 6 月 30 日，本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 49.04%，本基金投资组合的平均剩余期限为 60 天，平均剩余存续期为 60 天。

本基金投资于一家公司发行的证券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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流

动性情况良好。

#### 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 2018年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	1,420,948,773.73	-	-	-	1,420,948,773.73
结算备付金	15,444,545.45	-	-	-	15,444,545.45
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	3,213,478,871.65	-	-	-	3,213,478,871.65
买入返售金融资产	618,109,452.17	-	-	-	618,109,452.17
应收利息	-	-	-	14,915,061.79	14,915,061.79
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	11,377,006.31	11,377,006.31
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,267,981,643.00	-	-	26,292,068.10	5,294,273,711.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	185,503.58	185,503.58
应付管理人报酬	-	-	-	820,332.36	820,332.36
应付托管费	-	-	-	256,353.85	256,353.85
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	480,109,439.94	-	-	-	480,109,439.94
应付销售服务费	-	-	-	107,753.21	107,753.21
应付交易费用	-	-	-	70,681.52	70,681.52

应付利息	-	-	-	88,831.64	88,831.64
应交税费	-	-	-	71,831.18	71,831.18
应付利润	-	-	-	13,875,330.06	13,875,330.06
其他负债	-	-	-	127,855.32	127,855.32
负债总计	480,109,439.94	-	-	15,604,472.72	495,713,912.66
利率敏感度缺口	4,787,872,203.06	-	-	10,687,595.38	4,798,559,798.44
上年度末 2017 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月 -1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	413,329,965.91	-	-	-	413,329,965.91
结算备付金	7,727,727.27	-	-	-	7,727,727.27
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	5,438,570,052.36	-	-	-	5,438,570,052.36
买入返售金融资产	2,002,398,486.85	-	-	-	2,002,398,486.85
应收利息	-	-	-	33,564,868.55	33,564,868.55
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	895,061.14	895,061.14
应收证券清算款	-	-	-	166,575.34	166,575.34
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,862,026,232.39	-	-	34,626,505.03	7,896,652,737.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	151,289,057.15	151,289,057.15
应付管理人报酬	-	-	-	1,653,829.71	1,653,829.71
应付托管费	-	-	-	516,821.77	516,821.77
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	172,478.90	172,478.90
应付交易费用	-	-	-	105,725.04	105,725.04
应付利息	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	66,600.00	66,600.00
应付利润	-	-	-	24,185,754.05	24,185,754.05
其他负债	-	-	-	220,293.29	220,293.29
负债总计	-	-	-	178,210,559.91	178,210,559.91
利率敏感度缺口	7,862,026,232.39	-	-	-143,584,054.88	7,718,442,177.51

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。		
	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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-1, 571, 890. 74	-1, 529, 497. 36
	市场利率下降 25 个基点	1, 573, 695. 21	1, 530, 652. 63

注：无。

#### 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。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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。— 此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资（2017 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（2017 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

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	3,213,478,871.65	60.70
	其中：债券	3,213,478,871.65	60.70
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	618,109,452.17	11.68
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	1,436,393,319.18	27.13
4	其他各项资产	26,292,068.10	0.50
5	合计	5,294,273,711.10	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	1.31	
	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	480,109,439.94	10.01
	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:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	62

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	63
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	22

### 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的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	22.55	10.01
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	7.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	76.09	-
	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）	4.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	109.78	10.01

### 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	219,802,390.51	4.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	139,994,183.97	2.92
	其中：政策性金融债	139,994,183.97	2.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,000,759.41	1.04
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,803,681,537.76	58.43
8	其他	-	-
9	合计	3,213,478,871.65	66.97
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注:上表中, 附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	111809171	18 浦发银行 CD171	3,000,000	297,696,092.98	6.20
2	111803112	18 农业银行 CD112	2,000,000	198,550,930.51	4.14
3	111805119	18 建设银行 CD119	2,000,000	198,406,602.27	4.13
4	111806153	18 交通银行 CD153	2,000,000	198,376,282.90	4.13
5	111808161	18 中信银行 CD161	2,000,000	198,340,282.56	4.13
6	111808163	18 中信银行 CD163	2,000,000	198,238,351.92	4.13
7	111898916	18 徽商银行 CD087	2,000,000	198,211,547.90	4.13
8	111899635	18 杭州银行 CD047	2,000,000	198,058,590.72	4.13
9	111899777	18 厦门国际银行 CD137	2,000,000	198,044,189.58	4.13
10	111899824	18 重庆银行 CD105	2,000,000	197,932,859.80	4.12

### 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	0.0978%
报告期内偏离度的最低值	0.0036%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0255%

### 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	14,915,061.79
4	应收申购款	11,377,006.31
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	26,292,068.10

### 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 货币	61,756	4,921.32	77,140,265.31	25.38	226,780,765.11	74.62

A						
鹏华货币 B	6965,139,692.29	4,489,583,732.43	99.89	5,055,035.59	0.11	
合计	61,825	77,615.20	4,566,723,997.74	95.17	231,835,800.70	4.83

## 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	367,437,748.98	7.66
2	保险类机构	350,573,072.27	7.31
3	保险类机构	330,000,000.00	6.88
4	银行类机构	305,005,175.50	6.36
5	基金类机构	202,949,579.64	4.23
6	银行类机构	200,547,180.84	4.18
7	保险类机构	199,884,928.49	4.17
8	银行类机构	182,859,676.97	3.81
9	券商类机构	175,026,415.32	3.65
10	其他机构	139,918,694.07	2.92

## 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	鹏华货币 A	2,586.63	0.0009
	鹏华货币 B	-	-
	合计	2,586.63	0.0009

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

项目	鹏华货币 A	鹏华货币 B
基金合同生效日（2005 年 4 月 12 日）基金份额总额	3,353,743,565.06	-
本报告期期初基金份额总	333,033,539.71	7,385,408,637.80

额		
本报告期基金总申购份额	280,233,489.65	16,050,813,838.25
减：本报告期基金总赎回份额	309,345,998.94	18,941,583,708.03
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	303,921,030.42	4,494,638,768.02

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。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

### 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	
申万宏源	1	-	-	-	-	-

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。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，我公司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。

### 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
申万宏源	-	-	11,548,800,000.00	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	鹏华货币市场证券投资基金收益支付公告	《中国证券报》	2018 年 01 月 02 日
2	2017 年第四季度报告	《中国证券报》	2018 年 01 月 22 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开展基金转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 01 月 30 日
4	鹏华货币市场证券投资基金收益支付公告	《中国证券报》	2018 年 02 月 01 日
5	关于鹏华货币市场证券投资基金 2018 年春节假期前暂停申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《中国证券报》	2018 年 02 月 09 日
6	关于鹏华旗下 139 只基金修改基金合同的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 03 月 23 日
7	2017 年年度报告摘要	《中国证券报》	2018 年 03 月 29 日
8	鹏华货币市场证券投资基金收益支付公告	《中国证券报》	2018 年 04 月 02 日
9	鹏华基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售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》	2018 年 04 月 13 日
10	2018 年第一季度报告	《中国证券报》	2018 年 04 月 21 日
11	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低转换份额和账户最低余额限制的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 05 月 09 日
12	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》	2018 年 05 月 25 日
13	鹏华基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 05 月 28 日
14	鹏华货币市场证券投资基金收益支付公告	《中国证券报》	2018 年 06 月 01 日
15	鹏华基金管理有限公司关于提请非自然人客户及时登记受益所有人信息的	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 01 日

	公告		
16	鹏华基金关于调整旗下部分基金单笔最低定投金额限制的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 08 日
17	关于鹏华基金管理有限公司 T+0 赎回提现业务限额调整的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 20 日
18	关于鹏华基金管理有限公司 T+0 赎回提现业务限额调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 30 日

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

注:无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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 类	鹏华货币 B 类
海通证券股份有限公司-鹏华资产赤子之心价值 1 号专项资产管理计划	334,013.04	-
鹏华资产搏股通金 17（大岩资本）组合定增 2 号资产管理计划	4,551,500.47	-
鹏华资产康盛天天向上资产管理计划	3,014,554.41	-
鹏华资产鹏发长荣资产管理计划	-	11,296,495.58
鹏华资产浦润 1 号资产管理计划	574,958.61	-
鹏华资产浦润 2 号资产管理计划	595,132.59	-
鹏华资产思源 1 号专项资产管理计划	7,623.62	-
鹏华资产-铁狮门后海 1 号专项资产管理计划	-	23,414,680.27
鹏华资产-铁狮门后海 2 号专项资产管理计划	-	30,843,465.42
鹏华资产-铁狮门后海 4 号专项资产管理计划	-	18,218,405.51
中原鹏华-正商物业资产支持专项计划	-	5,116,860.71

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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 2018 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

### 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.cn>)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

2018 年 08 月 27 日