鹏华添利宝货币市场基金
2021年第1季度报告

2021年3月31日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：2021年4月21日

§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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 04 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华添利宝货币
基金主代码	001666
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 21 日
报告期末基金份额总额	102,266,340,986.55 份
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。　5、资产支持证券的投资策略　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。	
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。	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鹏华添利宝货币 A	鹏华添利宝货币 B
下属分级基金的交易代码	001666	009824
报告期末下属分级基金的份额总额	33,467,442,146.87 份	68,798,898,839.68 份
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

注：无。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日）	
	鹏华添利宝货币 A	鹏华添利宝货币 B
1.本期已实现收益	237,750,876.85	289,650,470.26
2.本期利润	237,750,876.85	289,650,470.26
3.期末基金资产净值	33,467,442,146.87	68,798,898,839.68

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，开放式基金的基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

鹏华添利宝货币 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标	业绩比较基准	业绩比较基准	①－③	②－④

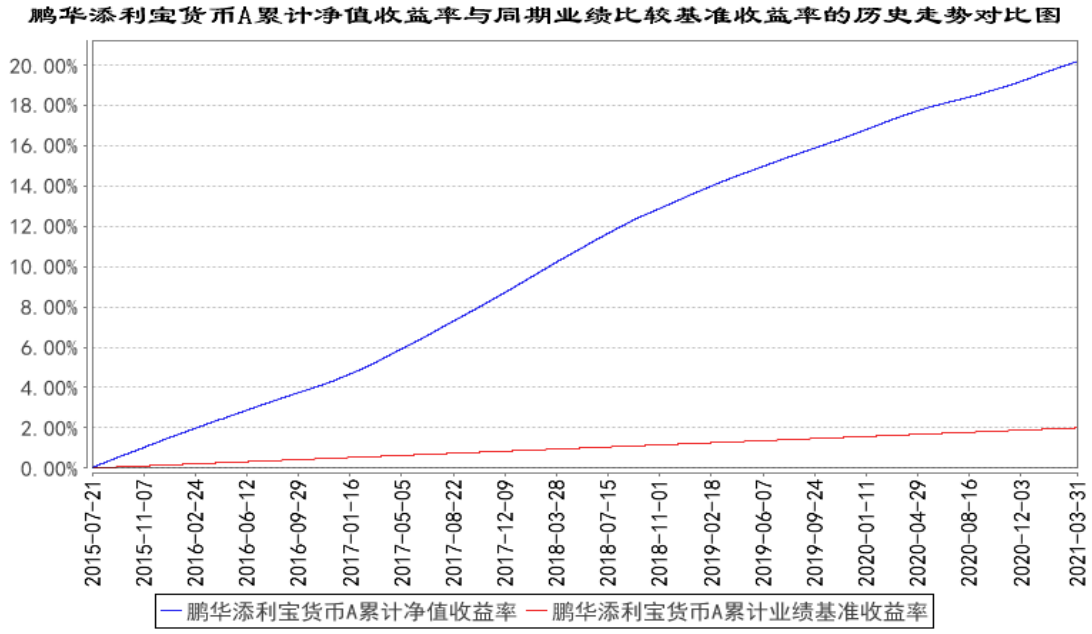
		准差②	收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	0.6263%	0.0005%	0.0863%	0.0000%	0.5400%	0.0005%
过去六个月	1.2325%	0.0006%	0.1745%	0.0000%	1.0580%	0.0006%
过去一年	2.2808%	0.0009%	0.3500%	0.0000%	1.9308%	0.0009%
过去三年	8.9971%	0.0019%	1.0510%	0.0000%	7.9461%	0.0019%
过去五年	17.5182%	0.0024%	1.7510%	0.0000%	15.7672%	0.0024%
自基金合同生效起至今	20.1949%	0.0024%	1.9955%	0.0000%	18.1994%	0.0024%

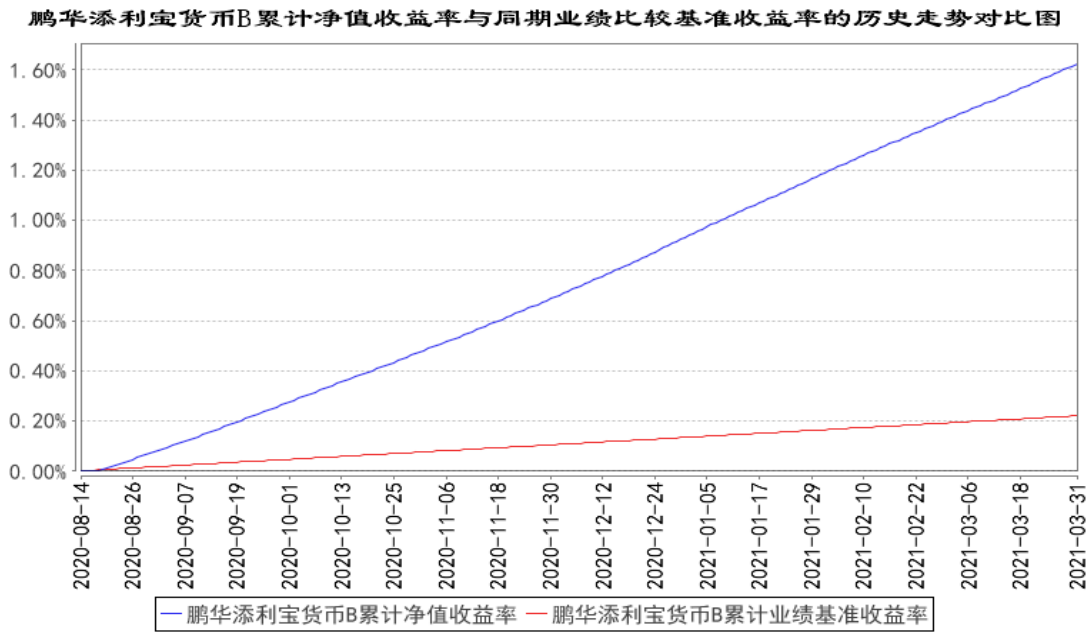
鹏华添利宝货币 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.6836%	0.0005%	0.0863%	0.0000%	0.5973%	0.0005%
过去六个月	1.3490%	0.0006%	0.1745%	0.0000%	1.1745%	0.0006%
自基金合同生效起至今	1.6219%	0.0013%	0.2205%	0.0000%	1.4014%	0.0013%

注：业绩比较基准=活期存款利率（税后）。， 本基金收益分配是按日结转份额。

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





注：1、本基金基金合同于 2015 年 07 月 21 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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶朝明	本基金基金经理	2015-07-21	-	13 年	叶朝明先生，国籍中国，工商管理硕士，13 年证券基金从业经验。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，现担任现金投资部总经理、基金经理。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，2018 年 08 月担任鹏华弘泰混合基金基金经理，2018 年 09 月担任鹏华货币基金基金经理，2018 年 09 月担任鹏华兴鑫宝货币基金基金经理，2018 年 11 月担任鹏华弘泽混合基金基金经理，2018 年 12 月担任鹏华弘康混合基金基金经

					理，2019年08月担任鹏华浮动净值型发起式货币基金基金经理，2019年10月担任鹏华稳利短债基金基金经理，2020年06月担任鹏华3个月中短债基金基金经理。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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021年一季度，从1-2月经济数据来看，国内经济持续回暖，工业生产景气度维持在较高水平，出口表现强劲，生产恢复快于消费，固定资产投资仍有修复空间。3月PMI数据显示经济仍有向上动能。金融数据方面，社融和M2同比维持在较高水平，中长期贷款需求旺盛。通胀方面，PPI同比回升，CPI同比为负，核心CPI同比温和回升，二季度PPI预计继续上升，但整体通胀风险可控。政策方面，积极的财政政策提质增效，稳健的货币政策灵活精准、合理适度。海外经济整体延续复苏趋势，美国加快疫苗接种进度，并公布新一轮财政刺激计划。美联储对短期通胀的容忍度较高，维持联邦基金利率和购债速度不变。人民币汇率表现平稳，短期内不会对国内货币政策造成压力。公开市场操作方面，一季度央行净回笼5505亿，公开市场操作利率和法定存款准备金率保持不变，LPR报价与上一季度持平。资金利率在1月底有明显冲高，波动性加大，随后

回落到政策利率附近。一季度银行间 7 天质押式回购加权利率均值为 2.41%，较上一季度下降 9BP。3 个月期限 AAA 同业存单到期收益率均值在 2.61%，较上一季度下降 33BP。

2021 年一季度，债券市场收益率呈现震荡走势。其中，1 年期国开债收益率上行 20BP 左右，1 年期 AA+短融收益率下行 23BP 左右。

本基金一季度在绝对收益较高的时点，增加对长期限资产的配置，保持中性的剩余期限，在保证组合良好流动性的基础上，提高组合整体收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2021 年一季度本基金 A 类份额净值增长率为 0.6263%，B 类份额净值增长率为 0.6836%，A 类份额同期业绩基准增长率为 0.0863%，B 类份额同期业绩基准增长率为 0.0863%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	53,533,367,359.03	45.41
	其中：债券	53,163,367,359.03	45.10
	资产支持证券	370,000,000.00	0.31
2	买入返售金融资产	38,939,203,899.20	33.03
	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	25,143,851,324.98	21.33
4	其他资产	270,394,952.74	0.23
5	合计	117,886,817,535.95	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	4.58	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	15,067,544,636.86	14.73
	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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	86
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	46

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"。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	59.20	15.24
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	15.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	16.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	2.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	21.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		115.01	15.24

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	150,028,722.02	0.15

2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,068,647,689.60	4.96
	其中：政策性金融债	5,068,647,689.60	4.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,060,249,327.07	1.04
6	中期票据	-	-
7	同业存单	46,884,441,620.34	45.85
8	其他	-	-
9	合计	53,163,367,359.03	51.99
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。

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112107030	21 招商银行 CD030	30,000,000	2,987,635,194.61	2.92
2	112104019	21 中国银行 CD019	26,000,000	2,546,402,278.37	2.49
3	112020235	20 广发银行 CD235	25,000,000	2,485,059,423.99	2.43
4	112005171	20 建设银行 CD171	19,300,000	1,918,539,823.97	1.88
5	112010121	20 兴业银行 CD121	12,000,000	1,198,414,970.34	1.17
6	112015182	20 民生银行 CD182	12,000,000	1,197,831,419.97	1.17
7	112118010	21 华夏银行 CD010	10,000,000	997,747,856.26	0.98
8	112120041	21 广发银行 CD041	10,000,000	997,747,856.26	0.98
9	112106036	21 交通银行 CD036	10,000,000	996,285,587.44	0.97
10	112193263	21 杭州银行 CD035	10,000,000	995,850,980.37	0.97
11	112193373	21 南京银行	10,000,000	995,850,980.37	0.97

		CD035			

5.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1025%
报告期内偏离度的最低值	-0.0329%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0330%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	179672	10 欲晓 A1	2,800,000	280,000,000.00	0.27
2	169598	惠盈 10A	900,000	90,000,000.00	0.09

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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

兴业银行

2021 年 1 月，公司曾收到《交易商协会对永煤控股相关 11 家机构作出处分决定》。

一、处罚事由

经交易商协会查明，永煤控股突发性违约的背后，涉及多家机构、多类主体、多个环节的违

规，既有发行人信息披露和合规意识淡漠的情况，也有中介机构“守门人”作用履职不充分的现象，还暴露出部分金融机构未能遵守执业道德的问题。其中兴业银行作为主承销商之一，存在内控管理不到位的情况。

二、处罚机构及处罚结果

经中国银行间市场交易商协会自律处分会议审议，对兴业银行予以通报批评或诫勉谈话。

2020 年 9 月，公司曾收到《福建银保监局行政处罚信息公开表(闽银保监罚决字〔2020〕24 号) 》。

一、处罚事由

同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保。

二、处罚机构及处罚结果

依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、四十六条、《中华人民共和国商业银行法》第七十四条，中国银保监会福建监管局予以兴业银行没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元的行政处罚决定。

2020 年 5 月，公司曾收到《交易商协会自律处分信息——兴业银行 》。

一、处罚事由

兴业银行作为债务融资工具主承销商，在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本。

二、处罚机构及处罚结果

依据相关自律规定，经中国银行间市场交易商协会 2020 年第 5 次自律处分会议审议，对兴业银行予以警告，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

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。上述通告对该公司股票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。

民生银行

本基金前十大持仓中的民生银行股份有限公司

于 2020 年 9 月 4 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚,信息如下:

行政处罚决定书文号: 银保监罚决字〔2020〕43 号

被处罚当事人:中国民生银行股份有限公司

主要违法违规事实:

（一）违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资

（二）为“四证”不全的房地产项目提供融资

（三）违规为土地储备中心提供融资

（四）违规为地方政府提供融资，接受地方政府担保或承诺

（五）多名股东在已派出董事的情况下，以推荐代替提名方式推举独立董事及监事

（六）多名股东在股权质押超比例的情况下违规在股东大会上行使表决权，派出董事在董事会上的表决权也未受限

（七）股东持股份额发生重大变化未向监管部门报告

（八）多名拟任高管人员及董事未经核准即履职

（九）关联交易不合规

（十）理财产品风险信息披露不合规

（十一）年报信息披露不真实

（十二）贷款资金被挪用，虚增贷款

（十三）以贷转存，虚增存款

（十四）贸易背景审查不尽职

（十五）向关系人发放信用贷款

（十六）违规转让正常类信贷资产

（十七）违规转让不良资产

（十八）同业投资他行非保本理财产品审查不到位，接受对方机构违规担保，少计风险加权资产

（十九）同业投资未穿透底层资产计提资本拨备，少计风险加权资产

（二十）同业存放业务期限超过一年

（二十一）违规开展票据转贴现交易

（二十二）个别理财产品管理费长期未入账

（二十三）理财业务风险隔离不充分

（二十四）违规向非高净值客户销售投向股权类资产的理财产品

（二十五）非标准化资产纳入标准化资产统计，实际非标债权资产比例超监管要求

（二十六）违规出具补充协议及与事实不符的投资说明

（二十七）以代销名义变相向本行授信客户融资，并承担兜底风险

（二十八）向不符合条件的借款人办理收益权转让再融资业务

（二十九）代理福费廷业务违规承担风险，会计处理不规范

（三十）迟报瞒报多起案件（风险）信息

行政处罚依据:《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十条、第二十一条、第四十六条第（一）、（五）项，《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第五十五条、第七十四条规定和相关审慎经营规则

行政处罚决定:没收违法所得296.47万元，罚款10486.47万元，罚没合计10782.94万元

作出处罚决定的机关名称:中国银行保险监督管理委员会

作出处罚决定的日期: 2020年7月14日

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。上述通告对该公司股票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。

中国银行

2020年12月，公司曾收到《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字〔2020〕60号）　》。

一、处罚事由

中国银行“原油宝”产品风险事件相关违法违规行为主要包括：产品管理不规范，包括保证金相关合同条款不清晰、产品后评价工作不独立、未对产品开展压力测试相关工作等；风险管理不审慎，包括市场风险限额设置存在缺陷、市场风险限额调整和超限操作不规范、交易系统功能存在缺陷未按要求及时整改等；内控管理不健全，包括绩效考核和激励机制不合理、消费者权益保护履职不足、全行内控合规检查未涵盖全球市场部对私产品销售管理等；销售管理不合规，包括个别客户年龄不满足准入要求、部分宣传销售文本内容存在夸大或者片面宣传、采取赠送实物等方式销售产品等。

二、处罚机构及处罚结果

根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会予以中国银行罚款5050万元的行政处罚决定。

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。上述通告对该公司股票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。

交通银行

本基金前十大持仓中的交通银行股份有限公司

于2020年10月21日收到湖北证监局关于对交通银行股份有限公司湖北省分行采取责令改正措施的决定

交通银行股份有限公司湖北省分行：

经查，存在以下违规行为：部分未取得基金销售业务资格（基金从业资格）的员工从事基金销售业务、未按规定完成基金销售业务监察稽核报告、基金销售业务反洗钱工作制度和落实情况未向湖北证监局报备。上述情况违反了《证券投资基金销售管理办法》第五十七条第二款、第八十五条和《证券期货业反洗钱工作实施办法》第九条、第十条、第十二条、第十五条、第十六条的规定。

根据《证券投资基金销售管理办法》第八十七条、《证券期货业反洗钱工作实施办法》第十七条的规定，决定对交通银行股份有限公司湖北省分行采取责令改正的行政监管措施。

如果对本监督管理措施不服，可在收到本决定书之日起60日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起6个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

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。

广发银行

一、处罚事由

广发银行收到广东银保监局处罚（粤银保监罚决字〔2020〕27号），涉及以下违法违规事项：贷款分类、从业人员处罚信息报送、信用卡“财智金”业务贷后管理严重违反审慎经营规则。

二、处罚机构及处罚结果

根据《贷款风险分类指引》第十条、第十一条、第十二条，《银行业金融机构从业人员处罚信息管理办法》第九条，《关于进一步防范银行业金融机构与证券公司业务往来相关风险的通知》第三点、第四点、第五点，《中国银监会关于商业银行信用卡业务有关问题的通知》第二条、《中国银监会办公厅关于加强信用卡预借现金业务风险管理的通知》第一条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条第三款、第四十六条第五项相关规定，广东银保监局对广发银行处以220万元罚款。

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。上述通告对该公司证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。

一、处罚事由

公司收到湖北证监局处罚，广发银行武汉分行在基金销售业务存在以下违规行为：未在销售网点和公司网站公示基金销售业务经营许可证；网上销售渠道未签署基金合同；基金销售业务负责人和部分销售人员未获得基金从业资格；反洗钱报备落实不到位。上述行为违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（证监会令第175号）第三条、《关于实施<公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法>的规定》（证监会公告[2020]58号）第六条、第十七条、《证券期货业反洗钱工作实施办法》（证监会令第68号）第十条、第十二条、第十五条、第十六条的规定。

二、处罚机构及处罚结果

湖北证监局根据《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》第五十三条、《证券期货业反洗钱工作实施办法》第十七条的规定，决定对广发银行采取责令改正的监管措施。广发银行应在本监管措施下发之日起60日内完成整改，并向湖北证监局报送书面整改报告。

如果对监督管理措施不服，可以在收到本决定书之日起60日内向中国证监会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起6个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

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。上述通告对该公司证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。

建设银行

一、处罚事由

建设银行收到银保监会处罚通知，主要涉及以下违法违规事项：

（一）内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件 ；

（二）理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及提供土地储备融资；

（三）逆流程开展业务操作；

（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；

（五）未做到理财业务与自营业务风险隔离；

（六）个人理财资金违规投资；

（七）违规为理财产品提供隐性担保；

（八）同业投资违规接受担保。

二、处罚机构及处罚结果

2020年7月13日，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第

（五）项的规定和相关审慎经营规则，中国银保监会对建设银行处以 3920 万元罚款。

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。上述通告对该公司证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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	228,988,627.27
4	应收申购款	41,406,325.47
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	270,394,952.74

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华添利宝货币 A	鹏华添利宝货币 B
报告期期初基金份额总额	39,057,986,368.11	22,572,306,264.15
报告期期间基金总申购份额	28,356,249,349.08	54,655,493,062.39
报告期期间基金总赎回份额	33,946,793,570.32	8,428,900,486.86
报告期期末基金份额总额	33,467,442,146.87	68,798,898,839.68

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申购	2021-02-04	240,000,000.00	240,000,000.00	-

2	申购	2021-03-05	200,000,000.00	200,000,000.00	-
合计			440,000,000.00	440,000,000.00	

注：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。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（一）《鹏华添利宝货币市场基金基金合同》；

（二）《鹏华添利宝货币市场基金托管协议》；

（三）《鹏华添利宝货币市场基金 2021 年第 1 季度报告》（原文）。

9.2 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。

9.3 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
2021 年 4 月 21 日