鹏华安盈宝货币市场基金
2021年第3季度报告

2021年9月30日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2021年10月26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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华安盈宝货币
基金主代码	000905
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 1 月 27 日
报告期末基金份额总额	28,118,784,499.76 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	平安银行股份有限公司

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 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）
1.本期已实现收益	188,424,520.27
2.本期利润	188,424,520.27
3.期末基金资产净值	28,118,784,499.76

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

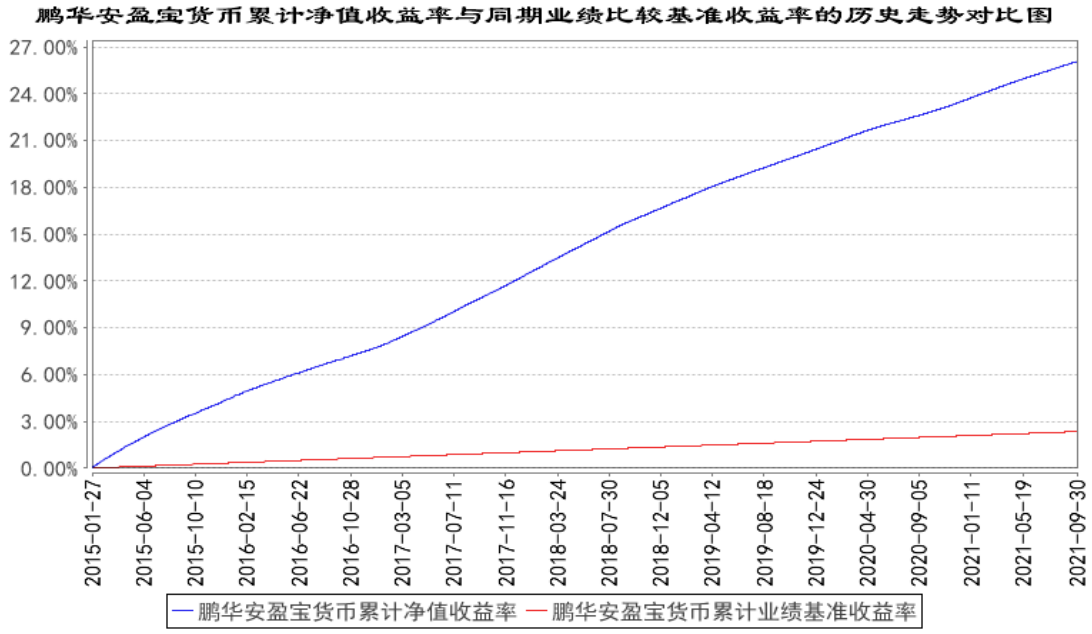
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.6116%	0.0003%	0.0882%	0.0000%	0.5234%	0.0003%
过去六个月	1.2592%	0.0004%	0.1755%	0.0000%	1.0837%	0.0004%
过去一年	2.6474%	0.0007%	0.3500%	0.0000%	2.2974%	0.0007%
过去三年	8.7400%	0.0012%	1.0510%	0.0000%	7.6890%	0.0012%
过去五年	17.8628%	0.0022%	1.7510%	0.0000%	16.1118%	0.0022%

自基金合同生效起至今	26.0751%	0.0027%	2.3388%	0.0000%	23.7363%	0.0027%

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 01 月 27 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	基金经理	2015-01-27	-	13 年	叶朝明先生，国籍中国，工商管理硕士，13 年证券从业经验。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，现担任现金投资部总经理、基金经理。2014 年 02 月至今担任鹏华增值宝货币市场基金基金经理，2015 年 01 月至今担任鹏华安盈宝货币市场基金基金经理，2015 年 07 月至今担任鹏华添利宝货币市场基金基金经理，2016 年 01 月至今担任鹏华添利交易型货币市场基金基金经理，2017 年 05 月至 2021 年 08 月担任鹏华聚财通货币市场

					基金基金经理,2017 年 06 月至 2021 年 08 月担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理,2017 年 06 月至今担任鹏华金元宝货币市场基金基金经理,2018 年 08 月至 2021 年 08 月担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018 年 09 月至 2021 年 08 月担任鹏华兴鑫宝货币市场基金基金经理,2018 年 09 月至 2021 年 08 月担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2018 年 11 月至 2021 年 08 月担任鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018 年 12 月至今担任鹏华弘康灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2019 年 08 月至今担任鹏华浮动净值型发起式货币市场基金基金经理,2019 年 10 月至今担任鹏华稳利短债债券型证券投资基金基金经理,2020 年 06 月至 2021 年 08 月担任鹏华中短债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2021 年 07 月至今担任鹏华稳泰 30 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理,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发生变动,增聘方莉为本基金基金经理，李可颖不再担任本基金基金经理。
李可颖	基金经理	2017-01-07	2021-09-10	11 年	李可颖女士，国籍中国，经济学硕士，11 年证券从业经验。历任渤海证券固定收益部销售交易员,长盛基金交易部债券交易员，博时基金交易部高级债券交易员，从事债券研究、交易工作；2015 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司,历任固定收益部基金经理助理，基金经理，现担任现金投资部副总监/基金经理。2017 年 01 月至 2021 年 09 月担任鹏华安盈宝货币市场基金基金经理,2019 年 12 月至 2021 年 09 月担任鹏华金元宝货币市场基金基金经理,李可颖女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动,增聘方莉为本基金基金经理,李可颖不再担任本基金基金经理。
方莉	基金经理	2021-08-24	-	15 年	方莉女士，国籍中国，工商管理硕士，15 年证券从业经验。曾任大连银行总行资金运营部交易员。2013 年 02 月加盟鹏华基金管理有限公司,历任集中交易室债券交易员、高级债券交易员；2016 年 07 月任

					职于固定收益部，担任投资经理，现担任现金投资部基金经理。2020年02月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华增值宝货币市场基金基金经理,2021年08月至今担任鹏华安盈宝货币市场基金基金经理,方莉女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动,增聘方莉为本基金基金经理,李可颖不再担任本基金基金经理。

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年三季度，国内经济下行压力加大，在自然灾害、疫情散点复发以及限电限产政策等因素的影响下，供需两端均受到一定影响。生产端工业增加值增速小幅下滑，9月PMI生产指数下降至50以下。需求端出口保持韧性，制造业投资和基建投资修复缓慢，房地产投资和消费增速下行。9月制造业PMI数据降至荣枯线以下，四季度经济前景不容乐观。金融数据方面，社融与M2同比下滑，后续随着地方政府债供给增加，社融和M2增速有望企稳回升。通胀方面，PPI上行创出近期新高，CPI小幅下行，两者差距进一步拉大，能源等大宗商品价格处于高位，但主要是供

给端的问题，全面通胀的风险有限。政策方面更加强调跨周期调节，稳健的货币政策要灵活精准、合理适度。个别房地产企业出现债务违约，但行业整体债务情况较为稳定，对金融体系的风险传导暂时可控。三季度货币政策委员会例会也提出增强信贷总量增长的稳定性，维护房地产市场的健康发展。海外方面，疫情仍有反复，通胀高企，市场预期美联储将在四季度宣布缩减资产购买计划，美元升值，部分经济体已经开启加息。人民币汇率相对稳定，央行货币政策将继续以国内为主。具体操作上，7 月全面降准 0.5 个百分点，降准释放长期资金约 1 万亿元，9 月新增 3000 亿元支小再贷款额度，支持实体经济。公开市场操作净投放 2900 亿元，7 天逆回购利率和 MLF 利率保持不变，LPR 报价与上一季度持平。资金利率继续围绕政策利率波动。银行间 7 天质押式回购加权利率均值为 2.28%，较上一季度上升 3BP。3 个月期限 AAA 同业存单到期收益率均值在 2.33%，较上一季度下降 13BP。

2021 年三季度，债券市场收益率下行。其中，1 年期国开债收益率下行 12BP 左右，1 年期 AA+短融收益率下行 9BP 左右。

本基金三季度保持中性偏长的剩余期限和灵活的杠杆水平，在季末和税期等资金面偏紧的时点增加买入返售资产配置，提高组合整体收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 0.6116%，同期业绩比较基准增长率为 0.0882%。

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	13,129,077,465.83	43.78
	其中：债券	12,008,077,465.83	40.05
	资产支持证券	1,121,000,000.00	3.74
2	买入返售金融资产	3,932,957,179.43	13.12
	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	12,643,349,599.88	42.16
4	其他资产	280,516,484.49	0.94
5	合计	29,985,900,729.63	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	3.59	
	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	1,858,033,192.99	6.61
	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	83
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	83

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	43.90	6.61
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	2.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	25.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	8.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	24.68	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		105.64	6.61

5.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,874,622,453.98	6.67
	其中：政策性金融债	1,874,622,453.98	6.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	170,003,647.86	0.60
6	中期票据	-	-
7	同业存单	9,963,451,363.99	35.43
8	其他	-	-
9	合计	12,008,077,465.83	42.70
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。

5.5 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	112184707	21 南京银行 CD125	10,000,000	999,148,328.30	3.55
2	112184672	21 宁波银行 CD188	10,000,000	999,148,135.13	3.55
3	170403	17 农发 03	7,700,000	772,763,103.18	2.75
4	112182395	21 北京农商银行 CD150	7,000,000	696,224,318.35	2.48
5	190202	19 国开 02	6,100,000	611,330,269.03	2.17
6	112195860	21 东莞银行 CD033	5,000,000	496,678,758.97	1.77
7	112106215	21 交通银行 CD215	4,000,000	399,266,576.00	1.42
8	112103021	21 农业银行 CD021	4,000,000	397,802,629.63	1.41

9	112182816	21成都农商银行CD137	3,500,000	347,923,159.40	1.24
10	112186835	21南京银行CD153	3,500,000	342,016,900.99	1.22

5.6 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0421%
报告期内偏离度的最低值	0.0126%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0264%

5.7 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	189485	15欲晓A2	1,670,000	167,000,000.00	0.59
2	189455	致远09A2	1,000,000	100,000,000.00	0.36
3	189098	致远04A2	740,000	74,000,000.00	0.26
4	136429	鹏程12A1	700,000	70,000,000.00	0.25
5	189285	GC致远A2	670,000	67,000,000.00	0.24
6	137486	万科17优	650,000	65,000,000.00	0.23
7	137586	永熙优34	620,000	62,000,000.00	0.22
8	189284	GC致远A1	600,000	60,000,000.00	0.21
9	137469	鹏程9A1	500,000	50,000,000.00	0.18
10	137894	万科18优	500,000	50,000,000.00	0.18

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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

国家开发银行

国家开发银行旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会大连监管局、陕西监管局、浙江监管局、国家外汇管理局广西壮族自治区分局、海南省分局和中国人民银行南宁中心支行的行政处罚。

2020 年 12 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会对国家开发银行的以下违法违规行为一、为违规的政府购买服务项目提供融资，二、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况，三、违规变相发放土地储备贷款，四、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款，五、贷款风险分类不准确，六、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产，七、违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量，八、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品，九、扶贫贷款存贷挂钩，十、易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁，十一、未落实同业业务交易对手名单制监管要求，十二、以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理，十三、以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理，十四、风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务，十五、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况，十六、逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务，十七、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表，十八、违规收取小微企业贷款承诺费，十九、收取财务顾问费质价不符，二十、利用银团贷款承诺费浮利分费，二十一、向检查组提供虚假整改说明材料，二十二、未如实提供信贷资产转让台账，二十三、案件信息迟报、瞒报，二十四、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位，对公司处以罚款 4880 万元。

2020 年 10 月 26 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对国家开发银行违反银行交易记录管理规定的违法违规行为，对国家开发银行处以 60 万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。

中国农业银行股份有限公司

中国农业银行股份有限公司旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会安徽监管局、上海监管局、西藏监管局、云南监管局、浙江监管局、北京监管局、山东监管局、辽宁监管局、新疆监管局、青海监管局、贵州监管局、迪庆监管分局、包头监管分局、保山监管分局、南平监管分局、吐鲁番监管分局、中卫监管分局、阜阳监管分局、东营监管分局、丽江监管分局、扬州监管分局、德州监管分局、芜湖监管分局、临沂监管分局、宿州监管分局、嘉兴监管分局、石河子监管分局、伊犁监管分局、孝感监管分局、防城监管分局、苏州监管分局、无锡监管分局、呼伦贝尔监管分局、安康监管分局、濮阳监管分局、青岛监管分局、运城监管分局、吉林监管分

局、泉州监管分局、佛山监管分局、牡丹江监管分局、吴忠监管分局、黄山监管分局、三亚监管分局、咸阳监管分局、新余监管分局、国家税务总局安徽省税务局、淮南市毛集社会发展综合实验区税务局、宜春市税务局第一税务分局、长丰县税务局、永兴县税务局、六安市叶集区税务局、衡阳市石鼓区税务局第二税务所、国家外汇管理局青海省分局、甘肃省分局、江西省分局、黑龙江省分局、新疆维吾尔自治区分局、深圳市分局、重庆外汇管理部、绍兴市中心支局、金华市中心支局、呼伦贝尔市中心支局、大庆市中心支局、锡林郭勒盟中心支局、巴彦淖尔市中心支局、乌海市中心支局、阿拉善盟中心支局、金昌市中心支局、丽水市中心支局、宿迁市中心支局、常州市中心支局和中国人民银行太原中心支行、深圳市中心支行、东营市中心支行、南昌中心支行、绵阳市中心支行、海口中心支行、蚌埠市中心支行、亳州市中心支行、吉林市中心支行、泸州市中心支行的行政处罚。

2021年1月19日，中国银行保险监督管理委员会针对中国农业银行股份有限公司的如下的违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第五项和相关审慎经营规则，对公司做出行政处罚决定：罚款420万元。

主要违法行为：

（一）发生重要信息系统突发事件未报告

（二）制卡数据违规明文留存

（三）生产网络、分行无线互联网络保护不当

（四）数据安全管理较粗放，存在数据泄露风险

（五）网络信息系统存在较多漏洞

（六）互联网门户网站泄露敏感信息

北京农村商业银行

2020年9月28日，中国人民银行营业管理部对北京农村商业银行为身份不明的客户提供服务或与其进行交易、未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定报送大额交易或可疑交易报告、未按照规定履行客户身份资料及交易记录保存义务的违法违规行为，对公司处以罚款1948万元。

广州农村商业银行

2021年4月1日，中国银保监会广东监管局对广州农村商业银行股份有限公司的违法行为，处以罚款50万元。

宁波银行股份有限公司

2020年10月27日，宁波银保监局针对宁波银行的授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位的违法违规行为，对公司罚款人民币30万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给

予纪律处分。

2021年8月6日，宁波银保监局针对宁波银行股份有限公司的贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储、开发贷款支用审核不严、房地产贷款放款和支用环节审核不严、贷款资金违规流入房市、房地产贷款资金回流借款人、票据业务开展不审慎的违法违规行为，对公司罚款人民币275万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

交通银行股份有限公司

交通银行股份有限公司在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚。

交通银行股份有限公司旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会北京监管局、新疆监管局、大连监管局、上海监管局、天津监管局、河南监管局、福建监管局、九江监管分局、临沂监管分局、襄阳监管分局、舟山监管分局、淄博监管分局、金华监管分局、韶关监管分局、南通监管分局、淮安监管分局、运城监管分局、平顶山监管分局、国家税务总局奇台县税务局、国家外汇管理局河北省分局、绥化市中心支局、三明市中心支局和中国人民银行上海分行、武汉市中心支行、长沙中心支行、马鞍山市中心支行、哈尔滨中心支行的行政处罚。

2021年7月13日，中国银行保险监督管理委员会针对交通银行股份有限公司的如下的违法违规行为，依据《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，对公司做出行政处罚决定：罚款4100万元。

主要违法行为：

一、理财业务和同业业务制度不健全

二、理财业务数据与事实不符

三、部分理财业务发展与监管导向不符

四、理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资

五、理财资金违规投向土地储备项目

六、理财产品相互交易调节收益

七、面向非机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券

八、公募理财产品投资单只证券超限额

九、理财资金违规投向交易所上市交易的股票

十、理财资金投资非标资产比照贷款管理不到位

十一、私募理财产品销售文件未约定冷静期

十二、开放式公募理财产品资产配置未达到流动性管理监管比例要求

十三、理财产品信息登记不及时

十四、理财产品信息披露不合规

十五、同业业务交易对手名单调整不及时

十六、将同业存款纳入一般性存款核算

十七、同业账户管理不规范

十八、违规增加政府性债务，且同业投资抵质押物风险管理有效性不足

十九、结构性存款产品衍生品交易无真实交易对手和交易行为

二十、未严格审查委托贷款资金来源

二十一、违规向委托贷款借款人收取手续费

二十二、利用理财资金与他行互投不良资产收益权，实现不良资产虚假出表

二十三、监管检查发现问题屡查屡犯

2021年08月13日，中国人民银行针对交通银行股份有限公司违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定的违规行为，对公司处以罚款62万元。

中国农业发展银行

中国农业发展银行旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会江苏监管局、上海监管局、浙江监管局、内蒙古监管局、达州监管分局、眉山监管分局、塔城监管分局、楚雄监管分局、南充监管分局、曲靖监管分局、宿州监管分局、黄冈监管分局、亳州监管分局、玉溪监管分局、阿克苏监管分局、晋城监管分局、开封监管分局、鹤壁监管分局、商丘监管分局、德州监管分局、国家税务总局泸溪县税务局、安仁县税务局、凤凰县税务局、衡阳市石鼓区税务局第二税务所和国家外汇管理局常州市中心支局行政处罚。

以上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。

5.8.3 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	172,100,494.50
4	应收申购款	108,415,989.99
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	280,516,484.49

5.8.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	31,233,014,939.41
报告期期间基金总申购份额	42,131,181,798.40
报告期期间基金总赎回份额	45,245,412,238.05
报告期期末基金份额总额	28,118,784,499.76

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§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）《鹏华安盈宝货币市场基金基金合同》；

（二）《鹏华安盈宝货币市场基金托管协议》；

（三）《鹏华安盈宝货币市场基金2021年第3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 10 月 26 日